

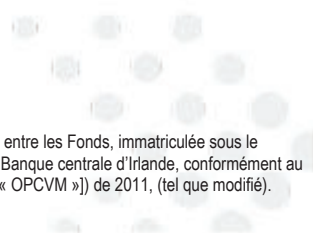


PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

# Rapport semestriel

30 juin 2026



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

A company of **Allianz** 

## CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES

**Type de Fonds :**  
OPCVM

**Nombre de Fonds proposés par la Société :**  
58 Fonds

**Catégories d'actions proposées par la Société au 30 juin 2026\* :**

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

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

### Types d'actions :

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

### Actif net (Montants en milliers) :

266 753 496 USD

### Participation minimale :

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

\* Reportez-vous à la note 16 pour obtenir la liste complète de toutes les catégories d'actions actuellement en circulation au cours de la période de déclaration actuelle et de la période précédente. Reportez-vous au Prospectus pour obtenir la liste de toutes les catégories d'actions proposées par chaque Fonds.

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

**Jour de négociation :**

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

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

**Devise de fonctionnement des Fonds :**

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

**Informations à l'intention des investisseurs allemands : aucune notification liée à la commercialisation en Allemagne n'a été déposée concernant le Fonds Income Fund II. En conséquence, les actions de ce compartiment ne doivent pas être commercialisées en Allemagne.**

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

**Autorisation à Hong Kong :**

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

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

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

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

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

**Autorisation à Singapour**

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

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

**Page Reuters :**  
PAFPLC

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



|                                                           | Page |
|-----------------------------------------------------------|------|
| Informations sur le marché*                               | 4    |
| Informations importantes concernant les Fonds             | 5    |
| Description des indices de référence                      | 71   |
| Bilan                                                     | 76   |
| Compte de résultat                                        | 96   |
| État de l'évolution des actifs nets                       | 116  |
| Tableau des investissements                               | 122  |
| Notes relatives aux États financiers                      | 982  |
| Variations importantes sur la composition du portefeuille | 1044 |
| Glossaire                                                 | 1108 |
| Informations générales                                    | 1110 |

| FONDS                                                  | Synthèse<br>des Fonds | Tableau des<br>investissements |
|--------------------------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | 6                     | 122                            |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund                | 7                     | 133                            |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 8                     | 144                            |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                    | 10                    | 178                            |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                          | 12                    | 190                            |
| Fonds Commodity Real Return Fund                       | 13                    | 200                            |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 14                    | 211                            |
| Fonds Diversified Income Fund                          | 15                    | 225                            |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | 17                    | 251                            |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | 18                    | 268                            |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | 19                    | 279                            |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | 20                    | 300                            |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                     | 21                    | 328                            |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | 22                    | 348                            |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 23                    | 372                            |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 24                    | 390                            |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 25                    | 401                            |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 26                    | 423                            |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                            | 27                    | 442                            |
| Fonds Euro Bond Fund                                   | 28                    | 455                            |
| Fonds Euro Credit Fund                                 | 29                    | 465                            |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | 30                    | 474                            |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund                  | 31                    | 488                            |
| Fonds Euro Short-Term Fund                             | 32                    | 496                            |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund              | 33                    | 501                            |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 34                    | 510                            |
| Fonds Global Advantage Fund                            | 35                    | 519                            |
| Fonds Global Bond Fund                                 | 36                    | 539                            |
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 38                    | 568                            |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | 39                    | 588                            |
| Fonds Global Bond Opportunities Fund                   | 40                    | 608                            |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 41                    | 615                            |
| Fonds Global High Yield Bond ESG Fund                  | 42                    | 628                            |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 43                    | 635                            |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 45                    | 659                            |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 46                    | 676                            |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 47                    | 686                            |
| Fonds Income Fund                                      | 48                    | 698                            |
| Fonds Income Fund II                                   | 51                    | 745                            |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 52                    | 756                            |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 53                    | 766                            |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 54                    | 779                            |

| FONDS                                            | Synthèse<br>des Fonds | Tableau des<br>investissements |
|--------------------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| Fonds Low Duration Opportunities Fund            | 55                    | 800                            |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund        | 56                    | 814                            |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                  | 57                    | 820                            |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund     | 58                    | 831                            |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                | 59                    | 835                            |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund               | 60                    | 847                            |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                           | 61                    | 857                            |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                  | 62                    | 871                            |
| Fonds Strategic Income Fund                      | 63                    | 880                            |
| Fonds Total Return Bond Fund                     | 64                    | 904                            |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 65                    | 921                            |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                     | 66                    | 931                            |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund           | 67                    | 941                            |
| Fonds US High Yield Bond Fund                    | 68                    | 948                            |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund    | 69                    | 958                            |
| Fonds US Short-Term Fund                         | 70                    | 971                            |

Ce rapport semestriel (le « Rapport semestriel ») peut être traduit dans d'autres langues. De telles traductions doivent contenir les mêmes informations uniquement et ont le même sens que le Rapport semestriel en langue anglaise. En cas de contradiction entre le Rapport semestriel en anglais et le Rapport semestriel dans une autre langue, le Rapport semestriel en anglais prévaudra, sauf dans la mesure où (et seulement dans cette mesure) il est exigé par la loi de toute juridiction où les actions sont vendues, que lors d'une action fondée sur des informations contenues dans un Rapport semestriel dans une langue autre que l'anglais, la langue du Rapport semestriel sur laquelle une telle action est basée prévaudra. Tout litige concernant les termes du Rapport semestriel, quelle que soit la langue du Rapport semestriel, sera régi par et interprété conformément au droit irlandais.

\* Le présent document contient les opinions de la Société, lesquelles peuvent changer sans préavis. Ce document a été diffusé à titre d'information uniquement. Les prévisions, estimations et certaines informations contenues dans les présentes se fondent sur des travaux de recherche exclusifs et ne doivent pas être considérées comme valant conseil d'investissement ou recommandation d'un titre, d'une stratégie ou d'un produit d'investissement particulier. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. Les informations contenues dans les présentes ont été obtenues de sources considérées comme fiables, mais non garanties. Aucune partie du présent document ne peut être reproduite, sous quelque forme que ce soit, ni évoquée dans une autre publication sans permission expresse écrite. PIMCO est une marque commerciale d'Allianz Asset Management of America LLC aux États-Unis et dans le monde entier. ©2026, PIMCO.

Cher Actionnaire,

Le présent rapport semestriel couvre la Période comptable de six mois close le 30 juin 2026 (la « Période comptable »). Vous trouverez dans les pages suivantes les renseignements afférents aux résultats d'investissement et une discussion concernant certains facteurs ayant eu un impact sur la performance au cours de la Période comptable.

Plusieurs banques centrales ont ajusté leurs taux d'intérêt dans un contexte d'évolution des perspectives d'inflation et de croissance. Les inquiétudes suscitées par les droits de douane américains et les tensions géopolitiques ont également pesé sur les marchés, notamment en raison du conflit au Moyen-Orient.

Avant le conflit au Moyen-Orient, l'inflation s'était stabilisée dans la plupart des grandes économies, bien qu'elle soit généralement restée supérieure aux objectifs fixés par les banques centrales. Depuis lors, l'inflation est repartie à la hausse, accentuant l'incertitude entourant les politiques économiques à l'échelle mondiale.

Dans ce contexte, et au cours de la Période comptable, la Réserve fédérale américaine (la « Fed ») et la Banque d'Angleterre ont maintenu leurs taux d'intérêt inchangés. En revanche, la Banque centrale européenne et la Banque du Japon ont relevé une fois leurs taux d'intérêt au cours de la Période comptable.

Les marchés financiers ont affiché des résultats positifs

Le rendement du bon du Trésor américain à 10 ans, titre de référence, a progressé au cours de la Période comptable. Les rendements des obligations d'État à 10 ans dans de nombreux autres marchés développés ont également augmenté.

Le marché obligataire mondial a généré un rendement positif, les obligations moins bien notées surperformant généralement celles mieux notées. Les actions mondiales ont enregistré une solide performance, sous l'impulsion du Japon et des marchés émergents. Sur le marché des matières premières, l'or et le cuivre ont atteint des niveaux records à plusieurs reprises, tandis que les prix du pétrole ont grimpé à leur plus haut niveau depuis plusieurs années, en raison des événements survenus au Moyen-Orient. Sur le marché des devises, le dollar américain s'est apprécié par rapport à l'euro, à la livre sterling et au yen japonais.

Grâce à son processus d'investissement éprouvé, PIMCO vise à tirer parti des avantages structurels de la gestion active des obligations au profit de ses clients. Nous continuons à travailler avec diligence pour tirer le meilleur parti de marchés mondiaux dynamiques et gérer les actifs que vous nous avez confiés. Nous vous invitons à échanger avec votre conseiller financier au sujet de vos objectifs, ainsi qu'à consulter le site [global.pimco.com](http://global.pimco.com) pour prendre connaissance de nos analyses les plus récentes.

Cordialement,



Craig A. Dawson,  
Président

| Rendements totaux de certaines catégories d'actifs pour la période close le 30 juin 2026                                                                       |           |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| Catégorie d'actifs (mesurée par l'indice, devise)                                                                                                              | Rendement |
| Actions des grandes capitalisations américaines (Indice S&P 500 Index, USD)                                                                                    | 10,21 %   |
| Actions mondiales (Indice MSCI World Index, USD)                                                                                                               | 9,69 %    |
| Actions européennes (Indice MSCI Europe Index, EUR)                                                                                                            | 10,75 %   |
| Actions des marchés émergents (Indice MSCI Emerging Markets Index, EUR)                                                                                        | 23,85 %   |
| Actions japonaises (Indice Nikkei 225 Index, JPY)                                                                                                              | 40,35 %   |
| Obligations locales des marchés émergents (Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, non couvert en USD)                | 1,52 %    |
| Dette extérieure des marchés émergents (Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, couvert en USD)                                             | 3,32 %    |
| Obligations dont la notation est inférieure à la qualité « investment grade » (Indice ICE BofA Developed Markets High Yield Constrained Index, couvert en USD) | 2,16 %    |
| Obligations mondiales de qualité « investment grade » (Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index, couvert en USD)                                         | 1,34 %    |
| Dette publique en devise locale à taux fixe de pays de qualité « investment grade » (Indice Bloomberg Global Treasury Index, couvert en USD)                   | 0,78 %    |

Au 30 juin 2026. SOURCE : PIMCO.

Actions des grandes capitalisations américaines représentées par l'Indice S&P 500 Index, Actions mondiales représentées par l'Indice MSCI World Index, Actions européennes représentées par l'Indice MSCI Europe Index, Actions des marchés émergents représentées par l'Indice MSCI Emerging Markets Index, Actions japonaises représentées par l'Indice Nikkei 225 Index, Obligations locales des marchés émergents représentées par l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, Dette extérieure des marchés émergents représentée par l'Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index, Obligations dont la notation est inférieure à la qualité « investment grade » représentées par l'Indice ICE BofA Developed Markets High Yield Constrained Index, Obligations mondiales de qualité « investment grade » représentées par l'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index, Dette publique en devise locale à taux fixe de pays de qualité « investment grade » représentée par l'Indice Bloomberg Global Treasury Index.

Au 30 juin 2026. Source : Trading Economics

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

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

À titre informatif et à des fins de contexte de marché uniquement. Sauf mention contraire dans le prospectus et le document d'information clé pour l'investisseur/document d'information clé correspondant, les indices susmentionnés ne sont pas utilisés dans la gestion active d'un quelconque fonds.

Le présent document contient les opinions actuelles du gestionnaire, lesquelles peuvent changer sans préavis. Ce document a été diffusé à des fins d'information seulement ne doit pas être considéré comme valant conseil d'investissement ou recommandation d'un titre, d'une stratégie ou d'un produit d'investissement particulier. Les informations contenues dans les présentes ont été obtenues de sources considérées comme fiables, mais non garanties. Aucune partie du présent document ne peut être reproduite, sous quelque forme que ce soit, ni évoquée dans une autre publication sans permission expresse écrite. PIMCO est une marque commerciale ou une marque commerciale déposée d'Allianz Asset Management of America LLC aux États-Unis et dans le monde entier. ©2026, PIMCO.

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

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

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

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

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

Les classifications géographiques des titres figurant dans le présent rapport sont établies en fonction du pays d'établissement des titres. Dans certains cas, le pays d'établissement d'un titre peut être différent de son pays d'exposition économique.

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

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

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                 | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                              |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2019)                     | 3,66 % | 2,06 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 14 février 2019)                       | 3,60 % | 2,06 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 mai 2021)                        | 3,53 % | (0,64 %)                  |
| Investisseurs, distribution (lancement le 20 août 2020)                         | 3,58 % | 0,45 %                    |
| Administrations, distribution (lancement le 14 février 2019)                    | 3,49 % | 1,57 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> juillet 2020)         | 3,19 % | 0,56 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 14 février 2019)                        | 3,29 % | 1,16 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 12 mars 2021)                        | 3,67 % | (0,02 %)                  |
| M Détail, distribution II (lancement le 14 février 2019)                        | 3,30 % | 1,16 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 14 février 2019)                      | 4,01 % | 2,73 %                    |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index                                 | 4,01 % | 2,41 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                              |        |                           |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2020)  | 3,43 % | (0,17 %)                  |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en AUD)                | 3,86 % | 0,46 %                    |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                              |        |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020)   | 1,62 % | (2,28 %)                  |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020)     | 1,55 % | (2,27 %)                  |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020)    | 1,09 % | (3,14 %)                  |
| Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020)      | 1,27 % | (3,15 %)                  |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CHF)                | 1,73 % | (1,85 %)                  |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                              |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020) | 2,79 % | (0,76 %)                  |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020)   | 2,82 % | (0,74 %)                  |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 10 septembre 2020)  | 2,63 % | (1,41 %)                  |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020)  | 2,36 % | (1,62 %)                  |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020)    | 2,20 % | (1,65 %)                  |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en EUR)                | 3,00 % | (0,73 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                              |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 juillet 2021)   | 3,68 % | 0,26 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 6 mai 2021)          | 3,62 % | (0,50 %)                  |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en GBP)                | 3,88 % | 0,01 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                              |        |                           |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 14 février 2019)  | 4,03 % | 1,16 %                    |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019)  | 3,96 % | 1,14 %                    |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (non couvert en HKD)            | 4,79 % | 2,40 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                              |        |                           |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)     | 2,39 % | (0,70 %)                  |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 20 août 2020)       | 2,17 % | (0,70 %)                  |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 14 février 2019)      | 1,91 % | 0,11 %                    |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019)      | 1,87 % | 0,10 %                    |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en SGD)                | 2,58 % | 1,19 % <sup>2</sup>       |

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

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

**Objectif d'investissement et présentation de la stratégie**

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                       | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                    |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 2 mai 2023)                                | 1,74 %   | 6,71 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 4 septembre 2020)                            | 1,72 %   | 1,64 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 4 septembre 2020)                           | 1,36 %   | 0,78 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> juin 2010)                    | 1,35 %   | 3,03 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> décembre 2020)              | 2,09 %   | 2,13 %                       |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index <sup>3</sup>                                        | 1,24 %   | 3,71 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                    |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2023)              | 0,87 %   | 4,75 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 mars 2021)               | 0,86 %   | (0,29 %)                     |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2021)              | 0,43 %   | (1,14 %)                     |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en EUR) <sup>3</sup>                       | 0,32 %   | (0,33 %) <sup>2</sup>        |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                    |          |                              |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2011)          | 4,15 %   | 3,19 %                       |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (non couvert en EUR) <sup>3</sup>                   | 3,99 %   | 4,25 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                    |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 13 août 2021)              | 1,83 %   | 1,09 %                       |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en GBP) <sup>3</sup>                       | 1,21 %   | 1,05 %                       |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                                    |          |                              |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 septembre 2020)       | 2,16 %   | 0,98 %                       |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> mars 2011) | 2,12 %   | 1,97 %                       |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (non couvert en HKD) <sup>3</sup>                   | 1,99 %   | 2,88 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                    |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)            | 0,43 %   | 0,60 %                       |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)             | 0,05 %   | (0,25 %)                     |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en SGD) <sup>3</sup>                       | (0,10 %) | 0,27 %                       |

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                                                                     | 6 mois  | Lancement<br>de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 15 avril 2009)                                                                           | 10,51 % | 7,25 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 6 juin 2025)                                                                               | 10,49 % | 23,52 %                      |
| Institutions, distribution II (lancement le 1 <sup>er</sup> octobre 2024)                                                           | 10,55 % | 17,65 %                      |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010)                                                                      | 10,30 % | 5,82 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 13 janvier 2025)                                                                      | 10,22 % | 22,69 %                      |
| Administrations, distribution (lancement le 3 mars 2025)                                                                            | 10,19 % | 21,27 %                      |
| Administrations, distribution II (lancement le 7 octobre 2024)                                                                      | 10,30 % | 17,74 %                      |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 juin 2009)                                                                             | 9,85 %  | 5,79 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 janvier 2011)                                                                            | 9,84 %  | 4,80 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022)                                                                         | 10,39 % | 11,64 %                      |
| H Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2022)                                                                           | 10,40 % | 11,66 %                      |
| BM Détail, décumulation (lancement le 10 avril 2024)                                                                                | 9,56 %  | 16,10 %                      |
| M Détail, capitalisation (lancement le 30 novembre 2023)                                                                            | 10,15 % | 18,55 %                      |
| M Détail, décumulation (lancement le 10 avril 2024)                                                                                 | 10,22 % | 17,25 %                      |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2023)                                                                              | 10,20 % | 18,57 %                      |
| M Détail, distribution II (lancement le 30 novembre 2023)                                                                           | 10,14 % | 18,56 %                      |
| Catégorie UA, capitalisation (lancement le 12 janvier 2026)                                                                         | —       | 7,70 %                       |
| Catégorie UA, distribution II (lancement le 12 janvier 2026)                                                                        | —       | 7,71 %                       |
| UM Détail, distribution II (lancement le 29 avril 2024)                                                                             | 10,15 % | 18,04 %                      |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 6 juillet 2016)                                                                           | 11,06 % | 9,92 %                       |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>                  | 7,07 %  | 8,69 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 27 juin 2025)                                                          | 10,78 % | 23,09 %                      |
| Institutions en AUD (couverte), distribution II (lancement le 27 juin 2025)                                                         | 10,80 % | 23,12 %                      |
| M Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 9 septembre 2024)                                                         | 10,41 % | 17,69 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en AUD) <sup>3</sup> | 7,39 %  | 13,52 % <sup>2</sup>         |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2025)                                                     | 8,71 %  | 13,60 %                      |
| M Détail en CHF (couverte), distribution II (lancement le 9 septembre 2024)                                                         | 8,34 %  | 13,58 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en CHF) <sup>3</sup> | 5,30 %  | 9,28 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CNH</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en RMB (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023)                                                      | 9,79 %  | 16,96 %                      |
| Institutions en RMB (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023)                                                        | 9,80 %  | 16,95 %                      |
| M Détail en RMB (couverte), distribution II (lancement le 9 septembre 2024)                                                         | 9,44 %  | 15,70 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en RMB) <sup>3</sup> | 6,36 %  | 12,65 % <sup>2</sup>         |
| <b>Catégories libellées en CNH (non couvertes)</b>                                                                                  |         |                              |
| Institutions en RMB (non couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023)                                                  | 7,47 %  | 17,02 %                      |
| Institutions en RMB (non couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023)                                                    | 7,46 %  | 16,99 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>                  | 4,12 %  | 12,90 %                      |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 avril 2009)                                                         | 10,08 % | 6,21 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 27 juin 2025)                                                         | 10,10 % | 21,35 %                      |
| Administrations en EUR (couverte), distribution II (lancement le 14 mars 2025)                                                      | 9,76 %  | 20,33 %                      |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 juin 2009)                                                           | 9,48 %  | 4,76 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 24 juin 2011)                                                             | 9,41 %  | 3,69 %                       |
| M Détail en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2025)                                                         | 9,71 %  | 15,20 %                      |
| M Détail en EUR (couverte), distribution II (lancement le 26 février 2025)                                                          | 9,73 %  | 17,78 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en EUR) <sup>3</sup> | 6,67 %  | 7,47 % <sup>2</sup>          |

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



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                                                                                     | 6 mois  | Lancement<br>de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2010)                                                            | 10,99 % | 6,01 %                       |
| M Détail en GBP (couverte), distribution II (lancement le 9 septembre 2024)                                                         | 10,54 % | 18,28 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en GBP) <sup>3</sup> | 7,55 %  | 7,32 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 6 juin 2025)                                                         | 11,28 % | 23,52 %                      |
| Administrations en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 7 octobre 2024)                                                | 11,10 % | 18,44 %                      |
| M Détail en HKD (non couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023)                                                      | 10,96 % | 18,75 %                      |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023)                                                        | 10,93 % | 18,73 %                      |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 30 novembre 2023)                                                     | 10,99 % | 18,72 %                      |
| Catégorie UA en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 12 janvier 2026)                                                  | —       | 8,42 %                       |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>                  | 7,87 %  | 15,32 % <sup>2</sup>         |
| <b>Catégories libellées en JPY</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en JPY (couverte), distribution II (lancement le 27 juin 2025)                                                         | 9,28 %  | 19,56 %                      |
| M Détail en JPY (couverte), distribution II (lancement le 5 juillet 2024)                                                           | 8,94 %  | 12,35 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en JPY) <sup>3</sup> | 6,03 %  | 8,52 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                                                  |         |                              |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 27 juin 2025)                                                          | 9,62 %  | 20,61 %                      |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 6 juin 2025)                                                             | 9,69 %  | 21,24 %                      |
| Institutions en SGD (couverte), distribution II (lancement le 27 juin 2025)                                                         | 9,73 %  | 20,72 %                      |
| Administrations en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2025)                                                      | 9,39 %  | 27,06 %                      |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 17 décembre 2025)                                                     | 9,36 %  | 11,00 %                      |
| Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 7 octobre 2024)                                                    | 9,35 %  | 15,39 %                      |
| M Détail en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023)                                                          | 9,27 %  | 16,54 %                      |
| M Détail en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023)                                                            | 9,31 %  | 16,53 %                      |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 30 novembre 2023)                                                         | 9,36 %  | 16,53 %                      |
| Catégorie UA en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2026)                                                       | —       | 6,90 %                       |
| Catégorie UA en SGD (couverte), distribution II (lancement le 12 janvier 2026)                                                      | —       | 6,91 %                       |
| UM Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 29 avril 2024)                                                           | 9,32 %  | 15,55 %                      |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en SGD) <sup>3</sup> | 6,25 %  | 12,96 % <sup>2</sup>         |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 29 novembre 2023 : 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index / 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD ; à partir du 30 novembre 2023 : 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index / 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                             |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2013)                    | 2,15 %   | 5,91 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 23 septembre 2014)                    | 2,10 %   | 5,36 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 19 mai 2014)                       | 1,94 %   | 4,91 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 19 mai 2014)                         | 1,92 %   | 4,91 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 9 août 2013)                     | 1,88 %   | 5,33 %                       |
| Administrations, distribution (lancement le 9 août 2013)                       | 1,91 %   | 5,33 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 octobre 2013)                     | 1,69 %   | 4,76 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 19 mai 2014)                           | 1,66 %   | 4,35 %                       |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)                      | 1,66 %   | 4,60 %                       |
| Catégorie R, distribution (lancement le 18 mars 2014)                          | 2,05 %   | 5,20 %                       |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)                       | 1,47 %   | 4,23 %                       |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 31 octobre 2013)                       | 2,48 %   | 6,50 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                         | 1,85 %   | 2,07 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                             |          |                              |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 24 avril 2024)    | 2,03 %   | 9,08 %                       |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 20 mars 2024)       | 2,17 %   | 8,50 %                       |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)       | 1,86 %   | 4,02 %                       |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 11 août 2015)        | 2,56 %   | 5,67 %                       |
| Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index                                      | 1,99 %   | 2,20 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en BRL</b>                                             |          |                              |
| Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 2 janvier 2018)   | 12,68 %  | 4,31 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en BRL) <sup>3</sup>        | 12,58 %  | 2,62 %                       |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                             |          |                              |
| Investisseurs en CAD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)      | 1,10 %   | 4,35 %                       |
| Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) <sup>4</sup>        | 1,14 %   | 2,33 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                             |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)      | 0,06 %   | 3,17 %                       |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 juin 2014)      | (0,42 %) | 1,41 %                       |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>                        | (0,03 %) | (0,36 %) <sup>2</sup>        |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                             |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)      | 1,23 %   | 4,11 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 août 2013)        | 1,19 %   | 4,11 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014) | 1,23 %   | 3,40 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2016) | 1,02 %   | 3,90 %                       |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)   | 0,96 %   | 3,58 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 octobre 2013)   | 0,76 %   | 3,00 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)     | 0,73 %   | 2,51 %                       |
| Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014)        | 1,09 %   | 3,16 %                       |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 0,54 %   | 2,24 %                       |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>                         | 0,98 %   | 0,64 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                             |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)      | 2,04 %   | 5,11 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 juillet 2013)    | 2,06 %   | 5,16 %                       |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020)   | 1,85 %   | 3,44 %                       |
| M Détail en GBP (couverte), distribution (lancement le 9 mai 2024)             | 1,54 %   | 7,98 %                       |
| Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014)        | 2,05 %   | 4,20 %                       |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>                        | 1,89 %   | 1,68 % <sup>2</sup>          |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                             | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                          |        |                              |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017) | 2,48 % | 4,21 %                       |
| Indice HIBOR Index à 3 mois                                                 | 1,41 % | 2,45 %                       |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                          |        |                              |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021) | 0,86 % | 2,49 %                       |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)    | 0,65 % | 3,88 %                       |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 0,41 % | 3,91 %                       |
| Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA <sup>8</sup>     | 0,54 % | 1,55 % <sup>2</sup>          |

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

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

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

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

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

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

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

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                  | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                               |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)                    | 0,93 %   | 1,39 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mars 2025)                         | 0,67 %   | 4,13 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)                     | 1,18 %   | 1,94 %                       |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD)                          | 2,08 %   | (0,09 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                               |          |                              |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 17 avril 2023)        | 0,85 %   | 4,93 %                       |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en AUD)                          | 2,08 %   | 4,45 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                               |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 novembre 2020)   | (1,11 %) | (2,07 %)                     |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en CHF)                          | 0,00 %   | (3,62 %)                     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                               |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)  | 0,00 %   | (0,35 %)                     |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 2 décembre 2020)      | 0,07 %   | (0,51 %)                     |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 mars 2025)       | (0,19 %) | 2,03 %                       |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 janvier 2024) | (0,28 %) | 2,93 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)   | (0,43 %) | (1,23 %)                     |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en EUR)                          | 1,17 %   | (1,88 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                               |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)  | 0,86 %   | 0,98 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 avril 2021)        | 0,94 %   | 1,02 %                       |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en GBP)                          | 2,05 %   | (0,58 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                               |          |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2021)       | (0,18 %) | (0,56 %)                     |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)  | (0,43 %) | (1,06 %)                     |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SEK)                          | 0,98 %   | (1,90 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                               |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2021)    | (0,40 %) | 0,09 %                       |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SGD)                          | 0,75 %   | (1,32 %)                     |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                         | 6 mois  | Lancement de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                      |         |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 août 2006)                                | 14,43 % | 1,11 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 11 août 2011)                               | 14,21 % | 0,40 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007)                            | 13,93 % | (0,07 %)                  |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022)                             | 14,33 % | 1,98 %                    |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return                                           | 14,36 % | (0,02 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                      |         |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2010)               | 13,37 % | 0,75 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 24 mars 2026)             | —       | (4,20 %)                  |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 mars 2012)                | 12,82 % | (1,24 %)                  |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en EUR)                          | 13,24 % | (0,22 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                      |         |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 11 juin 2021)          | 17,54 % | 9,86 %                    |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en EUR)                      | 17,48 % | 10,42 %                   |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                      |         |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> mars 2017) | 14,34 % | 5,68 %                    |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en GBP)                          | 14,08 % | 5,18 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP (non couvertes)</b>                                      |         |                           |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 novembre 2022)        | 16,01 % | 2,93 %                    |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en GBP)                      | 15,89 % | 2,83 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                      |         |                           |
| Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2021)           | 12,53 % | 6,31 %                    |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en SGD)                          | 12,77 % | 8,05 %                    |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                             |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 octobre 2011)                    | 0,06 %   | 3,75 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 décembre 2012)                    | (0,36 %) | 2,38 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 10 avril 2024)                    | (0,09 %) | 6,20 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 décembre 2024)                    | 0,37 %   | 5,93 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                         | 1,85 %   | 1,87 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                             |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2012) | (1,92 %) | 0,85 %                       |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>                        | (0,03 %) | (0,35 %)                     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                             |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2011)  | (0,85 %) | 2,28 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 décembre 2012)  | (1,24 %) | 0,83 %                       |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>5</sup>                         | 0,98 %   | 0,64 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                             |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 10 janvier 2025)  | 0,09 %   | 5,51 %                       |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index                                     | 1,89 %   | 4,17 %                       |

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

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

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                                                                                                                                                                                           | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                                                                                                                                        |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)                                                                                                                                                                                                  | 2,31 %   | 5,54 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 8 septembre 2008)                                                                                                                                                                                                | 2,33 %   | 5,61 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 avril 2013)                                                                                                                                                                                                | 2,10 %   | 3,40 %                    |
| Investisseurs, distribution (lancement le 30 avril 2013)                                                                                                                                                                                                  | 2,09 %   | 3,40 %                    |
| Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2011)                                                                                                                                                                                              | 2,03 %   | 4,00 %                    |
| BE Détail, capitalisation (lancement le 25 août 2025)                                                                                                                                                                                                     | 1,46 %   | 4,40 %                    |
| BM Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023)                                                                                                                                                                                                   | 1,32 %   | 5,78 %                    |
| BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)                                                                                                                                                                                                   | 1,37 %   | 3,67 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)                                                                                                                                                                                              | 1,85 %   | 4,57 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)                                                                                                                                                                                                  | 1,89 %   | 4,63 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 8 juin 2011)                                                                                                                                                                                                 | 2,20 %   | 4,33 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 14 mai 2020)                                                                                                                                                                                                   | 2,19 %   | 3,40 %                    |
| M Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023)                                                                                                                                                                                                    | 1,83 %   | 6,80 %                    |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)                                                                                                                                                                                                    | 1,85 %   | 3,77 %                    |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)                                                                                                                                                                                                 | 1,84 %   | 3,30 %                    |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)                                                                                                                                                                                                | 1,62 %   | 2,77 %                    |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)                                                                                                                                                                                                  | 1,63 %   | 2,77 %                    |
| Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                                   | 2,39 %   | 2,50 %                    |
| Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                                     | 2,30 %   | 2,47 %                    |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en USD) <sup>3</sup> | 2,16 %   | 5,34 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                                                                                                                                                                                        |          |                           |
| M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012)                                                                                                                                                                                  | 1,78 %   | 3,01 %                    |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en AUD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en AUD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en AUD) <sup>3</sup> | 2,13 %   | 3,89 %                    |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                                                                                                                                                                                                        |          |                           |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 20 février 2019)                                                                                                                                                                             | 1,40 %   | 2,88 %                    |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en CAD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en CAD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en CAD) <sup>3</sup> | 1,30 %   | 2,99 %                    |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                                                                                                                                                                                        |          |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)                                                                                                                                                                                | 0,22 %   | 2,09 %                    |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012)                                                                                                                                                                                  | 0,22 %   | 1,53 %                    |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 11 septembre 2019)                                                                                                                                                                            | (0,22 %) | (1,30 %)                  |
| Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                 | 0,32 %   | (0,85 %)                  |
| Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                   | 0,17 %   | (0,86 %)                  |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en CHF), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en CHF) et JPMorgan EMBI Global (couvert en CHF) <sup>3</sup> | 0,02 %   | 2,11 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                                                                                                                                        |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 février 2007)                                                                                                                                                                             | 1,40 %   | 4,17 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 octobre 2007)                                                                                                                                                                               | 1,34 %   | 4,19 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 juillet 2007)                                                                                                                                                                             | 1,21 %   | 3,94 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013)                                                                                                                                                                              | 1,20 %   | 1,84 %                    |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 juillet 2007)                                                                                                                                                                          | 1,12 %   | 3,78 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 3 juillet 2007)                                                                                                                                                                               | 0,95 %   | 3,40 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 16 octobre 2009)                                                                                                                                                                                | 0,85 %   | 2,93 %                    |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)                                                                                                                                                                            | 0,73 %   | 0,84 %                    |

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



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                                                                                                                                                                                                           | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)                                                                                                                                                                              | 0,76 % | 0,84 %                       |
| Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                 | 1,46 % | 0,65 %                       |
| Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                   | 1,41 % | 0,66 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en EUR), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en EUR) et JPMorgan EMBI Global (couvert en EUR) <sup>3</sup> | 1,22 % | 3,80 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                                                                                                                                        |        |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2006)                                                                                                                                                                                 | 2,22 % | 5,22 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 14 février 2006)                                                                                                                                                                               | 2,17 % | 5,17 %                       |
| Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 21 juillet 2011)                                                                                                                                                                            | 1,99 % | 3,39 %                       |
| Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                 | 2,37 % | 2,01 %                       |
| Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                   | 2,34 % | 2,01 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en GBP), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en GBP) et JPMorgan EMBI Global (couvert en GBP) <sup>3</sup> | 2,10 % | 4,85 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en JPY</b>                                                                                                                                                                                                                        |        |                              |
| Administrations en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)                                                                                                                                                                           | 0,45 % | (2,58 %)                     |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en JPY), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en JPY) et JPMorgan EMBI Global (couvert en JPY) <sup>3</sup> | 0,54 % | (1,64 %)                     |
| <b>Catégories libellées en MXN</b>                                                                                                                                                                                                                        |        |                              |
| Institutions en MXN (couverte), capitalisation (lancement le 9 décembre 2020)                                                                                                                                                                             | 3,83 % | 7,55 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en MXN), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en MXN) et JPMorgan EMBI Global (couvert en MXN) <sup>3</sup> | 3,61 % | 8,16 %                       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                                                                                                                                                                                        |        |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                                                                                                                                                                | 1,19 % | 4,43 %                       |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2020)                                                                                                                                                                         | 0,90 % | (0,54 %)                     |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en SEK), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en SEK) et JPMorgan EMBI Global (couvert en SEK) <sup>3</sup> | 1,03 % | 4,06 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                                                                                                                                                                        |        |                              |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 7 novembre 2019)                                                                                                                                                                               | 1,03 % | 1,67 %                       |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> mai 2019)                                                                                                                                                                   | 0,76 % | 1,71 %                       |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> octobre 2019)                                                                                                                                                                   | 0,56 % | 0,72 %                       |
| Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                                                                                                                                                                                   | 1,07 % | 1,24 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en SGD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en SGD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en SGD) <sup>3</sup> | 0,81 % | 2,44 % <sup>2</sup>          |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Diversified Income Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 9 novembre 2015 : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit Component Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index ; à partir du 10 novembre 2015, 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD).

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                                                                                                                                                 | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                                                                                                                                              |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2011)                                                                                                                                                                                                         | 3,32 % | 4,66 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 février 2014)                                                                                                                                                                                                    | 3,15 % | 4,07 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 août 2013)                                                                                                                                                                                                         | 2,89 % | 3,56 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 mai 2011)                                                                                                                                                                                                            | 2,86 % | 3,75 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets<br>(couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield<br>Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en USD) <sup>3</sup> | 3,32 % | 4,47 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                                                                                                                                              |        |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 août 2011)                                                                                                                                                                                      | 2,49 % | 3,42 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 1 <sup>er</sup> octobre 2013)                                                                                                                                                                     | 2,51 % | 2,80 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 11 août 2011)                                                                                                                                                                                       | 2,02 % | 2,58 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2013)                                                                                                                                                                                           | 1,87 % | 1,63 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets<br>(couvert en EUR), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield<br>Constrained Index (couvert en EUR) et JPMorgan EMBI Global (couvert en EUR) <sup>3</sup> | 2,33 % | 3,34 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                                                                                                                                              |        |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 août 2011)                                                                                                                                                                                      | 3,30 % | 4,46 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2013)                                                                                                                                                                                     | 3,28 % | 3,63 %                       |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets<br>(couvert en GBP), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield<br>Constrained Index (couvert en GBP) et JPMorgan EMBI Global (couvert en GBP) <sup>3</sup> | 3,25 % | 4,29 % <sup>2</sup>          |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund est mesurée comme suit : du lancement au 9 novembre 2015 — Combinaison des trois indices suivants à duration constante de 25 ans : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global ; à partir du 10 novembre 2015, combinaison des trois indices suivants à duration constante de 25 ans : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index (couvert en USD) ; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD).

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                             |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                                                                                                                                                                                                    | 2,06 % | 6,64 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                                                                                                                                                                                                     | 1,64 % | 5,70 %                    |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index, ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index et J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified <sup>2</sup>                                                    | 2,02 % | 6,66 %                    |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                             |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                                                                                                                                                                                  | 1,11 % | 4,44 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                                                                                                                                                                                   | 0,70 % | 3,51 %                    |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index (couvert en EUR), ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (couvert en EUR) et J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en EUR) <sup>2</sup> | 1,07 % | 4,35 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                             |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                                                                                                                                                                                  | 1,94 % | 6,13 %                    |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index (couvert en GBP), ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (couvert en GBP) et J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en GBP) <sup>2</sup> | 1,95 % | 6,00 %                    |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Diversified Income ESG Fund est mesurée comme suit : du lancement au 14 avril 2026 : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (« EMBI ») Global Diversified ; à partir du 15 avril 2026 : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index, ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index et J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                   | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 15 décembre 2008)                      | 1,54 %   | 3,11 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 22 février 2010)                         | 1,52 %   | 2,88 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010)                    | 1,35 %   | 2,29 %                    |
| Investisseurs, distribution (lancement le 24 septembre 2010)                      | 1,47 %   | 2,28 %                    |
| Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2010)                    | 1,29 %   | 2,35 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 mai 2010)                            | 1,13 %   | 1,86 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 11 mai 2010)                              | 1,10 %   | 1,86 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)                    | 1,51 %   | 3,27 %                    |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                       | 1,53 %   | 2,47 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021)                      | 2,04 %   | 3,86 %                    |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                            | 1,85 %   | 1,51 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                                |          |                           |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018)   | 0,74 %   | 2,60 %                    |
| Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) <sup>4</sup>           | 1,14 %   | 2,26 %                    |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                |          |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 septembre 2010)    | (0,46 %) | 0,49 %                    |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 avril 2011)        | (0,95 %) | (0,44 %)                  |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>                           | (0,03 %) | (0,17 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 mai 2009)         | 0,65 %   | 1,97 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 23 décembre 2009)      | 0,66 %   | 1,66 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2011)    | 0,43 %   | 1,04 %                    |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 janvier 2010)  | 0,39 %   | 1,10 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 novembre 2009)     | 0,25 %   | 0,75 %                    |
| G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 14 décembre 2010)          | 0,24 %   | 0,52 %                    |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>                            | 0,98 %   | 0,60 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 15 décembre 2009)    | 1,48 %   | 2,50 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 février 2012)       | 1,53 %   | 2,35 %                    |
| Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 mars 2010)         | 1,11 %   | 1,51 %                    |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>                           | 1,89 %   | 1,40 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                |          |                           |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 11 avril 2011)       | 1,71 %   | 2,63 %                    |
| Indice NIBOR Rate Index à 1 mois                                                  | 2,05 %   | 1,97 %                    |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                |          |                           |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2011) | 0,22 %   | 1,16 %                    |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en SEK) <sup>3</sup>           | 0,88 %   | 0,81 %                    |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 1 mois ; à partir du 1<sup>er</sup> juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.<sup>4</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR Index à 1 mois (couvert en CAD) ; à partir du 1<sup>er</sup> juillet 2022 : Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA).<sup>5</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR CHF Index à 1 mois ; à partir du 1<sup>er</sup> juillet 2021 : Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index.<sup>6</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor Index à 1 mois ; à partir du 1<sup>er</sup> juillet 2021 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.<sup>7</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR GBP Index à 1 mois ; à partir du 1<sup>er</sup> juillet 2021 : Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                      | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                   |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 11 décembre 2007)                                         | 2,23 % | 3,32 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2008)                                              | 2,26 % | 3,17 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 août 2010)                                            | 2,02 % | 1,99 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008)                                          | 1,72 % | 3,83 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 8 juillet 2010)                                              | 1,65 % | 1,60 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 26 février 2021)                                        | 2,15 % | 4,79 %                    |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008)                                            | 2,69 % | 5,73 %                    |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert)        | 1,52 % | 2,72 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                   |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 octobre 2025)                        | 1,07 % | 4,00 %                    |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (couvert en EUR)     | 0,44 % | 2,69 %                    |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                                   |        |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2010)                      | 5,05 % | 3,58 %                    |
| Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 23 juin 2010)                         | 4,90 % | 3,13 %                    |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009)                      | 4,50 % | 3,71 %                    |
| Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2018)                      | 4,45 % | 4,49 %                    |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR) | 4,28 % | 4,05 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                   |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2026)                        | —      | 1,30 %                    |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (couvert en GBP)     | —      | 0,88 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP (non couvertes)</b>                                                   |        |                           |
| Institutions en GBP (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juin 2008)                       | 3,61 % | 5,74 %                    |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP) | 2,88 % | 5,07 %                    |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                              | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                           |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                  | 1,90 % | 10,86 %                   |
| Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                    | 1,82 % | 10,86 %                   |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                   | 1,34 % | 9,77 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 27 juillet 2022)                                                                                     | 1,29 % | 9,76 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)                                                                                 | 2,33 % | 12,87 %                   |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Government Bond Index Global Diversified <sup>3</sup>                      | 1,61 % | 9,69 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                           |        |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                            | 4,65 % | 7,47 %                    |
| Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)                                                              | 4,59 % | 7,47 %                    |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                                             | 4,16 % | 6,43 %                    |
| Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)                                                               | 4,16 % | 6,42 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Government Bond Index Global Diversified (non couvert en EUR) <sup>3</sup> | 4,38 % | 6,33 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                           |        |                           |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 28 juin 2023)                                                                 | 3,18 % | 7,19 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Government Bond Index Global Diversified (non couvert en GBP) <sup>3</sup> | 2,97 % | 5,97 %                    |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Emerging Local Bond ESG Fund est mesurée comme suit : du lancement au 14 avril 2026 : Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index ; à partir du 15 avril 2026 : Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Government Bond Index Global Diversified.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                  | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                               |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2001)                      | 3,65 % | 7,86 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 13 décembre 2001)                       | 3,66 % | 7,32 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 avril 2002)                       | 3,49 % | 6,64 %                    |
| Administrations, capitalisation (lancement le 29 mai 2003)                       | 3,39 % | 5,72 %                    |
| BM Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023)                          | 2,69 % | 9,23 %                    |
| BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)                          | 2,68 % | 6,19 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                          | 3,19 % | 4,66 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)                         | 3,15 % | 4,77 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 17 octobre 2002)                    | 3,57 % | 7,45 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 3 septembre 2020)                     | 3,63 % | 3,35 %                    |
| M Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023)                           | 3,16 % | 10,27 %                   |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)                           | 3,20 % | 3,87 %                    |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)                        | 3,23 % | 3,66 %                    |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008)                        | 4,04 % | 7,83 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global                        | 2,85 % | 6,93 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                               |        |                           |
| M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012)         | 3,08 % | 2,80 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en AUD)       | 2,73 % | 3,18 %                    |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                               |        |                           |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2005)     | 1,48 % | 3,23 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en CHF)       | 0,62 % | 3,05 %                    |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                               |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2002)   | 2,73 % | 5,85 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 20 décembre 2010)     | 2,70 % | 3,33 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019)  | 2,53 % | 1,41 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)        | 2,24 % | 3,24 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en EUR)       | 1,86 % | 5,45 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                               |        |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2018) | 6,54 % | 5,22 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (non couvert en EUR)   | 5,65 % | 4,32 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                               |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004)     | 3,58 % | 5,84 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)     | 3,54 % | 5,06 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en GBP)       | 2,74 % | 5,71 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                               |        |                           |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 3 mars 2025)        | 3,59 % | 11,49 %                   |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en NOK)       | 3,21 % | 10,68 %                   |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                               |        |                           |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 6 mars 2025)        | 2,51 % | 9,92 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en SEK)       | 2,07 % | 8,85 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                               |        |                           |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2018)     | 2,28 % | 3,77 %                    |
| Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007)     | 1,83 % | 3,59 %                    |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en SGD)       | 1,44 % | 4,45 % <sup>2</sup>       |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                   | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 16 avril 2010)                                                                         | 2,78 % | 4,36 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 10 juillet 2019)                                                                         | 2,81 % | 2,97 %                    |
| Administrations, capitalisation (lancement le 10 juillet 2019)                                                                    | 2,51 % | 2,46 %                    |
| Administrations, distribution (lancement le 10 juillet 2019)                                                                      | 2,55 % | 2,46 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 5 février 2021)                                                                         | 2,32 % | 1,03 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 5 février 2021)                                                                           | 2,44 % | 1,03 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 2 juin 2026)                                                                         | —      | 1,00 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> mars 2023)                                                              | 3,22 % | 11,61 %                   |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified <sup>3</sup>                      | 2,49 % | 4,50 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                                                                |        |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 avril 2021)                                                        | 0,64 % | (0,98 %)                  |
| H Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 2 juin 2026)                                                       | —      | 0,70 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en CHF) <sup>3</sup>     | 0,26 % | (1,62 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 octobre 2013)                                                     | 1,91 % | 1,97 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2017)                                                       | 1,91 % | 0,97 %                    |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 janvier 2024)                                                  | 1,58 % | 8,61 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 août 2018)                                                         | 1,40 % | 1,04 %                    |
| H Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 juin 2026)                                                       | —      | 0,90 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en EUR) <sup>3</sup>     | 1,50 % | 2,02 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2019)                                                      | 2,73 % | 2,11 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en GBP) <sup>3</sup>     | 2,39 % | 1,30 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP (non couvertes)</b>                                                                                |        |                           |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020)                                                  | 4,19 % | 1,89 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (non couvert en GBP) <sup>3</sup> | 3,87 % | 1,34 %                    |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                                                                |        |                           |
| Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 17 mars 2014)                                                       | 2,52 % | 2,82 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en NOK) <sup>3</sup>     | 2,43 % | 2,98 %                    |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                                                                |        |                           |
| Investisseurs en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 6 février 2014)                                                     | 1,42 % | 1,69 %                    |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)                                                   | 1,34 % | 0,00 %                    |
| Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en SEK) <sup>3</sup>     | 1,27 % | 2,01 % <sup>2</sup>       |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 1<sup>er</sup> août 2019 : Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global ajusté pour tenir compte du filtre ISR (Investissement socialement responsable) ; du 2 août 2019 au 14 avril 2026 : Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified ; à partir du 15 avril 2026 : Indice J.P. Morgan Screened, Tilted & Reweighted Emerging Markets Bond Index Global Diversified.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                    | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                 |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 novembre 2009)                       | 2,11 %   | 4,19 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 février 2012)                         | 1,61 %   | 2,63 %                       |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)          | 2,10 %   | 5,24 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                 |          |                              |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012)           | (0,39 %) | 0,22 %                       |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en CHF) | (0,06 %) | 2,07 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                 |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 19 février 2010)      | 1,18 %   | 2,71 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mars 2010)           | 0,69 %   | 1,70 %                       |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en EUR) | 1,15 %   | 3,69 % <sup>2</sup>          |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                                                               | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 4 juin 2019)                                                                                                                       | 4,57 % | 6,45 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 2 octobre 2023)                                                                                                                     | 4,15 % | 13,97 %                   |
| Catégorie E, distribution (lancement le 2 octobre 2023)                                                                                                                       | 4,11 % | 13,97 %                   |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 8 juin 2022)                                                                                                                        | 5,03 % | 11,66 %                   |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD)                  | 2,19 % | 3,02 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 4 juin 2019)                                                                                       | 5,47 % | 4,75 %                    |
| Investisseurs en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 26 mai 2026)                                                                                      | —      | 2,60 %                    |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2022)                                                                                      | 5,04 % | 6,29 %                    |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), distribution (lancement le 3 février 2026)                                                                                       | —      | 2,36 %                    |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en EUR) / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR) | 3,07 % | 1,87 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en GBP (partiellement couverte), distribution (lancement le 29 mars 2022)                                                                                        | 5,30 % | 8,12 %                    |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en GBP) / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP) | 2,83 % | 5,07 %                    |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                   | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                |        |                              |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008)                       | 4,22 % | 2,49 %                       |
| Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)                   | 1,20 % | 1,95 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                |        |                              |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2010) | 7,55 % | 3,67 %                       |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009)   | 7,08 % | 3,04 %                       |
| Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR)            | 3,96 % | 3,04 % <sup>2</sup>          |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                         | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                      |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2021)                               | 0,88 %   | 2,67 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2021)                                 | 0,81 %   | 2,64 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 29 avril 2021)                                | 0,37 %   | 1,74 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 29 avril 2021)                                  | 0,40 %   | 1,74 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 9 août 2024)                                  | 1,18 %   | 6,08 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index                                                   | 0,62 %   | 0,30 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 novembre 2021)            | 0,79 %   | 1,89 %                       |
| Catégorie R en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)                | 0,69 %   | 1,56 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)                                  | 0,68 %   | (0,69 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021)             | (0,10 %) | 0,76 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 21 mai 2021)                 | (0,15 %) | 0,75 %                       |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 décembre 2024)       | (0,29 %) | 2,94 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 juin 2021)               | (0,50 %) | (0,22 %)                     |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)                | (0,50 %) | (0,13 %)                     |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)                                  | (0,26 %) | (1,68 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)               | 0,79 %   | 2,18 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)                                  | 0,62 %   | (0,27 %)                     |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> mars 2023) | 0,86 %   | 5,03 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK)                                  | 0,68 %   | 3,59 %                       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 29 octobre 2021)           | (0,23 %) | 0,75 %                       |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2022)            | (0,49 %) | 1,85 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SEK)                                  | (0,40 %) | (2,06 %)²                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)               | (0,40 %) | 1,27 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)                                  | (0,68 %) | (1,17 %)                     |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                            | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                         |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998)               | 1,22 % | 3,37 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 7 janvier 2003)                   | 1,20 % | 3,07 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 8 mai 2002)                    | 1,02 % | 2,97 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                    | 0,78 % | 1,80 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005)                   | 0,72 % | 1,62 %                       |
| Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index                              | 1,30 % | 3,12 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                         |        |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2006) | 0,03 % | 1,67 %                       |
| Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index (couvert en CHF)             | 0,10 % | 1,59 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                           | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                        |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2008)               | 1,02 % | 2,89 %                       |
| Institutions, distribution II (lancement le 1 <sup>er</sup> octobre 2013) | 1,01 % | 1,90 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mai 2010)                    | 0,63 % | 1,58 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 7 juin 2019)                 | 1,09 % | 0,31 %                       |
| H Institutions, distribution II (lancement le 7 juin 2019)                | 1,06 % | 0,30 %                       |
| Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index                              | 1,40 % | 2,69 % <sup>2</sup>          |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                             |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2011)    | 1,24 % | 3,58 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 28 février 2011)      | 1,21 % | 3,58 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 décembre 2019)  | 1,02 % | 1,30 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 29 mai 2012)         | 1,10 % | 3,23 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 22 janvier 2024) | 0,90 % | 4,91 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2011)     | 0,74 % | 2,65 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2011)       | 0,68 % | 2,64 %                       |
| G Institutions, distribution (lancement le 5 janvier 2026)     | —      | 1,10 %                       |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)   | 0,53 % | 1,07 %                       |
| Catégorie T, distribution (lancement le 30 septembre 2014)     | 0,63 % | 1,08 %                       |
| Indice Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index           | 1,02 % | 1,97 % <sup>2</sup>          |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

| Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026 <sup>1</sup>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |        |                           | Objectif d'investissement et présentation de la stratégie                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 6 mois | Lancement de la catégorie | <p>Le Fonds Euro Long Average Duration Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro. Dans des conditions normales de marché, les deux tiers au moins de la duration du Fonds seront dérivés de l'exposition à des Instruments à revenu fixe émis par un gouvernement ou liés à celui-ci, libellés en euro.</p> |  |
| Catégories libellées en EUR                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |
| Institutions, capitalisation (lancement le 21 avril 2006)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 2,51 % | 3,18 %                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 3 novembre 2023)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2,05 % | (0,19 %)                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |
| Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index <sup>3</sup>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 2,52 % | 2,19 % <sup>2</sup>       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |
| <sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |        |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |
| <sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |
| <sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Euro Long Average Duration Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 mars 2011 : Indice Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index ; du 31 mars 2011 au 30 janvier 2012 : Indice Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index ; à partir du 31 janvier 2012 : Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index. |        |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |

| Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026 <sup>1</sup>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |  |  | Objectif d'investissement et présentation de la stratégie                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                           |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |  |  | 6 mois                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | Lancement de la catégorie |
| Catégories libellées en EUR                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2006)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |  |  | 0,91 %                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 1,43 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 11 juin 2024)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |  |  | 0,77 %                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 2,55 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |  | 0,53 %                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 0,67 %                    |
| Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index <sup>3</sup>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |  |  | 0,98 %                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 1,06 % <sup>2</sup>       |
| <div><div><sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.</div><div><sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.</div><div><sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Euro Short-Term Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2021 : Indice Euribor Index à 1 mois ; du 1<sup>er</sup> juillet 2021 au 31 août 2023 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ; à partir du 1<sup>er</sup> septembre 2023 : Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index.</div></div> |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |  |  | <p>Le Fonds Euro Short-Term Fund vise à optimiser les revenus courants tout en préservant le capital et la liquidité journalière. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro et assortis d'échéances diverses, sachant que la duration moyenne du portefeuille n'est pas censée dépasser un an et demi. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.</p> |                           |

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                       | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                    |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020)                                           | 1,90 % | 4,04 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 décembre 2022)                                           | 1,50 % | 7,36 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 17 avril 2023)                                                | 1,45 % | 7,16 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020)                                            | 2,22 % | 4,61 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index                     | 1,80 % | 3,17 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                    |        |                              |
| Institutions en USD (couverte), distribution (lancement le 15 mai 2026)                               | —      | 1,61 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index<br>(couvert en USD) | —      | 1,48 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                              | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                           |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 5 juillet 2011)   | 0,87 % | 1,63 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mars 2013)      | 0,56 % | 0,51 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020) | 0,82 % | 1,50 %                       |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>       | 0,99 % | 1,43 % <sup>2</sup>          |

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                      | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                   |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 9 juin 2009)                                                              | (0,19 %) | 2,75 %                       |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres)                                   | 0,51 %   | 2,13 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                                                   |          |                              |
| Institutions en CHF (partiellement couverte), distribution (lancement le 2 août 2011)                                | 0,03 %   | 1,23 %                       |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en CHF)<br>(clôture de la Bourse de Londres) | 0,64 %   | 0,58 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                   |          |                              |
| Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 24 mai 2010)                              | 1,10 %   | 2,41 %                       |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 6 mai 2010)                                | 0,56 %   | 1,40 %                       |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en EUR)<br>(clôture de la Bourse de Londres) | 1,75 %   | 1,83 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                                                   |          |                              |
| Institutions en NOK (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2012)                              | 0,45 %   | 3,74 %                       |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en NOK)<br>(clôture de la Bourse de Londres) | 1,14 %   | 3,14 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                                | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                             |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 1998)                                       | 0,68 %   | 4,86 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2001)                                        | 0,71 %   | 4,56 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> mars 1999)                         | 0,52 %   | 4,36 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 23 janvier 2001)                                     | 0,53 %   | 4,21 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 14 juin 2004)                                    | 0,45 %   | 3,90 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                        | 0,25 %   | 3,40 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)                                       | 0,26 %   | 3,37 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)                                  | 0,63 %   | 4,26 %                       |
| H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)                                    | 0,69 %   | 1,57 %                       |
| M Détail, distribution II (lancement le 26 avril 2017)                                         | 0,18 %   | 1,82 %                       |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)                                     | 0,16 %   | 1,80 %                       |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)                                       | 0,14 %   | 1,80 %                       |
| Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)                                        | 0,74 %   | 1,44 %                       |
| Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)                                          | 0,79 %   | 1,44 %                       |
| Catégorie W, distribution II (lancement le 23 février 2023)                                    | 0,76 %   | 5,48 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) <sup>3</sup>                          | 1,15 %   | 4,11 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)</b>                            |          |                              |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 13 décembre 2002)  | (0,71 %) | 3,76 %                       |
| Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 23 mars 2006)        | (0,70 %) | 3,40 %                       |
| Catégorie E (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 19 mai 2010)        | (1,14 %) | 1,65 %                       |
| Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 19 mai 2010)          | (1,21 %) | 1,64 %                       |
| H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021) | (0,84 %) | (1,11 %)                     |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en USD) <sup>3</sup>                      | (0,21 %) | 2,89 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2024)                    | 0,73 %   | 4,72 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en AUD) <sup>3</sup>                          | 1,20 %   | 4,21 %                       |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018)                | (0,17 %) | 2,05 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CAD) <sup>3</sup>                          | 0,32 %   | 1,57 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2003)                       | (1,33 %) | 2,09 %                       |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 10 avril 2003)                      | (1,31 %) | 2,13 %                       |
| Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 juin 2011)                    | (1,50 %) | 1,14 %                       |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2018)                      | (1,75 %) | (1,31 %)                     |
| Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                      | (1,32 %) | (1,81 %)                     |
| Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                        | (1,33 %) | (1,82 %)                     |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF) <sup>3</sup>                          | (0,87 %) | 1,27 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CNH</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en RMB (non couverte), distribution (lancement le 7 octobre 2024)                 | (2,09 %) | 2,16 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) <sup>3</sup>                          | (1,64 %) | 1,04 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2003)                     | (0,18 %) | 3,26 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 avril 2005)                      | (0,15 %) | 3,12 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 février 2005)                  | (0,38 %) | 2,76 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                      | (0,67 %) | 2,29 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016)                     | (0,64 %) | 0,13 %                       |
| G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2012)                       | (0,56 %) | 0,60 %                       |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                                                     | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                       | (0,34 %) | 1,23 %                    |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)                      | (0,79 %) | 0,04 %                    |
| Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                           | (0,20 %) | (0,31 %)                  |
| Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                             | (0,23 %) | (0,30 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR) <sup>3</sup>                               | 0,26 %   | 2,39 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)</b>                                 |          |                           |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 20 février 2013) | 1,98 %   | 2,51 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en EUR) <sup>3</sup>                           | 2,51 %   | 1,87 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                  |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2003)                         | 0,69 %   | 4,34 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> juin 2004)               | 0,68 %   | 4,35 %                    |
| Investisseurs en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 14 avril 2005)                        | 0,53 %   | 3,75 %                    |
| Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                           | 0,76 %   | 1,08 %                    |
| Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                             | 0,70 %   | 1,07 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP) <sup>3</sup>                               | 1,14 %   | 3,52 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change)</b>                                 |          |                           |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 9 mars 2018)     | 0,63 %   | 1,40 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP) <sup>3</sup>                           | 1,13 %   | 0,84 %                    |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                                                  |          |                           |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 26 avril 2017)                        | 1,06 %   | 1,90 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) libellé en HKD <sup>3</sup>                | 1,91 %   | 2,29 %                    |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                                  |          |                           |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2005)                          | 0,70 %   | 4,28 %                    |
| Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 26 juillet 2006)                      | 0,52 %   | 4,20 %                    |
| Catégorie W en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 13 avril 2021)                          | 0,74 %   | 0,78 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK) <sup>3</sup>                               | 1,20 %   | 3,41 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en NZD</b>                                                                  |          |                           |
| Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> novembre 2004)           | (0,16 %) | 5,88 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD) <sup>3</sup>                               | 0,40 %   | 4,99 %                    |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                                  |          |                           |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 novembre 2004)                       | (0,36 %) | 3,37 %                    |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2021)                     | (0,61 %) | (1,03 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK) <sup>3</sup>                               | 0,11 %   | 2,44 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                  |          |                           |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 août 2009)                           | (0,62 %) | 3,98 %                    |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 février 2023)                          | (0,96 %) | 2,36 %                    |
| Catégorie W en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 février 2023)                       | (0,60 %) | 3,38 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SGD) <sup>3</sup>                               | (0,16 %) | 2,61 % <sup>2</sup>       |

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

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

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                               | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                            |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)                                   | 0,63 %   | 2,54 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 3 avril 2020)                                        | 0,69 %   | 1,90 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 novembre 2018)                                  | 0,50 %   | 2,36 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019)                                          | 0,29 %   | 1,50 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)                                      | 1,15 %   | 2,22 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 21 janvier 2025)                 | 0,66 %   | 4,75 %                    |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)                    | 1,02 %   | 2,49 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en AUD)                                      | 1,20 %   | 1,62 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)                 | (1,36 %) | (0,58 %)                  |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> septembre 2022)   | (1,83 %) | (0,93 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF)                                      | (0,87 %) | (0,95 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)                 | (0,28 %) | 0,53 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)                   | (0,20 %) | 0,52 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2017)                   | (0,62 %) | (0,35 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR)                                      | 0,26 %   | 0,19 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2020)                     | 0,66 %   | 1,12 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)                   | 0,61 %   | 1,76 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP)                                      | 1,14 %   | 1,42 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change)</b>                           |          |                           |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 août 2022) | 0,75 %   | 0,08 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP)                                  | 1,13 %   | (0,68 %)                  |
| <b>Catégories libellées en GBP (non couvertes)</b>                                            |          |                           |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020)              | 2,07 %   | 0,73 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) libellé en GBP                       | 2,50 %   | 0,67 %                    |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)                 | 0,68 %   | 1,75 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK)                                      | 1,20 %   | 1,46 %                    |
| <b>Catégories libellées en NZD</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 5 avril 2017)                      | (0,08 %) | 2,13 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD)                                      | 0,40 %   | 1,85 %                    |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                            |          |                           |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 20 mai 2021)                     | (0,37 %) | (0,63 %)                  |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 mai 2023)                  | (0,63 %) | 2,44 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK)                                      | 0,11 %   | (0,86 %) <sup>2</sup>     |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                             |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 mars 2003)                                       | 0,92 %   | 4,42 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 9 novembre 2005)                                      | 0,90 %   | 4,48 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 février 2006)                                   | 0,75 %   | 4,07 %                    |
| Administrations, capitalisation (lancement le 14 septembre 2004)                               | 0,70 %   | 4,03 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008)                                         | 0,48 %   | 3,60 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)                                 | 0,83 %   | 2,69 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 octobre 2019)                                     | 1,19 %   | 2,62 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) <sup>3</sup>                   | 1,57 %   | 3,51 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)</b>                            |          |                           |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 18 juillet 2025)   | (1,58 %) | (0,20 %)                  |
| Catégorie E (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 24 mars 2026)       | —        | 1,00 %                    |
| Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 octobre 2016)       | (1,99 %) | (0,78 %)                  |
| H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 22 octobre 2025) | (1,70 %) | (1,70 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (non couvert en USD) <sup>3</sup>               | (0,90 %) | (0,66 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                             |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2006)                     | 0,05 %   | 3,50 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en EUR) <sup>3</sup>                   | 0,68 %   | 2,41 %                    |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                           | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                        |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 10 juin 2026)                                  | —      | 1,00 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 10 juin 2026)                                   | —      | 1,00 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 10 juin 2026)                                   | —      | 1,10 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index                                                   | —      | 0,84 %                       |
| <b>Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)</b>                       |        |                              |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 11 juin 2026) | —      | 0,10 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en USD)                              | —      | 0,09 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                        |        |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 11 juin 2026)                | —      | 0,60 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF)                                  | —      | 0,33 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                        |        |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 juin 2026)                | —      | 0,90 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 juin 2026)                 | —      | 0,90 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR)                                  | —      | 0,76 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                        |        |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 10 juin 2026)                | —      | 1,10 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 10 juin 2026)                  | —      | 1,10 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP)                                  | —      | 0,84 %                       |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                        |        |                              |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 12 juin 2026)                | —      | 0,59 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK)                                  | —      | 0,49 %                       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                        |        |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 12 juin 2026)                | —      | 0,47 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK)                                  | —      | 0,37 %                       |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                        |        |                              |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 11 juin 2026)                | —      | 0,60 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SGD)                                  | —      | 0,39 %                       |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Bond Opportunities Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit dans des circonstances normales au moins 80 % de son actif dans un portefeuille diversifié d'instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses. La durée moyenne du Fonds varie normalement entre 2 et 8 ans.

Le Fonds a été lancé le 10 juin 2026.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                     | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                  |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)                                                            | 1,52 %   | 6,09 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005)                                                          | 1,50 %   | 6,11 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 22 juin 2016)                                                           | 1,32 %   | 4,85 %                    |
| Administrations, capitalisation (lancement le 27 juin 2008)                                                         | 1,28 %   | 5,65 %                    |
| Administrations, distribution (lancement le 11 décembre 2015)                                                       | 1,31 %   | 5,06 %                    |
| BM Détail, décumulation (lancement le 25 août 2025)                                                                 | 0,54 %   | 2,72 %                    |
| BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)                                                             | 0,49 %   | 4,51 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)                                                        | 1,05 %   | 5,09 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)                                                            | 1,11 %   | 5,15 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008)                                                          | 1,44 %   | 6,10 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 22 mars 2013)                                                            | 1,43 %   | 4,70 %                    |
| M Détail, décumulation (lancement le 25 août 2025)                                                                  | 1,05 %   | 3,55 %                    |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)                                                              | 1,07 %   | 4,72 %                    |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)                                                           | 1,12 %   | 3,91 %                    |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                                                         | 1,40 %   | 4,78 %                    |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)                                                          | 0,86 %   | 3,65 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD <sup>3</sup> | 2,26 %   | 6,44 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                                                  |          |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 février 2010)                                       | (0,54 %) | 3,77 %                    |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012)                                            | (0,57 %) | 2,67 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en CHF <sup>3</sup> | 0,09 %   | 4,10 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                  |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2008)                                            | 0,62 %   | 4,65 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)                                        | 0,60 %   | 4,83 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 janvier 2011)                                       | 0,46 %   | 3,65 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                           | 0,15 %   | 3,82 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2016)                                            | 0,18 %   | 2,20 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en EUR <sup>3</sup> | 1,31 %   | 5,01 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                                                  |          |                           |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2025)                                  | 3,83 %   | 5,60 %                    |
| Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 15 septembre 2025)                                    | 3,90 %   | 5,63 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD <sup>3</sup> | 5,05 %   | 6,80 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                  |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012)                                           | 1,46 %   | 4,82 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)                                        | 1,53 %   | 5,70 %                    |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 juin 2009)                                             | 1,00 %   | 5,47 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en GBP <sup>3</sup> | 2,20 %   | 5,93 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                                  |          |                           |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 25 avril 2016)                                            | (0,12 %) | 3,38 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en SGD <sup>3</sup> | 0,88 %   | 4,68 %                    |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                                | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                             |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 17 juin 2024)                                       | 1,15 %   | 6,79 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 17 juin 2024)                                          | 0,69 %   | 5,84 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 17 juin 2024)                                        | 1,49 %   | 7,43 %                       |
| Indice ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index                  | 2,16 %   | 7,81 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 juin 2024)                     | 0,18 %   | 4,75 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 juin 2024)                        | (0,22 %) | 3,82 %                       |
| Indice ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (couvert en EUR) | 1,21 %   | 5,71 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 17 juin 2024)                     | 1,06 %   | 6,65 %                       |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 17 juin 2024)                        | 0,64 %   | 5,67 %                       |
| Indice ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (couvert en GBP) | 2,10 %   | 7,63 %                       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 5 juillet 2024)                   | 0,05 %   | 4,37 %                       |
| Indice ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (couvert en SEK) | 1,03 %   | 5,29 %                       |

Le Fonds Global High Yield Bond ESG Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins les deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'instruments à revenu fixe à rendement élevé (tels que définis dans le Prospectus) libellés dans les principales devises mondiales et notés en dessous de Baa par Moody's ou de BBB par S&P, ou une note équivalente par Fitch. Le Fonds cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales de diverses manières dans des conditions de marché normales, comme indiqué dans le Supplément du Fonds, et cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables.

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                                | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                             |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 18 avril 2008)                                      | 1,58 %   | 4,49 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 23 juillet 2003)                                      | 1,57 %   | 4,61 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 15 février 2005)                                   | 1,38 %   | 4,04 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 22 janvier 2009)                                     | 1,44 %   | 4,65 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2009)                                 | 1,33 %   | 4,49 %                       |
| Administrations, distribution (lancement le 21 janvier 2009)                                   | 1,25 %   | 4,49 %                       |
| BE Détail, capitalisation (lancement le 25 août 2025)                                          | 0,59 %   | 2,50 %                       |
| BM Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023)                                        | 0,55 %   | 3,49 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 10 décembre 2008)                                    | 1,12 %   | 4,23 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008)                                         | 1,09 %   | 3,51 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008)                                     | 1,48 %   | 4,44 %                       |
| H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)                                        | 1,40 %   | 2,56 %                       |
| M Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023)                                         | 1,09 %   | 4,49 %                       |
| M Détail, distribution (lancement le 28 septembre 2012)                                        | 1,13 %   | 2,27 %                       |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)                                      | 1,22 %   | 2,46 %                       |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                                    | 1,39 %   | 2,82 %                       |
| Catégorie R, distribution (lancement le 30 novembre 2012)                                      | 1,36 %   | 2,82 %                       |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)                                     | 0,91 %   | 1,73 %                       |
| Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)                                        | 1,60 %   | 1,27 %                       |
| Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)                                          | 1,59 %   | 1,28 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)                                | 1,34 %   | 3,92 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)</b>                            |          |                              |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 2 août 2013)       | 0,36 %   | 2,41 %                       |
| Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 6 septembre 2016)    | 0,38 %   | 1,94 %                       |
| H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021) | 0,40 %   | (0,02 %)                     |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en USD)                            | 0,13 %   | 2,20 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2020)                       | 1,50 %   | 1,77 %                       |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)                      | 1,30 %   | 1,57 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en AUD)                                | 1,36 %   | 2,01 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 décembre 2009)                 | (0,50 %) | 1,89 %                       |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 6 février 2015)                     | (0,56 %) | (0,05 %)                     |
| Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 mai 2011)                     | (0,69 %) | 0,90 %                       |
| Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)                   | (0,65 %) | 2,48 %                       |
| Administrations en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2013)               | (0,79 %) | 0,02 %                       |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 6 mars 2012)                       | (0,97 %) | 0,15 %                       |
| Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                      | (0,45 %) | (2,02 %)                     |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF)                                | (0,71 %) | 2,09 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CZK</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en CZK (couverte), distribution (lancement le 19 mai 2015)                        | 1,27 %   | 2,45 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CZK)                                | 1,02 %   | 2,40 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                             |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2003)                | 0,67 %   | 3,51 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 septembre 2008)                  | 0,73 %   | 3,46 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2006)                      | 0,50 %   | 3,01 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)                   | 0,52 %   | 3,39 %                       |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                                                   | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 février 2009)                  | 0,41 %   | 3,14 %                       |
| Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2009)                    | 0,39 %   | 3,14 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                         | 0,18 %   | 2,41 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 septembre 2010)                       | 0,24 %   | 1,46 %                       |
| Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)                       | 0,57 %   | 1,17 %                       |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)                    | 0,00 %   | (0,08 %)                     |
| Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                         | 0,73 %   | (0,52 %)                     |
| Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                           | 0,67 %   | (0,53 %)                     |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR)                                   | 0,44 %   | 2,79 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)</b>                               |          |                              |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 16 août 2012)  | 3,07 %   | 2,86 %                       |
| Catégorie E en EUR (exposition au risque de change), distribution (lancement le 12 décembre 2018) | 2,59 %   | 1,39 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en EUR)                               | 2,86 %   | 2,81 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 2 septembre 2005)                    | 1,50 %   | 4,09 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 11 juillet 2008)                       | 1,57 %   | 4,26 %                       |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)                      | 1,34 %   | 4,21 %                       |
| Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 janvier 2009)                    | 1,26 %   | 4,03 %                       |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mars 2009)                           | 1,01 %   | 3,70 %                       |
| Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)                       | 1,34 %   | 2,23 %                       |
| Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)                         | 1,55 %   | 0,83 %                       |
| Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)                           | 1,50 %   | 0,83 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP)                                   | 1,32 %   | 3,50 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                                                |          |                              |
| Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 mars 2024)                      | 2,35 %   | 5,90 %                       |
| Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)                | 1,99 %   | 2,05 %                       |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)                       | 1,87 %   | 1,65 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) libellé en HKD                    | 2,11 %   | 2,69 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                                |          |                              |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 18 janvier 2012)                     | 1,57 %   | 3,39 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en NOK)                                   | 1,37 %   | 3,10 %                       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                                |          |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 4 décembre 2009)                     | 0,42 %   | 3,10 %                       |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 13 décembre 2012)                 | 0,26 %   | 1,06 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK)                                   | 0,27 %   | 2,64 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)                       | 0,24 %   | 2,30 %                       |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)                          | 0,12 %   | 1,32 %                       |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 22 septembre 2017)                  | (0,03 %) | 0,88 %                       |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 18 juillet 2012)                        | (0,21 %) | 1,75 %                       |
| Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 13 octobre 2020)                        | 0,34 %   | (0,05 %)                     |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SGD)                                   | 0,03 %   | 2,46 % <sup>2</sup>          |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                      | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                   |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)                        | 1,27 %   | 3,20 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 19 juillet 2019)                            | 1,35 %   | 2,22 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mai 2021)                              | 1,07 %   | 0,74 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2020)                           | 0,78 %   | 0,50 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2020)                             | 0,86 %   | 0,51 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)                      | 1,34 %   | 2,94 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                   |          |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)      | (0,80 %) | (0,12 %)                  |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)          | (0,77 %) | (1,83 %)                  |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)         | (1,29 %) | (2,71 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF)                      | (0,71 %) | (0,41 %) <sup>2</sup>     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                   |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)      | 0,28 %   | 1,15 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)          | 0,31 %   | (0,39 %)                  |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 janvier 2023)          | 0,18 %   | 3,38 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)         | (0,11 %) | (1,29 %)                  |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)           | (0,16 %) | (1,31 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR)                      | 0,44 %   | 0,87 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                   |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)      | 1,18 %   | 2,42 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> mai 2019) | 1,17 %   | 1,95 %                    |
| Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)         | 0,81 %   | (0,03 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP)                      | 1,32 %   | 2,14 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                   |          |                           |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 3 novembre 2022)        | 0,14 %   | 4,65 %                    |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 27 novembre 2019)    | (0,09 %) | (0,40 %)                  |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK)                      | 0,27 %   | (0,12 %) <sup>2</sup>     |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                            | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                         |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 18 février 2014)                                | 1,72 %   | 2,89 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 16 avril 2026)                                    | —        | 0,42 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 5 octobre 2016)                                | 1,49 %   | 3,21 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 18 février 2014)                                 | 1,19 %   | 1,97 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index<br>(couvert en USD) | 1,92 %   | 2,71 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)              | (0,39 %) | 0,22 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index<br>(couvert en CHF) | (0,17 %) | (0,03 %)                     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)              | 0,78 %   | 1,18 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 janvier 2017)                | 0,78 %   | 1,56 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)               | 0,29 %   | 0,27 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index<br>(couvert en EUR) | 1,00 %   | 0,99 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017)              | 1,64 %   | 2,82 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014)                | 1,61 %   | 2,30 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index<br>(couvert en GBP) | 1,89 %   | 2,11 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 22 septembre 2022)            | 0,44 %   | 3,37 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index<br>(couvert en SGD) | 0,57 %   | 2,58 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                             | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                          |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)                                               | 1,57 %   | 4,03 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005)                                                  | 1,58 %   | 3,72 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mars 2004)                                                    | 1,39 %   | 3,52 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 24 février 2009)                                                  | 1,37 %   | 3,86 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 17 décembre 2004)                                             | 1,33 %   | 3,28 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                                     | 1,14 %   | 2,91 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)                                                    | 1,14 %   | 2,83 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 21 mai 2004)                                                   | 1,50 %   | 3,83 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)                              | 1,69 %   | 3,73 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)</b>                                         |          |                              |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> septembre 2017) | 0,36 %   | 1,27 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (non couvert en USD)                          | 0,42 %   | 0,81 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                                          |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2008)                                   | (0,46) % | 1,40 %                       |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)                                 | (0,47) % | (0,14) %                     |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en CHF)                              | (0,48) % | 0,98 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                          |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)                             | 0,63 %   | 2,91 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)                                | 0,62 %   | 2,50 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 avril 2004)                                 | 0,51 %   | 2,45 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                   | 0,25 %   | 1,73 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en EUR)                              | 0,75 %   | 2,57 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                          |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004)                                | 1,53 %   | 3,96 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 avril 2005)                                   | 1,61 %   | 3,58 %                       |
| Catégorie R en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                               | 1,39 %   | 1,57 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en GBP)                              | 1,67 %   | 3,68 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                          |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 29 février 2008)                               | 0,24 %   | 2,86 %                       |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en SGD)                              | 0,31 %   | 2,58 %                       |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

|                                                                                          | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                       |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                             | 1,40 %   | 5,35 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 30 novembre 2012)                               | 1,37 %   | 5,35 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 20 janvier 2015)                             | 1,24 %   | 4,36 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 18 avril 2013)                                 | 1,17 %   | 4,36 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 13 février 2017)                           | 1,20 %   | 3,94 %                       |
| Administrations, distribution (lancement le 30 novembre 2012)                            | 1,10 %   | 4,83 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                              | 0,96 %   | 4,41 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 30 novembre 2012)                                | 1,03 %   | 4,41 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 25 mai 2018)                                | 1,36 %   | 4,35 %                       |
| H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)                                  | 1,34 %   | 4,35 %                       |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019)                               | 1,33 %   | 4,00 %                       |
| Catégorie R, distribution (lancement le 30 avril 2015)                                   | 1,35 %   | 4,34 %                       |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)                               | 0,76 %   | 3,26 %                       |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)                                 | 0,88 %   | 3,27 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                              | 1,68 %   | 5,92 %                       |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 28 février 2025)                                 | 1,73 %   | 7,15 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index                                                    | 0,62 %   | 1,83 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                       |          |                              |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 17 janvier 2018)            | 1,39 %   | 3,31 %                       |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 7 septembre 2023)             | 1,35 %   | 7,03 %                       |
| Investisseurs en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 9 juin 2026)               | —        | 1,00 %                       |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)                 | 1,21 %   | 3,22 %                       |
| Administrations en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 28 août 2024)            | 1,10 %   | 5,63 %                       |
| Administrations en AUD (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016)               | 1,16 %   | 3,53 %                       |
| Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 16 février 2017)               | 0,92 %   | 2,75 %                       |
| H Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2026)            | —        | 0,62 %                       |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 octobre 2015)            | 1,69 %   | 4,77 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)                                   | 0,68 %   | 1,41 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en BRL</b>                                                       |          |                              |
| Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 3 février 2016)             | 11,81 %  | 7,98 %                       |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en BRL)                                 | 5,39 %   | 8,37 %                       |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                                       |          |                              |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> avril 2016) | 0,53 %   | 4,08 %                       |
| Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 7 septembre 2018)             | 0,50 %   | 3,82 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD)                                   | (0,20 %) | 1,01 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                       |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 décembre 2014)           | (0,65 %) | 1,77 %                       |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)              | (0,69 %) | 1,61 %                       |
| Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> avril 2026)  | —        | 0,80 %                       |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)             | (1,13 %) | 1,06 %                       |
| Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014)               | (0,95 %) | 1,07 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)                                   | (1,39 %) | (0,75 %) <sup>2</sup>        |
| <b>Catégories libellées en CNH</b>                                                       |          |                              |
| Institutions en RMB (couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2023)             | 0,22 %   | 5,00 %                       |
| Investisseurs en RMB (couverte), capitalisation (lancement le 3 janvier 2018)            | 0,04 %   | 3,50 %                       |
| Catégorie E en RMB (couverte), distribution (lancement le 22 mai 2013)                   | (0,23 %) | 4,44 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CNH)                                   | (0,58 %) | 2,85 % <sup>2</sup>          |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                                             | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                          |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)              | 0,49 %   | 3,66 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)                | 0,49 %   | 3,66 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014)              | 0,50 %   | 2,71 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2015)                | 0,39 %   | 2,22 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2015)                     | 0,36 %   | 2,27 %                       |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution A (lancement le 16 décembre 2015)             | 0,38 %   | 2,43 %                       |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 août 2015)               | 0,24 %   | 2,18 %                       |
| Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016)                  | 0,27 %   | 2,08 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)               | 0,07 %   | 2,74 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)                 | 0,06 %   | 2,74 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 31 août 2018)                  | 0,08 %   | 1,62 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II Q (lancement le 30 septembre 2019)           | 0,08 %   | 1,44 %                       |
| G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 août 2017)                        | 0,00 %   | 1,11 %                       |
| Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 mai 2025)                    | 0,38 %   | 6,20 %                       |
| Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016)                  | 0,39 %   | 2,55 %                       |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)              | (0,09 %) | 1,38 %                       |
| Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)                | (0,22 %) | 1,38 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)                                      | (0,26 %) | 0,21 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                          |          |                              |
| Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 4 décembre 2025)              | 3,69 %   | 3,38 %                       |
| Catégorie R en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 21 mai 2025)                | 4,02 %   | 7,72 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en EUR)                                  | 3,36 %   | 5,21 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                          |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2019)                | 1,31 %   | 3,73 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013)                 | 1,35 %   | 4,12 %                       |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020)                | 1,15 %   | 3,05 %                       |
| Administrations en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 26 mai 2026)                | —        | 0,90 %                       |
| Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 2 septembre 2016)             | 1,09 %   | 3,12 %                       |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 mars 2017)                     | 0,91 %   | 2,55 %                       |
| Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)                 | 1,23 %   | 4,43 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)                                      | 0,62 %   | 1,28 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                                          |          |                              |
| Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)             | 2,14 %   | 4,84 %                       |
| Investisseurs en HKD (non couverte), distribution (lancement le 31 octobre 2023)            | 2,03 %   | 8,91 %                       |
| Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 26 avril 2017)            | 1,98 %   | 3,92 %                       |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 février 2013)               | 1,69 %   | 3,95 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)                                  | 1,38 %   | 2,00 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en HUF</b>                                                          |          |                              |
| Catégorie E en HUF (couverte), capitalisation (lancement le 18 décembre 2024)               | 1,88 %   | 8,87 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en HUF)                                      | 1,68 %   | 7,09 %                       |
| <b>Catégories libellées en JPY</b>                                                          |          |                              |
| Institutions en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 10 mars 2023)                  | (0,18 %) | 2,44 %                       |
| Institutions en JPY (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2024)                 | (0,10 %) | 2,10 %                       |
| Investisseurs en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 2 juin 2023)                  | (0,28 %) | 2,16 %                       |
| Catégorie E en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> septembre 2017) | (0,69 %) | 0,06 %                       |
| Catégorie E en JPY (couverte), distribution (lancement le 21 décembre 2022)                 | (0,59 %) | 1,07 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en JPY)                                      | (0,92 %) | (1,62 %) <sup>2</sup>        |



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup> (suite)

|                                                                                            | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2017)                | 1,38 %   | 3,30 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK)                                     | 0,68 %   | 0,91 %                       |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2026)              | —        | 0,29 %                       |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> août 2024) | 0,06 %   | 3,93 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SEK)                                     | (0,40 %) | 1,33 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                         |          |                              |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 juillet 2020)              | 0,08 %   | 3,33 %                       |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2015)               | 0,09 %   | 3,97 %                       |
| Investisseurs en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2020)              | (0,09 %) | 2,40 %                       |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)                   | (0,01 %) | 3,06 %                       |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)            | (0,13 %) | 4,18 %                       |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 19 février 2013)                 | (0,32 %) | 3,20 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)                                     | (0,68 %) | 1,23 % <sup>2</sup>          |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                             |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2021)                    | 1,54 %   | 3,26 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 29 janvier 2021)                       | 1,02 %   | 2,34 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index                                          | 0,62 %   | (0,09 %)                     |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                             |          |                              |
| Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021)     | 0,99 %   | 1,43 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)                         | 0,68 %   | (1,04 %)                     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                             |          |                              |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021)     | 0,21 %   | 0,45 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)                         | (0,26 %) | (1,89 %)                     |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                             |          |                              |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021)     | 0,99 %   | 1,90 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)                         | 0,62 %   | (0,50 %)                     |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                             |          |                              |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021) | 1,96 %   | 2,56 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)                     | 1,38 %   | 0,12 %                       |
| <b>Catégories libellées en JPY</b>                                             |          |                              |
| Catégorie E en JPY (couverte), distribution (lancement le 15 novembre 2023)    | (0,54 %) | 2,10 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en JPY)                         | (0,92 %) | 0,67 %                       |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                       | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                    |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 5 décembre 2002)                           | 0,61 %   | 2,59 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 5 décembre 2002)                             | 0,64 %   | 2,58 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 mai 2004)                              | 0,42 %   | 2,29 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 3 juillet 2003)                             | 0,45 %   | 2,17 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 8 septembre 2004)                       | 0,37 %   | 2,10 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007)                          | 0,15 %   | 1,56 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)                              | 0,13 %   | 1,77 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 4 novembre 2009)                         | 0,52 %   | 1,87 %                       |
| H Institutions, distribution (lancement le 12 décembre 2018)                          | 0,50 %   | 2,18 %                       |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                           | 0,41 %   | 1,41 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index                            | 0,68 %   | 2,06 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                    |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2012)         | (0,19 %) | 0,43 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 24 juillet 2009)          | (0,60 %) | 0,06 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en EUR)           | (0,21 %) | 0,29 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                    |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017)         | 0,62 %   | 1,30 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> mars 2010) | 0,62 %   | 1,60 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en GBP)           | 0,68 %   | 1,11 % <sup>2</sup>          |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                             |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2014)                    | 1,02 %   | 2,69 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 22 juin 2021)                         | 1,10 %   | 2,51 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD)      | 1,28 %   | 2,71 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                             |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)  | 0,09 %   | 1,00 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)   | (0,39 %) | 0,08 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en EUR)      | 0,39 %   | 0,99 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                             |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)  | 0,94 %   | 2,10 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en GBP)      | 1,26 %   | 2,11 %                    |
| <b>Catégories libellées en NOK</b>                                             |          |                           |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 10 juillet 2017)  | 1,05 %   | 1,95 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en NOK)      | 1,33 %   | 2,13 %                    |
| <b>Catégories libellées en SEK</b>                                             |          |                           |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 25 août 2023)     | (0,05 %) | 3,89 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en SEK)      | 0,25 %   | 3,88 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                             |          |                           |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 19 décembre 2024) | (0,29 %) | 2,47 %                    |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en SGD)      | (0,02 %) | 2,56 %                    |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                            | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                         |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2018)                                    | 1,81 %   | 4,30 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 31 mai 2018)                                      | 1,90 %   | 4,30 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 29 septembre 2025)                             | 1,67 %   | 3,70 %                    |
| Investisseurs, distribution (lancement le 29 septembre 2025)                               | 1,69 %   | 3,71 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mai 2018)                                     | 1,32 %   | 3,39 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 14 septembre 2018)                                 | 1,26 %   | 3,44 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 3 septembre 2020)                             | 1,73 %   | 4,55 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 18 janvier 2022)                                | 1,68 %   | 4,89 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index                                            | 0,82 %   | 2,39 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 9 juin 2026)                  | —        | 0,70 %                    |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 août 2024)                   | 1,84 %   | 6,55 %                    |
| Investisseurs en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 9 juin 2026)                 | —        | 0,60 %                    |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 3 novembre 2025)               | 1,68 %   | 2,65 %                    |
| H Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2026)              | —        | 1,22 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en AUD)                           | 0,93 %   | 3,48 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 20 octobre 2023)              | (0,18 %) | 4,26 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en CHF)                           | (1,13 %) | 0,50 %                    |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)                  | 0,93 %   | 2,26 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 novembre 2021)               | 0,92 %   | 2,96 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2026)             | —        | 0,60 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 3 novembre 2025)               | 0,67 %   | 1,44 %                    |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 janvier 2024)           | 0,63 %   | 4,83 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)                   | 0,45 %   | 1,36 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018)                     | 0,37 %   | 1,35 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 20 janvier 2026)              | —        | 0,36 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en EUR)                           | (0,03 %) | 0,43 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)                  | 1,77 %   | 3,53 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018)                    | 1,85 %   | 3,54 %                    |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 3 novembre 2025)               | 1,57 %   | 2,65 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en GBP)                           | 0,83 %   | 1,75 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 1 <sup>er</sup> avril 2026) | —        | 1,79 %                    |
| Investisseurs en HKD (non couverte), distribution (lancement le 29 septembre 2025)         | 2,38 %   | 4,53 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index                                            | 1,58 %   | 2,84 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en RMB</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en RMB (couverte), distribution (lancement le 14 mai 2026)                    | —        | 0,50 %                    |
| Investisseurs en RMB (couverte), distribution (lancement le 14 mai 2026)                   | —        | 0,46 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en RMB)                           | —        | (0,03 %)                  |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                         |          |                           |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2020)              | 0,49 %   | 3,53 %                    |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2024)                   | 0,58 %   | 4,96 %                    |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 3 novembre 2025)               | 0,37 %   | 0,93 %                    |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 2 avril 2026)                    | —        | 0,74 %                    |
| H Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 10 juin 2026)                 | —        | 0,50 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en SGD)                           | (0,45 %) | 0,69 % <sup>2</sup>       |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                               | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                            |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)                   | 1,75 % | 3,23 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 7 mars 2019)                         | 1,83 % | 3,27 %                    |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                        | 1,85 % | 2,39 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                            |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 0,88 % | 1,27 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 octobre 2017)  | 0,59 % | 0,32 %                    |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>4</sup>                        | 0,98 % | 0,73 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                            |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 1,73 % | 2,49 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019)   | 1,75 % | 2,72 %                    |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>5</sup>                       | 1,89 % | 1,90 % <sup>2</sup>       |

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

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

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

| Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026 <sup>1</sup> |        |                           | Objectif d'investissement et présentation de la stratégie                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                   | 6 mois | Lancement de la catégorie | <p>Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund vise à optimiser la performance à long terme, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit dans des circonstances normales au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe d'échéances diverses. La duration moyenne du portefeuille de ce Fonds variera normalement de moins 1 an à plus 5 ans en fonction des prévisions en matière de taux d'intérêt du Conseiller en investissement. Le Fonds cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales de diverses manières dans des conditions de marché normales, comme indiqué dans le Supplément du Fonds, et cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables.</p> |
| Catégories libellées en USD                                                                       |        |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)                                       | 1,35 % | 4,78 %                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index                                                         | 1,85 % | 4,63 %                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                           | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                        |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 mai 2026)                   | —      | 1,00 %                       |
| Administrations, capitalisation (lancement le 17 juin 2026)               | —      | (0,90 %)                     |
| Indice FTSE 1 month T-Bill Index                                          | —      | 0,50 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                        |        |                              |
| Catégorie Z en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 19 mai 2026)  | —      | 1,60 %                       |
| Indice FTSE 1 month T-Bill Index (couvert en AUD)                         | —      | 0,52 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                        |        |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2026) | —      | 0,50 %                       |
| Indice FTSE 1 month T-Bill Index (couvert en CHF)                         | —      | (0,02 %)                     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                        |        |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2026) | —      | 0,80 %                       |
| Indice FTSE 1 month T-Bill Index (couvert en EUR)                         | —      | 0,29 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                        |        |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2026) | —      | 1,00 %                       |
| Indice FTSE 1 month T-Bill Index (couvert en GBP)                         | —      | 0,51 %                       |

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

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

## Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds MAARS Multi-Strategy Fund vise des rendements positifs ajustés au risque, tout en maintenant une corrélation limitée avec les marchés traditionnels, conformément aux principes d'une gestion prudente des investissements. Le Fonds est géré activement et cherche à réaliser son objectif d'investissement par le biais d'une allocation diversifiée aux stratégies d'investissement systématiques et discrétionnaires exclusives du Conseiller en investissement (telles que définies dans le Prospectus) en utilisant des positions longues et courtes au sein des catégories d'actifs suivantes : actions, revenu fixe, devises et matières premières. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Le Fonds a été lancé le 12 mai 2026.



Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                | 6 mois  | Lancement<br>de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------|---------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                             |         |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)                   | 16,25 % | 6,08 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 25 novembre 2014)                     | 16,30 % | 6,08 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 janvier 2025)                     | 15,72 % | 10,82 %                      |
| Catégorie E, distribution (lancement le 25 novembre 2014)                      | 15,71 % | 4,92 %                       |
| Indice Alerian MLP Index                                                       | 18,48 % | 4,59 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                             |         |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014) | 15,28 % | 4,01 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 novembre 2014)   | 15,24 % | 4,02 %                       |
| Indice Alerian MLP Index en EUR (couvert)                                      | 17,35 % | 2,81 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                             |         |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014) | 16,29 % | 4,60 %                       |
| Indice Alerian MLP Index en GBP (couvert)                                      | 18,33 % | 3,31 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                         | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                      |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)                             | 1,67 %   | 3,14 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 25 janvier 2017)                               | 1,72 %   | 3,16 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 12 mai 2017)                                | 1,44 %   | 2,64 %                       |
| Investisseurs, distribution (lancement le 25 janvier 2017)                              | 1,43 %   | 2,79 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)                              | 1,23 %   | 2,23 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 25 janvier 2017)                                | 1,15 %   | 2,23 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 14 mai 2020)                               | 1,57 %   | 3,38 %                       |
| H Institutions, distribution (lancement le 2 octobre 2023)                              | 1,62 %   | 7,11 %                       |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 14 juillet 2022)                              | 2,04 %   | 5,93 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                                  | 1,85 %   | 2,70 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1 <sup>er</sup> juin 2021) | 0,82 %   | 2,08 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CAD) <sup>3</sup>                 | 1,07 %   | 2,80 %                       |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)           | (0,30) % | 0,06 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CHF) <sup>3</sup>                 | (0,18) % | (0,39) %                     |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)           | 0,81 %   | 1,15 %                       |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017)             | 0,68 %   | 1,15 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)            | 0,29 %   | 0,24 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR) <sup>3</sup>                 | 0,97 %   | 0,73 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                      |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)           | 1,71 %   | 2,40 %                       |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017)             | 1,59 %   | 2,40 %                       |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP) <sup>3</sup>                 | 1,86 %   | 1,99 %                       |

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

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

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

## Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 5,04 % | 3,08 %                    |
| Administrations, distribution II (lancement le 22 mars 2022)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 4,78 % | 4,41 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 14 février 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 4,61 % | 1,95 %                    |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en USD) <sup>3</sup>                  | 4,44 % | 2,73 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |        |                           |
| Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2021)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 4,95 % | 3,79 %                    |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 4,53 % | 0,94 %                    |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), distribution (lancement le 16 avril 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 4,55 % | 0,94 %                    |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en EUR), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en EUR), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en EUR), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en EUR) <sup>3</sup> | 4,38 % | 1,88 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |        |                           |
| Institutions en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 30 mai 2014)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 5,27 % | 3,41 %                    |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en GBP), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en GBP), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en GBP), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en GBP), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en GBP) <sup>3</sup> | 4,70 % | 2,95 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |        |                           |
| Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 22 février 2022)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 3,93 % | 3,49 %                    |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en SGD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en SGD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en SGD), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en SGD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (couvert en SGD) <sup>3</sup>         | 3,43 % | 2,54 %                    |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund (anciennement Fonds Inflation Multi-Asset Fund) est mesurée comme suit : du lancement au 31 mars 2017 : 45 % de l'Indice Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (partiellement couvert en USD), 30 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Total Return Index ; du 1<sup>er</sup> avril 2017 au 12 avril 2022 : 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice Bloomberg Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (non couvert en USD), 10 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), 15 % de l'Indice Alerian MLP Total Return Index, 5 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return ; à partir du 13 avril 2022 : 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en USD).

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                              | 6 mois  | Lancement de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                           |         |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998)                                 | 10,23 % | 8,56 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 22 novembre 2001)                                   | 10,22 % | 9,82 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 janvier 1999)                                  | 10,05 % | 8,07 %                    |
| BE Détail, capitalisation (lancement le 28 avril 2022)                                       | 9,17 %  | 13,01 %                   |
| BM Détail, distribution II (lancement le 2 juillet 2025)                                     | 9,10 %  | 19,77 %                   |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)                                 | 9,74 %  | 10,16 %                   |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020)                                 | 10,14 % | 14,31 %                   |
| M Détail, distribution II (lancement le 10 janvier 2025)                                     | 9,79 %  | 19,18 %                   |
| Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes)                      | 10,01 % | 8,16 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                           |         |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2012)              | 9,06 %  | 12,51 %                   |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2017)                     | 8,59 %  | 10,72 %                   |
| Indice S&P 500 Index (couvert en EUR) (net de la retenue à la source sur les dividendes)     | 8,67 %  | 12,14 % <sup>2</sup>      |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                           |         |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 14 mai 2024)                | 13,16 % | 16,49 %                   |
| Indice S&P 500 Index (non couvert en EUR) (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 13,01 % | 16,31 %                   |

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

| Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026 <sup>1</sup> |         |                           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------|
|                                                                                                   | 6 mois  | Lancement de la catégorie |
| Catégories libellées en USD                                                                       |         |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 mars 2019)                                          | 9,64 %  | 16,00 %                   |
| Administrations, capitalisation (lancement le 9 juin 2026)                                        | —       | 1,90 %                    |
| Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes)                           | 10,01 % | 15,60 % <sup>2</sup>      |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                                                                                               | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 mars 2018)                                                                                                      | 5,20 % | 5,82 %                    |
| Institutions, distribution II (lancement le 28 août 2024)                                                                                                     | 5,17 % | 10,49 %                   |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)                                                                                                   | 4,68 % | 4,96 %                    |
| Catégorie E, distribution II (lancement le 16 décembre 2013)                                                                                                  | 4,67 % | 4,95 %                    |
| M Détail, distribution II (lancement le 28 août 2024)                                                                                                         | 4,69 % | 9,53 %                    |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index <sup>3</sup>                                           | 3,05 % | 4,30 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)                                                                                | 4,45 % | 4,38 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 août 2024)                                                                                   | 4,33 % | 8,26 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)                                                                                 | 4,02 % | 3,43 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 16 décembre 2013)                                                                                | 4,04 % | 3,43 %                    |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)                                                                                | 3,86 % | 2,55 %                    |
| Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)                                                                                  | 3,89 % | 2,56 %                    |
| Catégorie Z en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 juillet 2024)                                                                                  | 4,83 % | 9,65 %                    |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en EUR) <sup>3</sup>         | 2,46 % | 2,82 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 5 mars 2026)                                                                                   | —      | 3,72 %                    |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en EUR) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (non couvert en EUR) <sup>3</sup> | —      | 1,96 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 août 2024)                                                                                    | 5,34 % | 10,58 %                   |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 juillet 2022)                                                                                   | 5,36 % | 8,93 %                    |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en GBP) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en GBP) <sup>3</sup>    | 3,37 % | 4,28 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en ILS</b>                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en ILS (couverte), capitalisation (lancement le 28 août 2024)                                                                                    | 5,03 % | 9,92 %                    |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en ILS) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en ILS) <sup>3</sup>         | 3,11 % | 5,41 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                                                                                                            |        |                           |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 28 août 2024)                                                                                    | 4,05 % | 8,20 %                    |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 28 août 2024)                                                                                       | 3,56 % | 7,22 %                    |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en SGD) <sup>3</sup>         | 2,01 % | 3,50 %                    |

<sup>1</sup> Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.<sup>2</sup> La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds Strategic Income Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 26 juillet 2016 : 75 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate Index couvert en USD / 25 % de l'Indice MSCI All Country World Index ; du 27 juillet 2016 au 28 juillet 2022 : 75 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD / 25 % de l'Indice MSCI World Index ; à partir du 29 juillet 2022 : 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                  | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                               |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 1998)                      | 0,99 %   | 4,49 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 25 avril 2000)                          | 0,99 %   | 4,48 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 janvier 1999)                     | 0,83 %   | 3,96 %                    |
| Investisseurs, distribution (lancement le 23 octobre 2000)                       | 0,83 %   | 3,94 %                    |
| Administrations, capitalisation (lancement le 16 mai 2003)                       | 0,75 %   | 3,17 %                    |
| Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2022)                     | 0,71 %   | 3,34 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                          | 0,55 %   | 2,92 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005)                         | 0,51 %   | 2,84 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)                    | 0,93 %   | 3,76 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)                          | 0,91 %   | 2,25 %                    |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)                       | 0,35 %   | 1,06 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index                                            | 0,62 %   | 3,96 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en CAD</b>                                               |          |                           |
| Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 2 mai 2013)           | 0,13 %   | 1,61 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD)                           | (0,20 %) | 1,41 %                    |
| <b>Catégories libellées en CHF</b>                                               |          |                           |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 19 septembre 2012)   | (1,53 %) | (1,28 %)                  |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)                           | (1,39 %) | (0,70 %)                  |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                               |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2003)   | 0,09 %   | 2,64 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)     | 0,15 %   | 2,58 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2004)  | (0,05 %) | 2,18 %                    |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2009) | (0,17 %) | 1,09 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)        | (0,38 %) | 1,74 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mars 2012)           | (0,32 %) | (0,08 %)                  |
| Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)    | 0,00 %   | 0,20 %                    |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)   | (0,43 %) | (0,70 %)                  |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)                           | (0,26 %) | 2,07 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR (non couvertes)</b>                               |          |                           |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2002)   | 3,74 %   | 3,12 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en EUR)                       | 3,36 %   | 2,64 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                               |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 26 mars 2010)       | 0,97 %   | 2,35 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)     | 0,91 %   | 3,53 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)                           | 0,62 %   | 2,97 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en HKD</b>                                               |          |                           |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 20 février 2013)      | 1,25 %   | 1,30 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)                       | 1,38 %   | 2,01 %                    |
| <b>Catégories libellées en SGD</b>                                               |          |                           |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 11 janvier 2011)    | (0,29 %) | 2,05 %                    |
| Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007)     | (0,75 %) | 2,15 %                    |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)                           | (0,68 %) | 2,50 % <sup>2</sup>       |

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

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

## Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                               | 6 mois | Lancement de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                            |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2015)                      | 5,85 % | 2,30 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2015)                       | 5,27 % | 1,18 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)                    | 5,75 % | 0,31 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 décembre 2021)                   | 6,60 % | 3,69 %                    |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                        | 1,85 % | 2,39 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                            |        |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015)    | 4,93 % | 0,57 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015)     | 4,31 % | (0,53 %)                  |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR) <sup>3</sup>       | 0,97 % | 0,65 %                    |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                            |        |                           |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 23 septembre 2022) | 5,83 % | (1,62 %)                  |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP) <sup>3</sup>       | 1,86 % | 4,41 %                    |

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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



| Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026 <sup>1</sup> |  |  | Objectif d'investissement et présentation de la stratégie |                           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|-----------------------------------------------------------|---------------------------|
|                                                                                                   |  |  | 6 mois                                                    | Lancement de la catégorie |
| Catégories libellées en GBP                                                                       |  |  |                                                           |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2007)                                     |  |  | 1,10 %                                                    | 4,31 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 8 juillet 2016)                                          |  |  | 1,12 %                                                    | 1,65 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 2 septembre 2024)                                    |  |  | 1,10 %                                                    | 5,05 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 novembre 2019)                                       |  |  | 1,26 %                                                    | 0,67 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Corporate <sup>3</sup>                                     |  |  | 1,26 %                                                    | 4,05 % <sup>2</sup>       |

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

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

<sup>3</sup> La performance de l'indice de référence du Fonds UK Corporate Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 23 mars 2026 : Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index ; à partir du 24 mars 2026 : Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Corporate.

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

| Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026 <sup>1</sup> |        |                           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------|
|                                                                                                   | 6 mois | Lancement de la catégorie |
| Catégories libellées en GBP                                                                       |        |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)                                          | 0,13 % | 4,00 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 14 août 2008)                                            | 0,06 % | 4,80 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index <sup>3</sup>                           | 0,13 % | 3,54 % <sup>2</sup>       |

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                             | 6 mois   | Lancement de la catégorie |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|----------|---------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                                          |          |                           |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 mai 1998)                                     | 1,20 %   | 5,75 %                    |
| Institutions, distribution (lancement le 23 janvier 2001)                                   | 1,26 %   | 6,06 %                    |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 mars 1999)                                   | 1,05 %   | 5,40 %                    |
| Investisseurs, distribution (lancement le 14 janvier 1999)                                  | 1,00 %   | 5,38 %                    |
| BM Détail, décumulation (lancement le 25 août 2025)                                         | 0,31 %   | 2,59 %                    |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                                     | 0,75 %   | 4,65 %                    |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)                                    | 0,83 %   | 4,72 %                    |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)                               | 1,11 %   | 6,68 %                    |
| H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)                                 | 1,04 %   | 3,84 %                    |
| M Détail, décumulation (lancement le 25 août 2025)                                          | 0,72 %   | 3,42 %                    |
| M Détail, distribution (lancement le 11 janvier 2012)                                       | 0,71 %   | 4,57 %                    |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)                                 | 1,07 %   | 4,79 %                    |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 29 juin 2016)                                     | 1,49 %   | 5,87 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index <sup>3</sup>                  | 1,89 %   | 5,97 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                                          |          |                           |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2003)                 | 0,29 %   | 4,99 %                    |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)                | 0,25 %   | 4,36 %                    |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 février 2003)              | 0,13 %   | 4,87 %                    |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)                   | (0,11 %) | 3,38 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en EUR) <sup>3</sup> | 0,95 %   | 5,60 % <sup>2</sup>       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                                          |          |                           |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)             | 1,13 %   | 5,74 %                    |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 juin 2016)                    | 1,15 %   | 4,24 %                    |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en GBP) <sup>3</sup> | 1,83 %   | 6,20 % <sup>2</sup>       |

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                                  | 6 mois   | Lancement<br>de la catégorie |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                               |          |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 15 septembre 2016)                    | 0,86 %   | 2,68 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 15 septembre 2016)                      | 0,88 %   | 2,69 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019)                       | 0,39 %   | 0,56 %                       |
| Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019)                             | 0,45 %   | 1,67 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)                       | 0,76 %   | 4,55 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index                                               | 0,85 %   | 2,51 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                               |          |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2016)  | 0,00 %   | 0,56 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en EUR)                              | (0,04 %) | 0,35 %                       |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                               |          |                              |
| Institutions en GBP (couverte), distribution II (lancement le 15 septembre 2016) | 0,84 %   | 1,73 %                       |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en GBP)                              | 0,83 %   | 1,57 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2026<sup>1</sup>

|                                                                               | 6 mois | Lancement<br>de la catégorie |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|
| <b>Catégories libellées en USD</b>                                            |        |                              |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)                      | 2,32 % | 2,65 %                       |
| Institutions, distribution (lancement le 11 mai 2020)                         | 2,36 % | 3,39 %                       |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)                     | 2,18 % | 2,29 %                       |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)                       | 2,11 % | 2,24 %                       |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)                | 2,21 % | 2,98 %                       |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 7 août 2014)                          | 2,49 % | 3,12 %                       |
| Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index                                       | 1,87 % | 2,01 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en AUD</b>                                            |        |                              |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 août 2024)      | 2,37 % | 4,69 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en AUD)    | 1,89 % | 3,87 %                       |
| <b>Catégories libellées en EUR</b>                                            |        |                              |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 1,45 % | 1,08 %                       |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2016)      | 1,24 % | 0,61 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en EUR)    | 0,87 % | 0,35 % <sup>2</sup>          |
| <b>Catégories libellées en GBP</b>                                            |        |                              |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2023)       | 2,37 % | 5,40 %                       |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en GBP)    | 1,76 % | 4,51 %                       |

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

## Description des indices de référence

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

## Description des indices de référence (suite)

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



| Nom officiel des indices de référence                                                          | Description des indices                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)</b>                         | L'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) est un indice non géré qui mesure à grande échelle les marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. Cet indice exclut les obligations d'État et les obligations titrisées. L'indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres canadiens et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD)</b>                         | L'Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) offre une mesure à grande échelle des marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. L'Indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres de l'État canadien, des titres d'agences et d'entreprises, et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ».                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD)</b>                                 | L'Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD) offre aux investisseurs une mesure objective et solide du marché mondial des titres à revenu fixe émis pour financer des projets présentant des avantages environnementaux directs. Une méthodologie indépendante axée sur la recherche est utilisée pour évaluer les obligations vertes éligibles à l'Indice afin de s'assurer qu'elles respectent les principes établis en matière d'obligations vertes et pour classer les obligations en fonction de leur utilisation environnementale des produits. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index</b>                                                   | L'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar américain. L'indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprises, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Ces grands secteurs sont subdivisés en indices plus spécifiques, calculés et déclarés régulièrement. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index</b>                                         | L'Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar américain avec une échéance de un à trois ans. L'Indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprise, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <b>Indice Bloomberg U.S. Credit Index</b>                                                      | L'Indice Bloomberg U.S. Credit Index est un indice non géré composé d'obligations et billets garantis d'entreprises américaines cotées et de certaines entreprises non américaines remplissant les conditions définies d'échéance, de liquidité et de qualité. Pour être admissibles, les obligations doivent être enregistrées auprès de la SEC. Cet indice était auparavant dénommé Indice Bloomberg Credit Investment Grade Index. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| <b>Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)</b>          | L'Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) mesure la performance des principaux marchés des obligations d'État indexées sur l'inflation. Il englobe les dettes indexées sur l'inflation des pays suivants : Australie, Canada, France, Suède, Royaume-Uni et États-Unis. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <b>Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD)</b> | L'Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) mesure la performance du marché mondial des obligations d'État indexées sur l'inflation ayant une échéance comprise entre un et cinq ans. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA)</b>                              | Le taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) mesure le coût du financement général à un jour en dollar canadien des garanties en utilisant les bons du Trésor et les obligations du gouvernement du Canada comme garantie des opérations de pension.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <b>Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index</b>                                                 | L'Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index est un indice non géré représentatif des performances mensuelles équivalentes aux rendements moyens des émissions de bons du Trésor américain des 3 derniers mois. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index</b>                                           | L'Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index est représentatif du marché du revenu fixe de qualité « investment grade » de la zone euro accessible aux investisseurs institutionnels (en euro). Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>Indice ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index</b>           | L'Indice ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (couvert en USD) est composé de tous les titres de l'Indice ICE BofA Global High Yield Index (l'« Indice parent »), pour autant qu'ils répondent aux critères suivants : 1) ils sont notés de BB1 à B3 sur la base d'une moyenne des notes attribuées par Moody's, S&P et Fitch ; 2) leurs risques sont propres à ceux des pays de marchés développés. Les marchés développés désignent les membres du FX-G10, les pays d'Europe de l'Ouest ou les territoires des États-Unis. Le FX-G10 comprend tous les membres de la zone euro, les États-Unis, le Japon, le Royaume-Uni, le Canada, l'Australie, la Nouvelle-Zélande, la Suisse, la Norvège et la Suède. Les pondérations des titres de l'Indice parent présélectionné qui en résulte sont ajustées de manière à améliorer le score global de risque environnemental, social et de gouvernance de l'indice. |
| <b>Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index</b>                                      | L'Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index est composé d'une émission unique acquise au début du mois et détenue pendant un mois entier. À la fin du mois, cette émission est vendue et réinvestie dans une émission nouvellement sélectionnée. L'émission sélectionnée lors du rééquilibrage à chaque fin de mois est le bon du Trésor allemand en circulation dont l'échéance est la plus proche d'un délai de trois mois suivant la date de rééquilibrage, sans être inférieure à un mois. Pour pouvoir être sélectionné, le bon du Trésor doit avoir été réglé au plus tard à la date de rééquilibrage de fin de mois.                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <b>Indice ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index</b>                                            | L'Indice ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index est un indice non géré composé de titres du Trésor américain, autres que les titres de protection contre l'inflation et les STRIPS, dont la valeur nominale en circulation est d'au moins 1 milliard USD et dont l'échéance résiduelle se situe entre un et trois ans. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |



## Description des indices de référence (suite)

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

| Nom officiel des indices de référence                                                                | Description des indices                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)</b>                               | L'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) reproduit la performance totale des instruments du marché monétaire libellés en devise locale de 22 pays émergents dont le commerce extérieur est supérieur ou égal à 10 milliards USD. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global</b>                                     | L'Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global reproduit la performance totale des instruments de créance libellés en dollar américain et émis par des entités souveraines ou quasi souveraines de marchés émergents.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <b>Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified</b>                     | L'Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified reproduit la performance totale des instruments de créance libellés en dollar américain émis par des entités souveraines et quasi-souveraines des marchés émergents intégrant des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance à la construction de l'indice.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index</b>           | L'Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified (JESG GBI-EM) reproduit la performance des obligations émises par les gouvernements des marchés émergents et libellées dans la devise locale de l'émetteur. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG (facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance) pour favoriser les émetteurs les mieux classés selon les critères ESG et les émissions d'obligations vertes, et pour sous-pondérer ou éliminer les émetteurs moins bien classés.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| <b>Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert)</b> | L'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert) représente un indice exhaustif des marchés émergents locaux dans le monde entier, et consiste en des obligations d'État en devises locales négociées régulièrement et à des taux fixes liquides auxquelles les investisseurs mondiaux peuvent obtenir une exposition. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>Indice JPMorgan Asia Credit Index Composite Total Return (couvert en EUR)</b>                     | L'Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en EUR) mesure la performance des marchés d'obligations libellées en dollar américain des marchés d'Asie hors Japon. L'indice fournit une référence pour les opportunités d'investissement dans les instruments à revenu fixe libellés en dollar américain émis par les émetteurs souverains, quasi-souverains et les entreprises de l'Asie hors Japon.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>Indice JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade</b>                                        | L'Indice JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade comprend des obligations à rendement élevé et à taux fixe libellées en dollar américain, émises par des emprunteurs souverains ou quasi-souverains, des banques et des entreprises asiatiques. L'Indice JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade existant comprend à la fois des obligations à taux fixe et à taux flottant émises par des entités domiciliées en Asie ayant un encours nominal d'au moins 150 millions USD et plus d'un an restant à courir jusqu'à l'échéance.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres)</b>            | L'Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres) est un indice diversifié au niveau mondial qui couvre un univers étendu d'opportunités à revenu fixe et de secteurs dans le monde entier, allant des marchés développés aux marchés émergents, des actifs virtuels aux actifs réels et des liquidités aux instruments dérivés. À la différence des indices classiques, le plus souvent composés d'obligations pondérées en fonction de leur capitalisation boursière, le GLADI utilise les pondérations des PIB, mettant ainsi l'accent sur les régions du monde à croissance rapide, ce qui donne à l'indice une nature prévisionnelle. La méthodologie GLADI de PIMCO est une propriété intellectuelle couverte par le brevet américain numéro 8 306 892. GLOBAL ADVANTAGE et GLADI sont des marques déposées de Pacific Investment Management Company LLC. |
| <b>Indice S&amp;P 500 Index</b>                                                                      | L'Indice S&P 500 Index est un indice non géré, considéré généralement comme représentatif du marché d'actions dans son ensemble. L'indice privilégie le segment des grandes capitalisations du marché d'actions américain. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA</b>                                    | Le taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour (SORA) est le taux moyen pondéré en fonction du volume des transactions d'emprunt sur le marché interbancaire en dollar de Singapour au jour le jour sans garantie à Singapour.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

## Bilan

(Montants en milliers)

|                                                                                                                            | Fonds PIMCO Asia High<br>Yield Bond Fund |                        | Fonds Asia Strategic<br>Interest Bond Fund |                        |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|------------------------|--------------------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                            | Au<br>30 juin 2026                       | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                         | Au<br>31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                               |                                          |                        |                                            |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                           |                                          |                        |                                            |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                         | \$ 925 892                               | \$ 983 682             | \$ 265 383                                 | \$ 250 756             |
| Fonds d'investissement                                                                                                     | 40 208                                   | 62 936                 | 15 435                                     | 27 821                 |
| Contrats de mise en pension                                                                                                | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                                   | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                             | 4 531                                    | 8 319                  | 1 322                                      | 1 476                  |
| Autres actifs financiers                                                                                                   | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| Liquidités                                                                                                                 | 3 449                                    | 1 728                  | 1 678                                      | 2 042                  |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                             | 12 349                                   | 16 214                 | 2 996                                      | 2 025                  |
| Produits à recevoir                                                                                                        | 15 877                                   | 17 014                 | 4 125                                      | 3 981                  |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                      | 1 799                                    | 139                    | 0                                          | 34                     |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                                  | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                    | 115                                      | 3 343                  | 165                                        | 613                    |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                                | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                         | 2 460                                    | 6 401                  | 487                                        | 526                    |
| Autres actifs                                                                                                              | 210                                      | 163                    | 0                                          | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                      | <b>1 006 890</b>                         | <b>1 099 939</b>       | <b>291 591</b>                             | <b>289 274</b>         |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                              |                                          |                        |                                            |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                          |                                          |                        |                                            |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                             | (12 530)                                 | (5 880)                | (3 082)                                    | (1 215)                |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                                 | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                        | (5 495)                                  | (501)                  | (600)                                      | (929)                  |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                    | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                     | (2 286)                                  | (614)                  | (153)                                      | (221)                  |
| Frais de gestion à payer                                                                                                   | (631)                                    | (730)                  | (181)                                      | (173)                  |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                                   | (48 562)                                 | (10 034)               | 0                                          | (1 208)                |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                        | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                            | (53)                                     | (24)                   | (9)                                        | 0                      |
| Découvert bancaire                                                                                                         | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                         | (13)                                     | (77)                   | (1)                                        | (1)                    |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                            | (1 471)                                  | (6 029)                | (492)                                      | (282)                  |
| Dépôts des contreparties                                                                                                   | (701)                                    | (5 370)                | 0                                          | (570)                  |
| Autres passifs                                                                                                             | 0                                        | 0                      | 0                                          | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux<br/>porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(71 742)</b>                          | <b>(29 259)</b>        | <b>(4 518)</b>                             | <b>(4 599)</b>         |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                        | <b>\$ 935 148</b>                        | <b>\$ 1 070 680</b>    | <b>\$ 287 073</b>                          | <b>\$ 284 675</b>      |

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

| Fonds PIMCO Balanced<br>Income and Growth Fund |                        | Fonds PIMCO Capital<br>Securities Fund |                        | Fonds PIMCO Climate<br>Bond Fund |                        | Fonds Commodity Real<br>Return Fund |                        |
|------------------------------------------------|------------------------|----------------------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|-------------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026                             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                     | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                  | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 16 406 576                                  | \$ 5 914 412           | \$ 5 653 945                           | \$ 5 979 670           | \$ 386 346                       | \$ 356 007             | \$ 1 667 246                        | \$ 1 100 352           |
| 1 236 860                                      | 445 044                | 55                                     | 54                     | 0                                | 0                      | 32                                  | 32                     |
| 178 300                                        | 64 000                 | 0                                      | 0                      | 15 100                           | 4 800                  | 1 016                               | 10 500                 |
| 0                                              | 0                      | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| 132 748                                        | 33 345                 | 111 726                                | 55 128                 | 9 452                            | 7 253                  | 27 720                              | 23 535                 |
| 0                                              | 0                      | 90 736                                 | 76 100                 | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| 16 227                                         | 56 516                 | 3 432                                  | 3 880                  | 1 740                            | 1 186                  | 6 725                               | 2 230                  |
| 234 401                                        | 38 680                 | 184 963                                | 108 964                | 6 410                            | 6 542                  | 73 171                              | 9 605                  |
| 55 671                                         | 16 763                 | 60 751                                 | 63 839                 | 4 728                            | 4 388                  | 4 943                               | 3 023                  |
| 11 261                                         | 10 971                 | 0                                      | 96 084                 | 0                                | 2                      | 783                                 | 16 631                 |
| 1 749 140                                      | 1 007 568              | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 146 174                             | 454                    |
| 162 841                                        | 99 186                 | 3 983                                  | 6 462                  | 687                              | 162                    | 826                                 | 843                    |
| 0                                              | 0                      | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| 116 670                                        | 32 489                 | 59 596                                 | 37 514                 | 2 281                            | 1 342                  | 15 533                              | 12 070                 |
| 0                                              | 19                     | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| 20 300 695                                     | 7 718 993              | 6 169 187                              | 6 427 695              | 426 744                          | 381 682                | 1 944 169                           | 1 179 275              |
| (142 996)                                      | (28 644)               | (87 746)                               | (64 744)               | (9 685)                          | (5 185)                | (72 103)                            | (8 018)                |
| (148 625)                                      | 0                      | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| (128 118)                                      | (23 384)               | (373)                                  | (56 211)               | (4 100)                          | 0                      | (797)                               | (27 576)               |
| (3 360 406)                                    | (1 782 666)            | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | (267 904)                           | (58 046)               |
| (26 157)                                       | (62 393)               | (5 722)                                | (4 807)                | (130)                            | (181)                  | (1 174)                             | (1 150)                |
| (19 025)                                       | (6 783)                | (4 892)                                | (5 235)                | (165)                            | (158)                  | (979)                               | (702)                  |
| 0                                              | (4 918)                | (238 380)                              | (300 608)              | (2 234)                          | (539)                  | (419 446)                           | (201 123)              |
| 0                                              | 0                      | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| (4 264)                                        | (836)                  | (197)                                  | (215)                  | 0                                | 0                      | (11)                                | (6)                    |
| 0                                              | 0                      | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| (17)                                           | (873)                  | (862)                                  | (820)                  | (261)                            | (325)                  | (139)                               | (12)                   |
| (137 523)                                      | (29 082)               | (77 674)                               | (28 066)               | (2 307)                          | (1 682)                | (19 193)                            | (17 857)               |
| (27 275)                                       | (20 084)               | (36 059)                               | (27 693)               | (1 770)                          | (2 790)                | (5 634)                             | (28 053)               |
| 0                                              | 0                      | 0                                      | 0                      | 0                                | 0                      | 0                                   | 0                      |
| (3 994 406)                                    | (1 959 663)            | (451 905)                              | (488 399)              | (20 652)                         | (10 860)               | (787 380)                           | (342 543)              |
| \$ 16 306 289                                  | \$ 5 759 330           | \$ 5 717 282                           | \$ 5 939 296           | \$ 406 092                       | \$ 370 822             | \$ 1 156 789                        | \$ 836 732             |

|                                                                                                                        | Fonds PIMCO Credit<br>Opportunities Bond Fund |                        | Fonds Diversified<br>Income Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026                            | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026               | Au<br>31 décembre 2025 |
| (Montants en milliers)                                                                                                 |                                               |                        |                                  |                        |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                               |                        |                                  |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                               |                        |                                  |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 281 397                                    | \$ 251 950             | \$ 9 134 632                     | \$ 10 467 685          |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 547                                           | 539                    | 927 062                          | 1 001 809              |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 12 700                                        | 35 000                 | 145 536                          | 100 591                |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 8 839                                         | 5 683                  | 168 092                          | 99 275                 |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 0                                             | 0                      | 7 773                            | 10 031                 |
| Liquidités                                                                                                             | 2 023                                         | 1 764                  | 35 267                           | 11 209                 |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 14 835                                        | 17 602                 | 288 553                          | 223 189                |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 2 872                                         | 2 862                  | 126 414                          | 132 792                |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 2 564                                         | 35                     | 26 249                           | 26 767                 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 46 299                                        | 0                      | 2 306 932                        | 2 393 649              |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 7                                             | 169                    | 45 863                           | 16 427                 |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 10 865                                        | 23 585                 | 113 888                          | 126 101                |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>382 948</b>                                | <b>339 189</b>         | <b>13 326 261</b>                | <b>14 609 525</b>      |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                               |                        |                                  |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                               |                        |                                  |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (6 748)                                       | (3 845)                | (146 254)                        | (65 032)               |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (5 767)                                       | (5 962)                | (193 328)                        | (187 441)              |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (110 266)                                     | (35 747)               | (3 193 883)                      | (3 851 162)            |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (40)                                          | 0                      | (12 185)                         | (27 322)               |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (130)                                         | (142)                  | (9 445)                          | (10 580)               |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (101)                                         | (337)                  | (91 639)                         | (93 841)               |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | (9)                                           | (2)                    | (2 604)                          | (2 807)                |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | 0                                             | 0                      | (4 082)                          | (3 510)                |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (11 275)                                      | (23 227)               | (154 909)                        | (105 102)              |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (2 976)                                       | (2 665)                | (33 436)                         | (56 278)               |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                                             | 0                      | 0                                | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(137 312)</b>                              | <b>(71 927)</b>        | <b>(3 841 765)</b>               | <b>(4 403 075)</b>     |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 245 636</b>                             | <b>\$ 267 262</b>      | <b>\$ 9 484 496</b>              | <b>\$ 10 206 450</b>   |

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

| Fonds Diversified Income<br>Duration Hedged Fund |                        | Fonds Diversified Income<br>ESG Fund |                        | Fonds Dynamic<br>Bond Fund |                        | Fonds Emerging<br>Local Bond Fund |                        |
|--------------------------------------------------|------------------------|--------------------------------------|------------------------|----------------------------|------------------------|-----------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026                               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                   | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026         | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 417 507                                       | \$ 390 832             | \$ 42 316                            | \$ 46 510              | \$ 6 137 605               | \$ 5 602 873           | \$ 6 897 391                      | \$ 6 174 762           |
| 17 640                                           | 33 413                 | 4 678                                | 5 008                  | 450 673                    | 444 796                | 160 566                           | 485 531                |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | 559 550                    | 1 412 243              | 0                                 | 0                      |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | 0                          | 0                      | 0                                 | 0                      |
| 11 673                                           | 10 765                 | 938                                  | 641                    | 128 182                    | 172 235                | 365 896                           | 283 551                |
| 192                                              | 493                    | 0                                    | 0                      | 3 701                      | 3 098                  | 0                                 | 0                      |
| 2 103                                            | 814                    | 411                                  | 404                    | 24 924                     | 13 036                 | 49 565                            | 32 240                 |
| 20 902                                           | 14 665                 | 875                                  | 757                    | 142 079                    | 92 757                 | 126 811                           | 84 249                 |
| 5 475                                            | 4 941                  | 549                                  | 652                    | 47 494                     | 45 408                 | 174 141                           | 157 243                |
| 1 688                                            | 926                    | 83                                   | 3                      | 4 692                      | 608                    | 790 777                           | 739 052                |
| 37 093                                           | 71 024                 | 2 215                                | 2 888                  | 3 343 075                  | 4 184 086              | 0                                 | 0                      |
| 1 531                                            | 392                    | 0                                    | 0                      | 3 230                      | 5 975                  | 3 681                             | 25 355                 |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | 0                          | 0                      | 0                                 | 0                      |
| 15 074                                           | 15 013                 | 489                                  | 469                    | 67 985                     | 51 680                 | 193 394                           | 98 667                 |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | 0                          | 0                      | 99                                | 10                     |
| 530 878                                          | 543 278                | 52 554                               | 57 332                 | 10 913 190                 | 12 028 795             | 8 762 321                         | 8 080 660              |
| (11 840)                                         | (6 188)                | (1 106)                              | (336)                  | (148 512)                  | (74 247)               | (451 568)                         | (298 460)              |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | (80 562)                   | (81 567)               | 0                                 | 0                      |
| (1 861)                                          | (1 589)                | 0                                    | (158)                  | (173 767)                  | (509 397)              | (872 910)                         | (834 035)              |
| (76 804)                                         | (132 644)              | (3 665)                              | (5 751)                | (5 804 896)                | (6 644 397)            | 0                                 | 0                      |
| (181)                                            | (24)                   | 0                                    | 0                      | (1 770)                    | (1 820)                | (22 151)                          | (719)                  |
| (388)                                            | (357)                  | (28)                                 | (31)                   | (3 464)                    | (3 507)                | (5 065)                           | (4 960)                |
| (3 161)                                          | (2 125)                | (358)                                | (373)                  | (935)                      | (4 551)                | (674 892)                         | (402 577)              |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | 0                          | 0                      | 0                                 | 0                      |
| (4)                                              | (2)                    | 0                                    | 0                      | (69)                       | (20)                   | (1 257)                           | (1 036)                |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | 0                          | 0                      | 0                                 | 0                      |
| (295)                                            | (204)                  | 0                                    | 0                      | (54)                       | (49)                   | 0                                 | 0                      |
| (16 424)                                         | (14 929)               | (696)                                | (374)                  | (51 610)                   | (42 305)               | (117 807)                         | (57 657)               |
| (541)                                            | (4 563)                | 0                                    | (180)                  | (30 622)                   | (111 985)              | (38 440)                          | (38 159)               |
| 0                                                | 0                      | 0                                    | 0                      | (26)                       | (13)                   | 0                                 | 0                      |
| (111 499)                                        | (162 625)              | (5 853)                              | (7 203)                | (6 296 287)                | (7 473 858)            | (2 184 090)                       | (1 637 603)            |
| \$ 419 379                                       | \$ 380 653             | \$ 46 701                            | \$ 50 129              | \$ 4 616 903               | \$ 4 554 937           | \$ 6 578 231                      | \$ 6 443 057           |

## Bilan (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                 | Fonds Emerging Local<br>Bond ESG Fund |                        | Fonds Emerging Markets<br>Bond Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026                    | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                  | Au<br>31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                       |                        |                                     |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                       |                        |                                     |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 228 930                            | \$ 148 066             | \$ 7 193 377                        | \$ 6 389 062           |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 0                                     | 0                      | 9 937                               | 419 546                |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 7 800                                 | 4 500                  | 0                                   | 0                      |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                     | 0                      | 0                                   | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 10 390                                | 7 172                  | 120 636                             | 87 267                 |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 0                                     | 0                      | 423                                 | 423                    |
| Liquidités                                                                                                             | 4 388                                 | 1 578                  | 0                                   | 17 921                 |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 3 979                                 | 1 890                  | 171 933                             | 113 413                |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 5 294                                 | 3 931                  | 130 155                             | 118 551                |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 13 419                                | 17 453                 | 32 071                              | 1 380                  |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 0                                     | 0                      | 32 388                              | 53 655                 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 0                                     | 0                      | 12 238                              | 9 153                  |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                     | 0                      | 0                                   | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 6 817                                 | 3 677                  | 54 610                              | 44 215                 |
| Autres actifs                                                                                                          | 1                                     | 0                      | 0                                   | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>281 018</b>                        | <b>188 267</b>         | <b>7 757 768</b>                    | <b>7 254 586</b>       |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                       |                        |                                     |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                       |                        |                                     |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (13 419)                              | (8 364)                | (175 544)                           | (72 422)               |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | 0                                     | 0                      | 0                                   | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (14 352)                              | (18 445)               | (64 142)                            | (69 170)               |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | 0                                     | 0                      | (89 450)                            | (111 415)              |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (1 942)                               | 0                      | (38 534)                            | (6 255)                |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (157)                                 | (104)                  | (5 061)                             | (5 008)                |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (22 568)                              | (16 935)               | (511 839)                           | (207 256)              |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                     | 0                      | 0                                   | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | (38)                                  | (16)                   | (182)                               | (32)                   |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                     | 0                      | (13 769)                            | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | 0                                     | 0                      | (1 021)                             | (811)                  |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (4 000)                               | (2 284)                | (69 120)                            | (35 034)               |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (1 190)                               | (270)                  | (8 413)                             | (34 628)               |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                                     | 0                      | 0                                   | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(57 666)</b>                       | <b>(46 418)</b>        | <b>(977 075)</b>                    | <b>(542 031)</b>       |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 223 352</b>                     | <b>\$ 141 849</b>      | <b>\$ 6 780 693</b>                 | <b>\$ 6 712 555</b>    |

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

| Fonds Emerging Markets<br>Bond ESG Fund |                        | Fonds Emerging Markets<br>Corporate Bond Fund |                        | Fonds PIMCO Emerging Markets<br>Opportunities Fund |                        | Fonds Emerging Markets Short-Term<br>Local Currency Fund |                        |
|-----------------------------------------|------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|----------------------------------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026                      | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                            | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                                 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                                       | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 3 759 033                            | \$ 3 723 189           | \$ 151 882                                    | \$ 151 643             | \$ 1 470 779                                       | \$ 698 322             | \$ 18 016                                                | \$ 12 557              |
| 0                                       | 0                      | 7 374                                         | 13 272                 | 172 674                                            | 36 609                 | 1 451                                                    | 1 333                  |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 161 100                                            | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| 65 236                                  | 53 087                 | 3 181                                         | 2 951                  | 67 861                                             | 37 133                 | 1 224                                                    | 847                    |
| 1 288                                   | 1 168                  | 313                                           | 313                    | 174                                                | 174                    | 25                                                       | 25                     |
| 3 046                                   | 3 164                  | 2 056                                         | 1 913                  | 7 224                                              | 4 444                  | 378                                                      | 252                    |
| 98 436                                  | 47 437                 | 3 785                                         | 1 394                  | 95 455                                             | 15 647                 | 241                                                      | 215                    |
| 67 491                                  | 71 074                 | 2 521                                         | 2 610                  | 31 090                                             | 15 838                 | 341                                                      | 223                    |
| 53                                      | 8 763                  | 1                                             | 582                    | 42 060                                             | 213                    | 668                                                      | 330                    |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 4 450                  | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| 1 019                                   | 2 218                  | 0                                             | 23                     | 16 956                                             | 845                    | 161                                                      | 30                     |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| 26 496                                  | 19 111                 | 1 295                                         | 1 543                  | 53 206                                             | 18 486                 | 399                                                      | 197                    |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 1                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| 4 022 098                               | 3 929 211              | 172 408                                       | 180 695                | 2 118 579                                          | 827 711                | 22 904                                                   | 16 009                 |
| (101 256)                               | (36 577)               | (5 044)                                       | (1 002)                | (94 033)                                           | (31 864)               | (1 218)                                                  | (834)                  |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| (57 057)                                | (8 799)                | (3 473)                                       | (2 944)                | (138 530)                                          | (10 521)               | (788)                                                    | (380)                  |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | (4 438)                | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| (969)                                   | (334)                  | (30)                                          | (52)                   | (368)                                              | (3)                    | (6)                                                      | (7)                    |
| (2 383)                                 | (2 446)                | (140)                                         | (150)                  | (1 077)                                            | (409)                  | (25)                                                     | (20)                   |
| (354 253)                               | (363 654)              | (1 543)                                       | (991)                  | (48 745)                                           | (7 039)                | 0                                                        | 0                      |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| (70)                                    | (1)                    | (3)                                           | 0                      | (171)                                              | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| (473)                                   | (456)                  | 0                                             | 0                      | (371)                                              | (74)                   | 0                                                        | 0                      |
| (34 524)                                | (17 896)               | (1 208)                                       | (1 625)                | (50 162)                                           | (20 695)               | (250)                                                    | (147)                  |
| (6 301)                                 | (25 287)               | (361)                                         | (1 975)                | (3 105)                                            | (5 580)                | 0                                                        | 0                      |
| 0                                       | 0                      | 0                                             | 0                      | 0                                                  | 0                      | 0                                                        | 0                      |
| (557 286)                               | (455 450)              | (11 802)                                      | (13 177)               | (336 562)                                          | (76 185)               | (2 287)                                                  | (1 388)                |
| \$ 3 464 812                            | \$ 3 473 761           | \$ 160 606                                    | \$ 167 518             | \$ 1 782 017                                       | \$ 751 526             | \$ 20 617                                                | \$ 14 621              |



|                                                                                                                        | Fonds PIMCO ESG<br>Income Fund |                        | Fonds Euro<br>Bond Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|------------------------|-------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026      | Au<br>31 décembre 2025 |
| (Montants en milliers)                                                                                                 |                                |                        |                         |                        |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                |                        |                         |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                |                        |                         |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 690 904                     | \$ 560 360             | € 1 866 721             | € 1 892 415            |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 0                              | 0                      | 48 955                  | 69 140                 |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 125 100                        | 81 300                 | 7 000                   | 18 500                 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                              | 0                      | 0                       | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 16 945                         | 14 686                 | 14 263                  | 14 579                 |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 0                              | 0                      | 2 929                   | 2 386                  |
| Liquidités                                                                                                             | 2 247                          | 2 425                  | 3 090                   | 6 605                  |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 37 646                         | 9 604                  | 35 225                  | 23 656                 |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 5 542                          | 4 153                  | 16 461                  | 20 545                 |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 0                              | 0                      | 1 737                   | 1 111                  |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 133 845                        | 207 827                | 204 854                 | 258 232                |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 9                              | 114                    | 7                       | 197                    |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                              | 0                      | 0                       | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 13 433                         | 10 213                 | 10 180                  | 11 429                 |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                              | 0                      | 0                       | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>1 025 671</b>               | <b>890 682</b>         | <b>2 211 422</b>        | <b>2 318 795</b>       |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                |                        |                         |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                |                        |                         |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (33 924)                       | (6 943)                | (16 401)                | (10 745)               |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | 0                              | (10 733)               | 0                       | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (1 861)                        | (133)                  | (17 275)                | (21 155)               |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (322 878)                      | (325 931)              | (371 438)               | (441 705)              |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (278)                          | (38)                   | (198)                   | (134)                  |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (333)                          | (271)                  | (674)                   | (725)                  |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (1 192)                        | (3 342)                | (211 382)               | (193 275)              |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                              | 0                      | 0                       | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | (10)                           | (3)                    | (7)                     | (7)                    |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                              | 0                      | 0                       | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | (9)                            | (8)                    | 0                       | 0                      |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (14 583)                       | (8 992)                | (13 848)                | (10 403)               |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (1 803)                        | (9 533)                | (2 900)                 | (6 322)                |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                              | 0                      | 0                       | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(376 871)</b>               | <b>(365 927)</b>       | <b>(634 123)</b>        | <b>(684 471)</b>       |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 648 800</b>              | <b>\$ 524 755</b>      | <b>€ 1 577 299</b>      | <b>€ 1 634 324</b>     |

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

| Fonds Euro<br>Credit Fund |                        | Fonds Euro Income<br>Bond Fund |                        | Fonds Euro Long<br>Average Duration Fund |                        | Fonds Euro<br>Short-Term Fund |                        |
|---------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|------------------------------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                       | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026            | Au<br>31 décembre 2025 |
| € 580 666                 | € 594 820              | € 3 967 400                    | € 3 648 032            | € 1 818 363                              | € 1 743 911            | € 474 781                     | € 447 524              |
| 711                       | 0                      | 285 882                        | 254 853                | 12 602                                   | 7 376                  | 7 838                         | 0                      |
| 0                         | 7 800                  | 226 700                        | 257 900                | 6 100                                    | 4 600                  | 0                             | 14 300                 |
| 0                         | 0                      | 0                              | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| 6 581                     | 2 365                  | 83 441                         | 46 219                 | 14 074                                   | 11 441                 | 186                           | 646                    |
| 0                         | 0                      | 492                            | 1 230                  | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| 2 963                     | 5 456                  | 32 976                         | 32 366                 | 2 606                                    | 5 603                  | 300                           | 1 184                  |
| 17 696                    | 15 326                 | 85 151                         | 58 068                 | 20 015                                   | 16 689                 | 1 119                         | 1 067                  |
| 6 047                     | 6 674                  | 17 600                         | 10 990                 | 19 253                                   | 25 907                 | 3 700                         | 3 022                  |
| 421                       | 12                     | 4 327                          | 6                      | 1 051                                    | 793                    | 221                           | 0                      |
| 47 959                    | 83 028                 | 2 066 852                      | 2 774 172              | 137 782                                  | 88 451                 | 0                             | 0                      |
| 0                         | 50                     | 2 109                          | 15 461                 | 5                                        | 0                      | 284                           | 1 377                  |
| 0                         | 0                      | 0                              | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| 14 808                    | 19 033                 | 42 547                         | 35 585                 | 6 057                                    | 4 333                  | 745                           | 139                    |
| 0                         | 0                      | 0                              | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| 677 852                   | 734 564                | 6 815 477                      | 7 134 882              | 2 037 908                                | 1 909 104              | 489 174                       | 469 259                |
| (5 262)                   | (8 105)                | (52 046)                       | (33 732)               | (10 525)                                 | (9 496)                | (1 183)                       | (607)                  |
| 0                         | 0                      | (16 939)                       | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| (3 811)                   | 0                      | (76 017)                       | (34 893)               | (12 846)                                 | (12 037)               | (1 500)                       | 0                      |
| (126 830)                 | (160 429)              | (3 725 080)                    | (4 374 219)            | (269 755)                                | (194 495)              | 0                             | 0                      |
| (75)                      | (376)                  | (1 991)                        | (944)                  | (4)                                      | 0                      | (352)                         | (345)                  |
| (205)                     | (224)                  | (2 165)                        | (2 094)                | (477)                                    | (463)                  | (191)                         | (193)                  |
| 0                         | 0                      | 0                              | (8 747)                | (429 566)                                | (506 764)              | 0                             | 0                      |
| 0                         | 0                      | 0                              | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| (8)                       | (1)                    | (112)                          | (38)                   | 0                                        | 0                      | (1)                           | (1)                    |
| 0                         | 0                      | 0                              | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| 0                         | 0                      | 0                              | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| (16 421)                  | (12 925)               | (65 796)                       | (37 027)               | (10 011)                                 | (4 744)                | 0                             | (63)                   |
| 0                         | (300)                  | (21 625)                       | (15 614)               | (4 238)                                  | (2 617)                | 0                             | (260)                  |
| 0                         | 0                      | (3)                            | 0                      | 0                                        | 0                      | 0                             | 0                      |
| (152 612)                 | (182 360)              | (3 961 774)                    | (4 507 308)            | (737 422)                                | (730 616)              | (3 227)                       | (1 469)                |
| € 525 240                 | € 552 204              | € 2 853 703                    | € 2 627 574            | € 1 300 486                              | € 1 178 488            | € 485 947                     | € 467 790              |

| (Montants en milliers)                                                                                                 | Fonds PIMCO European<br>High Yield Bond Fund |                        | Fonds PIMCO European Short-Term<br>Opportunities Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|------------------------|-------------------------------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026                           | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                                    | Au<br>31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                              |                        |                                                       |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                              |                        |                                                       |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | € 561 940                                    | € 493 361              | € 1 483 764                                           | € 1 190 595            |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 32 899                                       | 23 274                 | 34 091                                                | 120 284                |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 0                                            | 7 200                  | 52 100                                                | 50 300                 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 3 150                                        | 1 375                  | 11 848                                                | 12 769                 |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 247                                          | 201                    | 216                                                   | 176                    |
| Liquidités                                                                                                             | 3 083                                        | 3 867                  | 4 805                                                 | 5 514                  |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 8 627                                        | 7 806                  | 25 968                                                | 17 429                 |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 7 898                                        | 6 954                  | 11 597                                                | 9 023                  |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 125                                          | 789                    | 1 972                                                 | 1 352                  |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 0                                            | 0                      | 117 621                                               | 168 156                |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 112                                          | 214                    | 259                                                   | 397                    |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                            | 0                      | 3 672                                                 | 2 992                  |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 3 919                                        | 4 777                  | 6 595                                                 | 4 410                  |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>622 000</b>                               | <b>549 818</b>         | <b>1 754 508</b>                                      | <b>1 583 397</b>       |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                              |                        |                                                       |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                              |                        |                                                       |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (2 635)                                      | (1 503)                | (11 991)                                              | (5 758)                |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (4 620)                                      | (2 192)                | (12 059)                                              | (14 637)               |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | 0                                            | 0                      | (253 783)                                             | (304 358)              |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (300)                                        | (53)                   | (208)                                                 | (58)                   |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (211)                                        | (178)                  | (344)                                                 | (334)                  |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (12 312)                                     | (16 626)               | (232 740)                                             | (1 021)                |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (4 756)                                      | (4 113)                | (8 853)                                               | (8 603)                |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (290)                                        | (665)                  | (5 433)                                               | (3 448)                |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                                            | 0                      | 0                                                     | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(25 124)</b>                              | <b>(25 330)</b>        | <b>(525 411)</b>                                      | <b>(338 217)</b>       |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>€ 596 876</b>                             | <b>€ 524 488</b>       | <b>€ 1 229 097</b>                                    | <b>€ 1 245 180</b>     |

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

| Fonds Global<br>Advantage Fund |                        | Fonds Global<br>Bond Fund |                        | Fonds Global Bond<br>ESG Fund |                        | Fonds Global Bond<br>Ex-US Fund |                        |
|--------------------------------|------------------------|---------------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------|---------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026            | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026              | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 648 003                     | \$ 683 345             | \$ 23 711 752             | \$ 23 744 021          | \$ 5 821 186                  | \$ 6 095 584           | \$ 1 381 839                    | \$ 1 384 965           |
| 20 448                         | 16 769                 | 1 175 646                 | 1 187 758              | 20 604                        | 4 363                  | 26 964                          | 57 622                 |
| 0                              | 0                      | 0                         | 0                      | 2 300                         | 5 700                  | 0                               | 0                      |
| 0                              | 0                      | 0                         | 0                      | 0                             | 0                      | 0                               | 0                      |
| 15 133                         | 13 398                 | 536 893                   | 354 331                | 136 742                       | 111 042                | 36 415                          | 17 072                 |
| 106                            | 89                     | 453                       | 384                    | 0                             | 0                      | 494                             | 413                    |
| 5 298                          | 4 557                  | 55 322                    | 14 757                 | 24 734                        | 21 068                 | 8 704                           | 8 016                  |
| 17 882                         | 10 025                 | 537 037                   | 451 255                | 204 759                       | 96 686                 | 30 389                          | 30 045                 |
| 5 900                          | 6 630                  | 192 890                   | 203 681                | 46 093                        | 58 373                 | 11 182                          | 11 999                 |
| 53 482                         | 53 848                 | 2 060 546                 | 1 660 744              | 503 035                       | 425 661                | 125 781                         | 102 198                |
| 289 820                        | 338 884                | 9 125 755                 | 12 109 029             | 2 106 253                     | 3 447 341              | 523 774                         | 690 807                |
| 2                              | 0                      | 36 886                    | 15 449                 | 2 815                         | 895                    | 96                              | 7 621                  |
| 0                              | 0                      | 0                         | 0                      | 0                             | 0                      | 0                               | 0                      |
| 16 166                         | 9 621                  | 640 268                   | 392 849                | 122 652                       | 83 399                 | 37 330                          | 21 831                 |
| 0                              | 2                      | 0                         | 0                      | 0                             | 0                      | 0                               | 0                      |
| 1 072 240                      | 1 137 168              | 38 073 448                | 40 134 258             | 8 991 173                     | 10 350 112             | 2 182 968                       | 2 332 589              |
| (20 713)                       | (12 928)               | (397 771)                 | (470 375)              | (255 663)                     | (109 972)              | (26 569)                        | (33 163)               |
| (44 395)                       | (37 228)               | (1 658 869)               | (1 280 515)            | (445 843)                     | (408 961)              | (126 741)                       | (126 155)              |
| (76 533)                       | (66 252)               | (2 234 570)               | (1 857 164)            | (560 484)                     | (448 754)              | (141 741)                       | (114 216)              |
| (424 481)                      | (509 425)              | (14 197 048)              | (17 487 931)           | (3 284 771)                   | (4 689 748)            | (729 772)                       | (932 104)              |
| (24)                           | 0                      | (7 974)                   | (6 764)                | (1 366)                       | (1 966)                | (1 334)                         | (77)                   |
| (253)                          | (267)                  | (7 992)                   | (8 406)                | (1 552)                       | (1 689)                | (411)                           | (387)                  |
| (59 126)                       | (58 581)               | (1 075 478)               | (1 084 004)            | (365 538)                     | (449 939)              | (45 809)                        | (81 435)               |
| 0                              | 0                      | 0                         | 0                      | (87 961)                      | (1 137)                | 0                               | 0                      |
| (10)                           | (21)                   | (705)                     | (213)                  | (145)                         | (32)                   | (37)                            | (10)                   |
| 0                              | 0                      | 0                         | 0                      | 0                             | 0                      | 0                               | 0                      |
| 0                              | 0                      | (1 235)                   | (1 069)                | (1 206)                       | (1 165)                | 0                               | 0                      |
| (13 226)                       | (7 795)                | (709 030)                 | (285 737)              | (77 171)                      | (58 351)               | (33 950)                        | (15 400)               |
| (1 993)                        | (2 926)                | (173 058)                 | (92 659)               | (25 910)                      | (52 632)               | (14 713)                        | (1 637)                |
| (9)                            | 0                      | 0                         | 0                      | 0                             | 0                      | 0                               | 0                      |
| (640 763)                      | (695 423)              | (20 463 730)              | (22 574 837)           | (5 107 610)                   | (6 224 346)            | (1 121 077)                     | (1 304 584)            |
| \$ 431 477                     | \$ 441 745             | \$ 17 609 718             | \$ 17 559 421          | \$ 3 883 563                  | \$ 4 125 766           | \$ 1 061 891                    | \$ 1 028 005           |

| (Montants en milliers)                                                                                                 | Fonds Global Bond Opportunities Fund <sup>(1)</sup> | Fonds Global High Yield Bond Fund |                     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
|                                                                                                                        | 30 juin 2026                                        | Au 30 juin 2026                   | Au 31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                                     |                                   |                     |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                                     |                                   |                     |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 16 367                                           | \$ 2 193 051                      | \$ 2 439 628        |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 0                                                   | 136 361                           | 144 933             |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 5 300                                               | 72 800                            | 257 000             |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                                   | 0                                 | 0                   |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 146                                                 | 33 056                            | 32 287              |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 0                                                   | 1 727                             | 1 446               |
| Liquidités                                                                                                             | 246                                                 | 1 861                             | 643                 |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 591                                                 | 49 761                            | 38 423              |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 97                                                  | 35 612                            | 39 681              |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 0                                                   | 10 048                            | 8 489               |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 4 013                                               | 0                                 | 0                   |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 0                                                   | 2 369                             | 4 901               |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                                   | 0                                 | 0                   |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 630                                                 | 10 946                            | 23 424              |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                                                   | 335                               | 271                 |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>27 390</b>                                       | <b>2 547 927</b>                  | <b>2 991 126</b>    |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                                     |                                   |                     |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                                     |                                   |                     |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (127)                                               | (40 176)                          | (13 036)            |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | (1 111)                                             | 0                                 | 0                   |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (43)                                                | (32 583)                          | (13 155)            |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (10 597)                                            | 0                                 | 0                   |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | 0                                                   | (15 688)                          | (4 740)             |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (2)                                                 | (1 522)                           | (1 794)             |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | 0                                                   | (15 425)                          | (43 996)            |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                                   | 0                                 | 0                   |
| Charges à payer                                                                                                        | 0                                                   | (43)                              | (49)                |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                                   | 0                                 | 0                   |
| Dividendes à payer                                                                                                     | 0                                                   | (845)                             | (5 782)             |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (609)                                               | (16 229)                          | (18 710)            |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | 0                                                   | (7 759)                           | (22 543)            |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                                                   | 0                                 | 0                   |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(12 489)</b>                                     | <b>(130 270)</b>                  | <b>(123 805)</b>    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 14 901</b>                                    | <b>\$ 2 417 657</b>               | <b>\$ 2 867 321</b> |

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

<sup>(1)</sup> Le Fonds Global Bond Opportunities Fund a été lancé le 10 juin 2026.

| Fonds Global High Yield<br>Bond ESG Fund |                        | Fonds Global Investment<br>Grade Credit Fund |                        | Fonds Global Investment Grade<br>Credit ESG Fund |                        | Fonds Global Low Duration Real<br>Return Fund |                        |
|------------------------------------------|------------------------|----------------------------------------------|------------------------|--------------------------------------------------|------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026                       | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                           | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                            | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 24 873                                | \$ 25 036              | \$ 8 306 426                                 | \$ 7 852 001           | \$ 2 304 220                                     | \$ 2 424 680           | \$ 3 075 899                                  | \$ 2 652 642           |
| 0                                        | 0                      | 390 290                                      | 445 491                | 36 122                                           | 35 700                 | 385                                           | 1 179                  |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 267                                      | 41                     | 181 149                                      | 125 048                | 60 847                                           | 60 086                 | 49 111                                        | 37 344                 |
| 0                                        | 0                      | 12 450                                       | 11 185                 | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 1 228                                    | 1 072                  | 8 300                                        | 17 285                 | 1 144                                            | 5 867                  | 6 444                                         | 8 912                  |
| 387                                      | 265                    | 340 658                                      | 279 189                | 76 640                                           | 48 155                 | 39 386                                        | 24 163                 |
| 376                                      | 380                    | 95 766                                       | 93 947                 | 28 828                                           | 31 960                 | 13 847                                        | 10 962                 |
| 35                                       | 1                      | 16 203                                       | 1 397                  | 2 211                                            | 9 810                  | 1 671                                         | 263 402                |
| 0                                        | 0                      | 719 940                                      | 592 408                | 54 230                                           | 0                      | 144 713                                       | 100 916                |
| 0                                        | 0                      | 4 634                                        | 9 274                  | 694                                              | 556                    | 389                                           | 614                    |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 137                                      | 257                    | 113 618                                      | 123 671                | 15 471                                           | 10 165                 | 9 959                                         | 3 737                  |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 27 303                                   | 27 052                 | 10 189 434                                   | 9 550 896              | 2 580 407                                        | 2 626 979              | 3 341 804                                     | 3 103 871              |
| (53)                                     | (84)                   | (130 875)                                    | (86 276)               | (75 657)                                         | (26 099)               | (50 032)                                      | (23 663)               |
| 0                                        | 0                      | (93 738)                                     | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 0                                        | (35)                   | (163 000)                                    | (134 878)              | (15 235)                                         | 0                      | (21 779)                                      | (23 222)               |
| 0                                        | 0                      | (1 526 402)                                  | (1 259 724)            | (87 004)                                         | 0                      | (389 603)                                     | (219 342)              |
| 0                                        | 0                      | (3 773)                                      | (6 157)                | (1 032)                                          | (404)                  | (381)                                         | (57)                   |
| (5)                                      | (6)                    | (4 099)                                      | (4 531)                | (1 005)                                          | (1 110)                | (994)                                         | (824)                  |
| 0                                        | 0                      | (660 476)                                    | (23 515)               | (77 363)                                         | (34 617)               | (723 043)                                     | (1 108 669)            |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | (14 241)                                         | 0                      | 0                                             | 0                      |
| (1)                                      | (1)                    | (388)                                        | (305)                  | (236)                                            | (237)                  | (2)                                           | (1)                    |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| 0                                        | 0                      | (4 606)                                      | (4 693)                | (1 154)                                          | (1 431)                | (2 567)                                       | (655)                  |
| (213)                                    | (191)                  | (160 755)                                    | (114 404)              | (19 547)                                         | (12 832)               | (10 075)                                      | (10 976)               |
| 0                                        | 0                      | (45 182)                                     | (52 738)               | (10 891)                                         | (36 088)               | (13 894)                                      | (14 228)               |
| 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      | 0                                                | 0                      | 0                                             | 0                      |
| (272)                                    | (317)                  | (2 793 294)                                  | (1 687 221)            | (303 365)                                        | (112 818)              | (1 212 370)                                   | (1 401 637)            |
| \$ 27 031                                | \$ 26 735              | \$ 7 396 140                                 | \$ 7 863 675           | \$ 2 277 042                                     | \$ 2 514 161           | \$ 2 129 434                                  | \$ 1 702 234           |

|                                                                                                                        | Fonds Global Real<br>Return Fund |                        | Fonds Income Fund     |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026    | Au<br>31 décembre 2025 |
| (Montants en milliers)                                                                                                 |                                  |                        |                       |                        |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                  |                        |                       |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                  |                        |                       |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 3 818 438                     | \$ 3 229 634           | \$ 171 706 134        | \$ 156 259 773         |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 20 647                           | 9 578                  | 2 520 685             | 1 873 742              |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 0                                | 0                      | 5 145 186             | 26 417 245             |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                | 0                      | 0                     | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 65 368                           | 38 036                 | 5 391 091             | 4 662 164              |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 0                                | 0                      | 136 404               | 128 419                |
| Liquidités                                                                                                             | 7 338                            | 10 757                 | 289 172               | 1 916 860              |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 41 631                           | 39 158                 | 3 694 268             | 3 100 948              |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 17 265                           | 11 529                 | 1 163 349             | 927 194                |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 2 809                            | 458 121                | 155 986               | 65 007                 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 305 526                          | 220 038                | 79 186 130            | 106 036 033            |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 590                              | 617                    | 87 235                | 255 310                |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                | 0                      | 0                     | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 15 467                           | 5 495                  | 3 452 785             | 2 794 647              |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                                | 0                      | 0                     | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>4 295 079</b>                 | <b>4 022 963</b>       | <b>272 928 425</b>    | <b>304 437 342</b>     |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                  |                        |                       |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                  |                        |                       |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (60 902)                         | (40 155)               | (3 814 933)           | (2 533 693)            |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | 0                                | 0                      | (1 219 689)           | (29 247)               |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (25 820)                         | (33 735)               | (1 933 922)           | (5 224 564)            |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (562 713)                        | (439 988)              | (134 897 467)         | (167 421 211)          |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (279)                            | (614)                  | (146 790)             | (100 918)              |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (1 235)                          | (997)                  | (93 094)              | (92 911)               |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (1 071 037)                      | (1 618 159)            | (298 195)             | (296 457)              |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                | (4 611)                | 0                     | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | (20)                             | (21)                   | (14 021)              | (8 924)                |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                | 0                      | 0                     | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | (1 022)                          | (150)                  | (7 592)               | (13 592)               |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (10 933)                         | (10 468)               | (5 361 170)           | (6 125 558)            |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (20 037)                         | (10 104)               | (392 016)             | (842 165)              |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                                | 0                      | 0                     | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(1 753 998)</b>               | <b>(2 159 002)</b>     | <b>(148 178 889)</b>  | <b>(182 689 240)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 2 541 081</b>              | <b>\$ 1 863 961</b>    | <b>\$ 124 749 536</b> | <b>\$ 121 748 102</b>  |

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

| Fonds Income Fund II |                        | Fonds Low Average Duration Fund |                        | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund |                        | Fonds Low Duration Income Fund |                        |
|----------------------|------------------------|---------------------------------|------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026   | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026              | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                                     | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 912 609           | \$ 657 004             | \$ 540 653                      | \$ 668 986             | \$ 712 141                                             | \$ 1 302 267           | \$ 9 757 382                   | \$ 6 280 976           |
| 109                  | 48 920                 | 57 691                          | 57 001                 | 40 535                                                 | 22 744                 | 828 712                        | 507 982                |
| 0                    | 0                      | 21 800                          | 0                      | 4 800                                                  | 31 700                 | 2 438 642                      | 1 574 781              |
| 0                    | 0                      | 0                               | 0                      | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| 11 889               | 4 529                  | 3 149                           | 2 202                  | 32 006                                                 | 19 445                 | 203 821                        | 122 714                |
| 88                   | 74                     | 0                               | 0                      | 114                                                    | 114                    | 670                            | 561                    |
| 3 612                | 3 412                  | 2 427                           | 2 446                  | 2 262                                                  | 2 637                  | 120 159                        | 11 960                 |
| 13 827               | 10 196                 | 6 861                           | 8 107                  | 36 736                                                 | 34 912                 | 192 806                        | 114 949                |
| 7 016                | 4 364                  | 2 318                           | 3 318                  | 6 769                                                  | 15 150                 | 43 884                         | 30 445                 |
| 3                    | 1 395                  | 112                             | 60 597                 | 178                                                    | 546                    | 112 650                        | 54                     |
| 111 661              | 135 534                | 246 110                         | 275 962                | 192 954                                                | 27 778                 | 4 718 563                      | 4 326 174              |
| 819                  | 8 188                  | 146                             | 272                    | 278                                                    | 529                    | 13 017                         | 23 431                 |
| 0                    | 0                      | 0                               | 0                      | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| 10 444               | 6 822                  | 4 322                           | 8 025                  | 14 631                                                 | 19 557                 | 72 368                         | 47 292                 |
| 0                    | 0                      | 0                               | 0                      | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| 1 072 077            | 880 438                | 885 589                         | 1 086 916              | 1 043 404                                              | 1 477 379              | 18 502 674                     | 13 041 319             |
| (11 695)             | (6 133)                | (4 064)                         | (2 572)                | (27 917)                                               | (13 086)               | (132 171)                      | (66 205)               |
| 0                    | 0                      | (91 431)                        | (49 161)               | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| 0                    | (6 277)                | (6 527)                         | (12 311)               | (20 581)                                               | (18 694)               | (422 312)                      | (515 390)              |
| (294 375)            | (249 584)              | (257 185)                       | (319 050)              | (276 098)                                              | (87 001)               | (9 251 179)                    | (7 125 847)            |
| (3 335)              | (4 442)                | (9)                             | (454)                  | (93)                                                   | (231)                  | (3 391)                        | (3 288)                |
| (888)                | (742)                  | (239)                           | (265)                  | (329)                                                  | (572)                  | (4 611)                        | (3 243)                |
| (22 760)             | (2 336)                | 0                               | (125 619)              | 0                                                      | (335)                  | 0                              | (2 945)                |
| (4 998)              | 0                      | 0                               | 0                      | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| (28)                 | (2)                    | (4)                             | (4)                    | (34)                                                   | (5)                    | (457)                          | (92)                   |
| 0                    | 0                      | 0                               | 0                      | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| 0                    | (383)                  | (119)                           | (132)                  | 0                                                      | 0                      | (51)                           | (11)                   |
| (8 515)              | (6 050)                | (1 584)                         | (396)                  | (19 102)                                               | (18 923)               | (126 638)                      | (73 516)               |
| (4 940)              | (1 546)                | (1 172)                         | (687)                  | (10 352)                                               | (8 226)                | (51 688)                       | (42 621)               |
| 0                    | 0                      | 0                               | 0                      | 0                                                      | 0                      | 0                              | 0                      |
| (351 534)            | (277 495)              | (362 334)                       | (510 651)              | (354 506)                                              | (147 073)              | (9 992 498)                    | (7 833 158)            |
| \$ 720 543           | \$ 602 943             | \$ 523 255                      | \$ 576 265             | \$ 688 898                                             | \$ 1 330 306           | \$ 8 510 176                   | \$ 5 208 161           |



| (Montants en milliers)                                                                                                 | Fonds Low Duration<br>Opportunities Fund |                        | Fonds Low Duration<br>Opportunities ESG Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|------------------------|----------------------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026                       | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026                           | Au<br>31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                          |                        |                                              |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                          |                        |                                              |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 1 387 207                             | \$ 1 035 443           | \$ 5 960                                     | \$ 6 454               |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 105 398                                  | 87 159                 | 0                                            | 0                      |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 124 300                                  | 225 700                | 0                                            | 0                      |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 34 909                                   | 44 477                 | 111                                          | 70                     |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 2 785                                    | 2 331                  | 0                                            | 0                      |
| Liquidités                                                                                                             | 7 908                                    | 4 560                  | 61                                           | 63                     |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 31 643                                   | 18 048                 | 139                                          | 131                    |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 8 864                                    | 6 824                  | 67                                           | 61                     |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 1 020                                    | 162                    | 0                                            | 100                    |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 785 862                                  | 672 887                | 50                                           | 594                    |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 6                                        | 198                    | 0                                            | 0                      |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 20 867                                   | 15 127                 | 68                                           | 49                     |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>2 510 769</b>                         | <b>2 112 916</b>       | <b>6 456</b>                                 | <b>7 522</b>           |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                          |                        |                                              |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                          |                        |                                              |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (30 858)                                 | (10 880)               | (88)                                         | (89)                   |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | (37 461)                                 | (37 923)               | 0                                            | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (30 156)                                 | (25 072)               | (29)                                         | (117)                  |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (1 307 460)                              | (1 095 926)            | (355)                                        | (904)                  |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (22)                                     | (24)                   | 0                                            | 0                      |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (426)                                    | (360)                  | (2)                                          | (2)                    |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (201)                                    | (1 041)                | 0                                            | (842)                  |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                        | 0                      | (592)                                        | (252)                  |
| Charges à payer                                                                                                        | (16)                                     | 0                      | 0                                            | 0                      |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                        | 0                      | 0                                            | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | (4 705)                                  | (4 038)                | 0                                            | 0                      |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (27 280)                                 | (26 494)               | (23)                                         | (22)                   |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (6 526)                                  | (24 298)               | 0                                            | 0                      |
| Autres passifs                                                                                                         | (5)                                      | (2)                    | 0                                            | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(1 445 116)</b>                       | <b>(1 226 058)</b>     | <b>(1 089)</b>                               | <b>(2 228)</b>         |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 1 065 653</b>                      | <b>\$ 886 858</b>      | <b>\$ 5 367</b>                              | <b>\$ 5 294</b>        |

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

(2) Le Fonds MAARS Multi-Strategy Fund a été lancé le 12 mai 2026.

(3) Le Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund a changé de dénomination le 31 juillet 2026, il s'appelait auparavant le Fonds Inflation Multi-Asset Fund.

| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund <sup>(2)</sup> |          |                 | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund |                 |          | Fonds Mortgage Opportunities Fund |                 |    | Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund <sup>(3)</sup> |    |           |    |           |
|------------------------------------------------|----------|-----------------|----------------------------------------------|-----------------|----------|-----------------------------------|-----------------|----|---------------------------------------------------|----|-----------|----|-----------|
| Au 30 juin 2026                                |          | Au 30 juin 2026 | Au 31 décembre 2025                          | Au 30 juin 2026 |          | Au 31 décembre 2025               | Au 30 juin 2026 |    | Au 31 décembre 2025                               |    |           |    |           |
| \$                                             | 18 646   | \$              | 207 156                                      | \$              | 152 439  | \$                                | 5 503 392       | \$ | 5 236 106                                         | \$ | 315 350   | \$ | 236 696   |
|                                                | 3 700    |                 | 23 154                                       |                 | 16 610   |                                   | 5               |    | 5                                                 |    | 23 562    |    | 21 078    |
|                                                | 13 400   |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 89 700          |    | 5 600                                             |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 2 037    |                 | 2 657                                        |                 | 1 120    |                                   | 60 658          |    | 64 476                                            |    | 9 504     |    | 7 320     |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 1 241    |                 | 3 704                                        |                 | 9 181    |                                   | 4 284           |    | 3 506                                             |    | 1 869     |    | 1 348     |
|                                                | 2 503    |                 | 2 850                                        |                 | 440      |                                   | 43 722          |    | 29 569                                            |    | 8 516     |    | 4 140     |
|                                                | 27       |                 | 196                                          |                 | 194      |                                   | 15 492          |    | 14 428                                            |    | 933       |    | 538       |
|                                                | 0        |                 | 3                                            |                 | 12 021   |                                   | 364             |    | 31                                                |    | 15        |    | 5 828     |
|                                                | 11 186   |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 3 113 740       |    | 4 781 944                                         |    | 26 970    |    | 30 501    |
|                                                | 148      |                 | 287                                          |                 | 144      |                                   | 27 618          |    | 2 605                                             |    | 388       |    | 296       |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 3 564    |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 18 490          |    | 4 370                                             |    | 3 283     |    | 2 664     |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 56 452   |                 | 240 007                                      |                 | 192 149  |                                   | 8 877 465       |    | 10 142 640                                        |    | 390 390   |    | 310 409   |
|                                                | (1 626)  |                 | (3 224)                                      |                 | (688)    |                                   | (39 104)        |    | (15 356)                                          |    | (7 328)   |    | (2 645)   |
|                                                | (4 512)  |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | (658 245)       |    | (507 487)                                         |    | 0         |    | 0         |
|                                                | (1 919)  |                 | 0                                            |                 | (21 676) |                                   | (136 186)       |    | (121 846)                                         |    | 0         |    | (5 280)   |
|                                                | (6 783)  |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | (4 306 918)     |    | (6 334 262)                                       |    | (82 955)  |    | (80 764)  |
|                                                | 0        |                 | (148)                                        |                 | (63)     |                                   | (91)            |    | (550)                                             |    | (99)      |    | (38)      |
|                                                | (43)     |                 | (257)                                        |                 | (189)    |                                   | (1 720)         |    | (1 586)                                           |    | (243)     |    | (185)     |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | (776 572)       |    | (572 692)                                         |    | (27 185)  |    | (10 269)  |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | (12)            |    | (12)                                              |    | (2)       |    | (1)       |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | (201)           |    | (152)                                             |    | 0         |    | 0         |
|                                                | (3 267)  |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | (6 098)         |    | (7 503)                                           |    | (6 652)   |    | (6 550)   |
|                                                | 0        |                 | (1 762)                                      |                 | (712)    |                                   | (16 181)        |    | (21 291)                                          |    | (1 995)   |    | (1 232)   |
|                                                | 0        |                 | 0                                            |                 | 0        |                                   | 0               |    | 0                                                 |    | 0         |    | 0         |
|                                                | (18 150) |                 | (5 391)                                      |                 | (23 328) |                                   | (5 941 328)     |    | (7 582 737)                                       |    | (126 459) |    | (106 964) |
| \$                                             | 38 302   | \$              | 234 616                                      | \$              | 168 821  | \$                                | 2 936 137       | \$ | 2 559 903                                         | \$ | 263 931   | \$ | 203 445   |

| (Montants en milliers)                                                                                                 | Fonds StocksPLUS™ Fund |                        | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|------------------------|---------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026     | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026              | Au<br>31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                        |                        |                                 |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                        |                        |                                 |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | \$ 7 176 188           | \$ 6 883 328           | \$ 15 401                       | \$ 14 301              |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 90 353                 | 565 679                | 1 221                           | 1 109                  |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 0                      | 85 000                 | 3 300                           | 4 400                  |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 92 121                 | 34 552                 | 615                             | 399                    |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| Liquidités                                                                                                             | 16 134                 | 26 647                 | 258                             | 203                    |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 453 283                | 150 371                | 1 215                           | 482                    |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 32 460                 | 31 286                 | 60                              | 54                     |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 2 696                  | 1 818                  | 129                             | 5                      |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 3 500 950              | 3 097 197              | 8 481                           | 11 140                 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 5 381                  | 10 486                 | 0                               | 0                      |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 23 392                 | 17 620                 | 491                             | 495                    |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>11 392 958</b>      | <b>10 903 984</b>      | <b>31 171</b>                   | <b>32 588</b>          |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                        |                        |                                 |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                        |                        |                                 |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (54 881)               | (67 725)               | (300)                           | (334)                  |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | (222 264)              | (225 793)              | (1 431)                         | (1 402)                |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (76 584)               | (44 881)               | (248)                           | (231)                  |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (4 331 978)            | (4 348 228)            | (15 393)                        | (18 303)               |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | (9 265)                | (6 390)                | 0                               | 0                      |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (3 413)                | (3 323)                | (7)                             | (7)                    |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | (113 278)              | 0                      | 0                               | 0                      |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | (65)                   | (55)                   | 0                               | 0                      |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (25 796)               | (10 295)               | (422)                           | (406)                  |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | (23 592)               | (27 057)               | 0                               | 0                      |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                      | 0                      | 0                               | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(4 861 116)</b>     | <b>(4 733 747)</b>     | <b>(17 801)</b>                 | <b>(20 683)</b>        |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>\$ 6 531 842</b>    | <b>\$ 6 170 237</b>    | <b>\$ 13 370</b>                | <b>\$ 11 905</b>       |

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

| Fonds Strategic Income Fund |                     | Fonds Total Return Bond Fund |                     | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |                     | Fonds UK Corporate Bond Fund |                     |
|-----------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|--------------------------------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|
| Au 30 juin 2026             | Au 31 décembre 2025 | Au 30 juin 2026              | Au 31 décembre 2025 | Au 30 juin 2026                                  | Au 31 décembre 2025 | Au 30 juin 2026              | Au 31 décembre 2025 |
| \$ 3 492 811                | \$ 3 117 224        | \$ 5 627 003                 | \$ 5 583 587        | \$ 138 783                                       | \$ 109 549          | £ 258 429                    | £ 240 014           |
| 199 782                     | 167 557             | 135 962                      | 311 537             | 10 935                                           | 10 594              | 4 168                        | 4 166               |
| 115 200                     | 3 800               | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 2 400                        | 0                   |
| 0                           | 0                   | 0                            | 0                   | 400                                              | 0                   | 0                            | 0                   |
| 73 168                      | 62 447              | 106 926                      | 73 251              | 8 563                                            | 6 493               | 2 708                        | 1 375               |
| 212                         | 177                 | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 53                           | 44                  |
| 11 768                      | 7 894               | 11 999                       | 13 010              | 2 428                                            | 3 152               | 1 700                        | 1 710               |
| 80 939                      | 31 586              | 111 331                      | 106 498             | 21 208                                           | 11 195              | 6 602                        | 6 404               |
| 15 889                      | 12 485              | 42 316                       | 40 850              | 612                                              | 341                 | 3 868                        | 3 264               |
| 3 772                       | 10                  | 580                          | 564                 | 467                                              | 32                  | 1 677                        | 0                   |
| 1 088 615                   | 1 565 629           | 1 386 945                    | 2 445 970           | 35 018                                           | 56 972              | 49 666                       | 27 009              |
| 9 131                       | 5 798               | 4 902                        | 2 973               | 205                                              | 20                  | 52                           | 25                  |
| 2 132                       | 2 384               | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 0                            | 0                   |
| 34 042                      | 29 759              | 50 614                       | 37 362              | 10 030                                           | 5 822               | 5 471                        | 4 033               |
| 0                           | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 0                            | 0                   |
| 5 127 461                   | 5 006 750           | 7 478 578                    | 8 615 602           | 228 649                                          | 204 170             | 336 794                      | 288 044             |
| (95 405)                    | (41 811)            | (51 418)                     | (39 222)            | (6 773)                                          | (3 858)             | (2 136)                      | (1 483)             |
| (10 533)                    | (8 571)             | (1 198)                      | (1 213)             | (4 017)                                          | (2 735)             | 0                            | 0                   |
| (67 947)                    | (450)               | (15 063)                     | (2 543)             | (18)                                             | 0                   | (700)                        | (1)                 |
| (2 137 515)                 | (2 522 036)         | (2 988 610)                  | (4 068 600)         | (38 567)                                         | (83 679)            | (96 042)                     | (59 269)            |
| (1 615)                     | (1 780)             | (1 145)                      | (3 401)             | (5)                                              | 0                   | (2 631)                      | (136)               |
| (2 993)                     | (2 553)             | (2 371)                      | (2 607)             | (150)                                            | (100)               | (50)                         | (50)                |
| 0                           | 0                   | (76 043)                     | (505)               | (1 104)                                          | 0                   | (810)                        | 0                   |
| 0                           | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 0                            | 0                   |
| (202)                       | (34)                | (180)                        | (158)               | 0                                                | 0                   | (7)                          | (1)                 |
| 0                           | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 0                            | 0                   |
| (4)                         | (16)                | (99)                         | (85)                | 0                                                | 0                   | (2 068)                      | (1 700)             |
| (40 260)                    | (31 213)            | (81 330)                     | (65 755)            | (11 148)                                         | (6 736)             | (5 989)                      | (3 295)             |
| (11 540)                    | (26 024)            | (37 317)                     | (23 194)            | (2 342)                                          | (1 042)             | 0                            | 0                   |
| 0                           | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                | 0                   | 0                            | 0                   |
| (2 368 014)                 | (2 634 488)         | (3 254 774)                  | (4 207 283)         | (64 124)                                         | (98 150)            | (110 433)                    | (65 935)            |
| \$ 2 759 447                | \$ 2 372 262        | \$ 4 223 804                 | \$ 4 408 319        | \$ 164 525                                       | \$ 106 020          | £ 226 361                    | £ 222 109           |

| (Montants en milliers)                                                                                                 | Fonds UK Long Term Corporate<br>Bond Fund |                        | Fonds US High Yield<br>Bond Fund |                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|
|                                                                                                                        | Au<br>30 juin 2026                        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026               | Au<br>31 décembre 2025 |
| <b>Actif à court terme :</b>                                                                                           |                                           |                        |                                  |                        |
| Actif financier à la juste valeur par résultat :                                                                       |                                           |                        |                                  |                        |
| Valeurs mobilières                                                                                                     | £ 31 331                                  | £ 32 040               | \$ 1 379 033                     | \$ 1 503 433           |
| Fonds d'investissement                                                                                                 | 0                                         | 0                      | 48 245                           | 54 131                 |
| Contrats de mise en pension                                                                                            | 0                                         | 0                      | 78 800                           | 175 900                |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit                                                                               | 0                                         | 0                      | 0                                | 0                      |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 430                                       | 318                    | 9 898                            | 7 587                  |
| Autres actifs financiers                                                                                               | 425                                       | 351                    | 0                                | 0                      |
| Liquidités                                                                                                             | 259                                       | 370                    | 2 161                            | 464                    |
| Dépôts auprès de contreparties                                                                                         | 867                                       | 898                    | 31 678                           | 23 115                 |
| Produits à recevoir                                                                                                    | 441                                       | 429                    | 23 115                           | 24 400                 |
| À recevoir sur investissements vendus                                                                                  | 77                                        | 1                      | 4 472                            | 1 364                  |
| À recevoir sur investissements vendus TBA                                                                              | 8 342                                     | 15 090                 | 0                                | 0                      |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues                                                                                | 0                                         | 0                      | 77                               | 3 101                  |
| À recevoir du Fonds affilié                                                                                            | 0                                         | 0                      | 0                                | 0                      |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                     | 801                                       | 726                    | 10 439                           | 17 037                 |
| Autres actifs                                                                                                          | 0                                         | 0                      | 200                              | 161                    |
| <b>Total de l'actif à court terme</b>                                                                                  | <b>42 973</b>                             | <b>50 223</b>          | <b>1 588 118</b>                 | <b>1 810 693</b>       |
| <b>Passif à court terme :</b>                                                                                          |                                           |                        |                                  |                        |
| Passif financier à la juste valeur par résultat :                                                                      |                                           |                        |                                  |                        |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (411)                                     | (203)                  | (12 850)                         | (1 588)                |
| Juste valeur des titres vendus à découvert                                                                             | 0                                         | 0                      | 0                                | 0                      |
| À payer sur investissements achetés                                                                                    | (172)                                     | 0                      | (17 522)                         | (32 271)               |
| À payer sur investissements achetés TBA                                                                                | (16 864)                                  | (23 309)               | 0                                | 0                      |
| À payer sur actions du Fonds rachetées                                                                                 | 0                                         | 0                      | (9 752)                          | (478)                  |
| Frais de gestion à payer                                                                                               | (9)                                       | (10)                   | (902)                            | (1 007)                |
| À payer sur contrats de prise en pension                                                                               | 0                                         | 0                      | (8 532)                          | (18 942)               |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos                                                    | 0                                         | 0                      | 0                                | 0                      |
| Charges à payer                                                                                                        | 0                                         | 0                      | (64)                             | (74)                   |
| Découvert bancaire                                                                                                     | 0                                         | 0                      | 0                                | 0                      |
| Dividendes à payer                                                                                                     | (16)                                      | (153)                  | (60)                             | (63)                   |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés                                                        | (774)                                     | (704)                  | (14 662)                         | (14 809)               |
| Dépôts des contreparties                                                                                               | 0                                         | 0                      | 0                                | (5 780)                |
| Autres passifs                                                                                                         | 0                                         | 0                      | 0                                | 0                      |
| <b>Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>(18 246)</b>                           | <b>(24 379)</b>        | <b>(64 344)</b>                  | <b>(75 012)</b>        |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                    | <b>£ 24 727</b>                           | <b>£ 25 844</b>        | <b>\$ 1 523 774</b>              | <b>\$ 1 735 681</b>    |

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

\* Le Total Société au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés et les soldes au nom de la Société. Veuillez vous reporter à la note 10 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

| Fonds US Investment Grade<br>Corporate Bond Fund |                        | Fonds US Short-Term Fund |                        | Total Société*     |                        |
|--------------------------------------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|--------------------|------------------------|
| Au<br>30 juin 2026                               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026       | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 |
| \$ 457 892                                       | \$ 355 483             | \$ 4 216 595             | \$ 2 909 513           | \$ 339 280 762     | \$ 304 169 732         |
| 10 833                                           | 10 794                 | 352 670                  | 271 070                | 8 433 663          | 8 017 973              |
| 0                                                | 29 400                 | 0                        | 2 600                  | 9 658 645          | 30 955 267             |
| 0                                                | 0                      | 10 197                   | 0                      | 10 597             | 0                      |
| 9 842                                            | 7 921                  | 20 421                   | 13 206                 | 8 601 950          | 6 934 673              |
| 162                                              | 162                    | 0                        | 0                      | 266 563            | 243 404                |
| 2 170                                            | 925                    | 7 732                    | 3 923                  | 838 414            | 2 425 067              |
| 14 390                                           | 13 054                 | 24 308                   | 20 604                 | 7 862 650          | 5 674 851              |
| 5 314                                            | 4 486                  | 21 734                   | 16 293                 | 2 684 782          | 2 375 099              |
| 320                                              | 3                      | 1 600                    | 755 650                | 4 001 950          | 4 813 604              |
| 11 870                                           | 15 763                 | 207 435                  | 46 839                 | 118 724 791        | 152 968 857            |
| 113                                              | 312                    | 3 416                    | 2 082                  | 458 197            | 465 682                |
| 0                                                | 0                      | 0                        | 0                      | 4 198              | 3 514                  |
| 2 545                                            | 2 316                  | 5 350                    | 2 818                  | 5 580 682          | 4 289 542              |
| 0                                                | 0                      | 0                        | 0                      | 845                | 627                    |
| 515 451                                          | 440 619                | 4 871 458                | 4 044 598              | 506 408 689        | 523 337 892            |
| (5 654)                                          | (3 082)                | (17 065)                 | (6 381)                | (7 012 260)        | (4 435 315)            |
| 0                                                | 0                      | 0                        | 0                      | (4 870 031)        | (2 808 691)            |
| 0                                                | 0                      | (884 965)                | (1 111 187)            | (8 700 732)        | (11 691 505)           |
| (53 909)                                         | (33 638)               | (340 448)                | (104 400)              | (200 606 707)      | (238 925 319)          |
| (83)                                             | (116)                  | (967)                    | (673)                  | (329 805)          | (255 851)              |
| (240)                                            | (226)                  | (1 047)                  | (897)                  | (190 571)          | (177 578)              |
| (1 925)                                          | (2 670)                | (73 129)                 | 0                      | (8 926 106)        | (8 012 178)            |
| 0                                                | 0                      | (7 568)                  | (109 412)              | (115 360)          | (115 412)              |
| 0                                                | 0                      | (8)                      | (2)                    | (25 787)           | (18 322)               |
| 0                                                | 0                      | 0                        | 0                      | (13 769)           | 0                      |
| (506)                                            | (352)                  | 0                        | (2)                    | (36 336)           | (41 725)               |
| (6 442)                                          | (5 189)                | (3 219)                  | (324)                  | (7 706 386)        | (7 444 711)            |
| (1 183)                                          | (2 054)                | (7 202)                  | (9 895)                | (1 121 300)        | (1 733 366)            |
| 0                                                | 0                      | 0                        | 0                      | (43)               | (15)                   |
| (69 942)                                         | (47 327)               | (1 335 618)              | (1 343 173)            | (239 655 193)      | (275 659 988)          |
| \$ 445 509                                       | \$ 393 292             | \$ 3 535 840             | \$ 2 701 425           | \$ 266 753 496     | \$ 247 677 904         |

## Compte de résultat

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds PIMCO Asia High<br>Yield Bond Fund |                                  | Fonds Asia Strategic<br>Interest Bond Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close le<br>30 juin 2026         | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026           | Période close le<br>30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                          |                                  |                                            |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 38 491                                | \$ 67 901                        | \$ 8 615                                   | \$ 7 621                         |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                        | 0                                | 0                                          | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | 8 563                                    | (38 955)                         | 338                                        | (1 573)                          |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 3 127                                    | 20 413                           | (484)                                      | 605                              |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | (26)                                     | (25)                             | (24)                                       | (9)                              |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (7 134)                                  | 47 503                           | (3 072)                                    | 4 137                            |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | (10 502)                                 | 16 108                           | (1 952)                                    | 2 389                            |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (62)                                     | 163                              | (43)                                       | 23                               |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 32 457                                   | 113 108                          | 3 378                                      | 13 193                           |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                          |                                  |                                            |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (4 234)                                  | (5 966)                          | (1 076)                                    | (766)                            |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | (37)                                     | (63)                             | 0                                          | 0                                |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | (88)                                     | (88)                             | 0                                          | 0                                |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                        | 0                                | 0                                          | 0                                |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                        | (1)                              | 0                                          | 0                                |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (4 359)                                  | (6 118)                          | (1 076)                                    | (766)                            |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 8                                        | 8                                | 2                                          | 2                                |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (4 351)                                  | (6 110)                          | (1 074)                                    | (764)                            |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | 28 106                                   | 106 998                          | 2 304                                      | 12 429                           |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                          |                                  |                                            |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (440)                                    | (604)                            | (6)                                        | (7)                              |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | (50)                                     | (115)                            | 0                                          | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (13 040)                                 | (15 035)                         | (4 411)                                    | (3 722)                          |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | 540                                      | (9)                              | 219                                        | (147)                            |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (12 990)                                 | (15 763)                         | (4 198)                                    | (3 876)                          |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | 15 116                                   | 91 235                           | (1 894)                                    | 8 553                            |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | (132)                                    | 37                               | (23)                                       | 1                                |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | (33)                                     | 0                                | (9)                                        | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | 14 951                                   | 91 272                           | (1 926)                                    | 8 554                            |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | \$ 14 951                                | \$ 91 272                        | \$ (1 926)                                 | \$ 8 554                         |

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

| Fonds PIMCO Balanced<br>Income and Growth Fund |                                  | Fonds PIMCO Capital<br>Securities Fund |                                  | Fonds PIMCO Climate<br>Bond Fund |                                  | Fonds Commodity Real<br>Return Fund |                                  |
|------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|
| Période close le<br>30 juin 2026               | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026       | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026 | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026    | Période close le<br>30 juin 2025 |
| \$ 192 735                                     | \$ 40 599                        | \$ 171 383                             | \$ 149 430                       | \$ 7 232                         | \$ 5 717                         | \$ 39 033                           | \$ 17 252                        |
| 0                                              | 0                                | 0                                      | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| 505 707                                        | 32 480                           | 42 603                                 | 42 702                           | 1 396                            | (2 161)                          | (4 252)                             | (12 714)                         |
| 38 669                                         | 38 879                           | (36 261)                               | (16 002)                         | (1 934)                          | 4 080                            | 156 796                             | 35 531                           |
| 1 346                                          | 104                              | (11 072)                               | (864)                            | 189                              | 21                               | (201)                               | (151)                            |
| 369 865                                        | 142 436                          | (139 874)                              | 326 455                          | (9 349)                          | 31 356                           | (23 905)                            | 65 486                           |
| (15 024)                                       | 37 794                           | 33 596                                 | 8 662                            | (2 303)                          | 1 795                            | (59 616)                            | (27 597)                         |
| (209)                                          | 82                               | (15)                                   | (1 915)                          | (145)                            | 255                              | (64)                                | (93)                             |
| 1 093 089                                      | 292 374                          | 60 360                                 | 508 468                          | (4 914)                          | 41 063                           | 107 791                             | 77 714                           |
| (84 530)                                       | (13 876)                         | (30 341)                               | (24 977)                         | (932)                            | (800)                            | (5 480)                             | (3 691)                          |
| (151)                                          | (23)                             | (409)                                  | (428)                            | 0                                | 0                                | (59)                                | (33)                             |
| (2 141)                                        | (201)                            | (670)                                  | (592)                            | (1)                              | (3)                              | 0                                   | 0                                |
| (13 322)                                       | (33)                             | (164)                                  | (147)                            | 0                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| (3)                                            | (1)                              | (2)                                    | (2)                              | 0                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| (100 147)                                      | (14 134)                         | (31 586)                               | (26 146)                         | (933)                            | (803)                            | (5 539)                             | (3 724)                          |
| 0                                              | 0                                | 0                                      | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| (100 147)                                      | (14 134)                         | (31 586)                               | (26 146)                         | (933)                            | (803)                            | (5 539)                             | (3 724)                          |
| 992 942                                        | 278 240                          | 28 774                                 | 482 322                          | (5 847)                          | 40 260                           | 102 252                             | 73 990                           |
| (540)                                          | (313)                            | (5 568)                                | (7 327)                          | (18)                             | (12)                             | (5 004)                             | (5 718)                          |
| 0                                              | 0                                | 0                                      | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| (356 529)                                      | (42 589)                         | (56 655)                               | (44 493)                         | (2 050)                          | (2 120)                          | (234)                               | (56)                             |
| 39 541                                         | (2 047)                          | (251)                                  | (225)                            | (57)                             | 56                               | 0                                   | (28)                             |
| (317 528)                                      | (44 949)                         | (62 474)                               | (52 045)                         | (2 125)                          | (2 076)                          | (5 238)                             | (5 802)                          |
| 675 414                                        | 233 291                          | (33 700)                               | 430 277                          | (7 972)                          | 38 184                           | 97 014                              | 68 188                           |
| (13 425)                                       | (2 976)                          | (236)                                  | (403)                            | 2                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| (198)                                          | 0                                | 0                                      | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                   | 0                                |
| 661 791                                        | 230 315                          | (33 936)                               | 429 874                          | (7 970)                          | 38 184                           | 97 014                              | 68 188                           |
| \$ 661 791                                     | \$ 230 315                       | \$ (33 936)                            | \$ 429 874                       | \$ (7 970)                       | \$ 38 184                        | \$ 97 014                           | \$ 68 188                        |



## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds PIMCO Credit<br>Opportunities Bond Fund |                                  | Fonds Diversified<br>Income Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close<br>le 30 juin 2026              | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                               |                                  |                                  |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 7 166                                      | \$ 5 468                         | \$ 291 569                       | \$ 262 164                       |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                             | 0                                | 0                                | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | (1 520)                                       | 692                              | 25 119                           | 22 274                           |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | (1 714)                                       | 2 837                            | (62 161)                         | 109 341                          |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | (66)                                          | (124)                            | (440)                            | (4 188)                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (5 439)                                       | 5 589                            | (98 170)                         | 406 219                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | (433)                                         | 3 230                            | (16 432)                         | 97 008                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (36)                                          | (9)                              | (5 564)                          | 1 386                            |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | (2 042)                                       | 17 683                           | 133 921                          | 894 204                          |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                               |                                  |                                  |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (827)                                         | (673)                            | (60 753)                         | (52 992)                         |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                             | 0                                | (168)                            | (159)                            |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                             | 0                                | (574)                            | (432)                            |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                             | 0                                | (15 673)                         | (8 953)                          |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                             | 0                                | (4)                              | (4)                              |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (827)                                         | (673)                            | (77 172)                         | (62 540)                         |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 1                                             | 1                                | 430                              | 469                              |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (826)                                         | (672)                            | (76 742)                         | (62 071)                         |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | (2 868)                                       | 17 011                           | 57 179                           | 832 133                          |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                               |                                  |                                  |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (49)                                          | (40)                             | (2 832)                          | (3 070)                          |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                             | 0                                | 0                                | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | 0                                             | 0                                | (205 973)                        | (147 005)                        |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | 0                                             | 0                                | 3 735                            | (3 644)                          |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (49)                                          | (40)                             | (205 070)                        | (153 719)                        |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | (2 917)                                       | 16 971                           | (147 891)                        | 678 414                          |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | (1)                                           | (9)                              | 17                               | (23)                             |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | (6)                                           | 0                                | (43)                             | (299)                            |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | (2 924)                                       | 16 962                           | (147 917)                        | 678 092                          |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | \$ (2 924)                                    | \$ 16 962                        | \$ (147 917)                     | \$ 678 092                       |

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

| Fonds Diversified Income Duration<br>Hedged Fund |                                  | Fonds Diversified Income<br>ESG Fund |                                  | Fonds Dynamic<br>Bond Fund       |                                  | Fonds Emerging Local<br>Bond Fund |                                  |
|--------------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026                 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026     | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026  | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| \$ 12 028                                        | \$ 8 906                         | \$ 1 256                             | \$ 1 325                         | \$ 114 581                       | \$ 92 207                        | \$ 285 979                        | \$ 148 981                       |
| 0                                                | 0                                | 0                                    | 0                                | 85                               | 0                                | 0                                 | 0                                |
| 1 804                                            | (565)                            | 490                                  | 129                              | 1 099                            | 34 697                           | 103 446                           | (27 741)                         |
| 3 106                                            | 17 060                           | (486)                                | 1 934                            | 84 614                           | 148 815                          | (35 907)                          | 43 663                           |
| (91)                                             | (71)                             | (3)                                  | (11)                             | 1 820                            | 505                              | 11 698                            | (8 413)                          |
| (5 558)                                          | 13 618                           | (950)                                | 2 182                            | (48 065)                         | 201 906                          | (164 934)                         | 302 961                          |
| (4 766)                                          | (4 973)                          | (489)                                | 1 498                            | (119 064)                        | 15 953                           | (73 558)                          | 24 289                           |
| (2)                                              | 83                               | (8)                                  | 17                               | (1 684)                          | 622                              | 19 677                            | (11 629)                         |
| 6 521                                            | 34 058                           | (190)                                | 7 074                            | 33 386                           | 494 705                          | 146 401                           | 472 111                          |
| (2 186)                                          | (1 719)                          | (174)                                | (180)                            | (21 107)                         | (18 200)                         | (31 796)                          | (15 841)                         |
| (11)                                             | (10)                             | 0                                    | 0                                | (70)                             | (73)                             | (50)                              | (11)                             |
| 0                                                | 0                                | 0                                    | 0                                | (44)                             | (45)                             | 0                                 | 0                                |
| 0                                                | 0                                | 0                                    | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                 | 0                                |
| 0                                                | 0                                | 0                                    | (1)                              | (2)                              | (2)                              | (3)                               | (1)                              |
| (2 197)                                          | (1 729)                          | (174)                                | (181)                            | (21 223)                         | (18 320)                         | (31 849)                          | (15 853)                         |
| 0                                                | 0                                | 0                                    | 0                                | 233                              | 232                              | 0                                 | 0                                |
| (2 197)                                          | (1 729)                          | (174)                                | (181)                            | (20 990)                         | (18 088)                         | (31 849)                          | (15 853)                         |
| 4 324                                            | 32 329                           | (364)                                | 6 893                            | 12 396                           | 476 617                          | 114 552                           | 456 258                          |
| (61)                                             | (58)                             | (5)                                  | (3)                              | (720)                            | (908)                            | (19 009)                          | (9 651)                          |
| 0                                                | 0                                | 0                                    | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                 | 0                                |
| (2 815)                                          | (2 475)                          | 0                                    | 0                                | (1 244)                          | (3 151)                          | (34 016)                          | (15 308)                         |
| 118                                              | 47                               | 0                                    | 0                                | (95)                             | (73)                             | 2 318                             | 1 188                            |
| (2 758)                                          | (2 486)                          | (5)                                  | (3)                              | (2 059)                          | (4 132)                          | (50 707)                          | (23 771)                         |
| 1 566                                            | 29 843                           | (369)                                | 6 890                            | 10 337                           | 472 485                          | 63 845                            | 432 487                          |
| (3)                                              | (1)                              | 1                                    | (2)                              | (7)                              | (204)                            | (2 353)                           | (2 584)                          |
| (2)                                              | 0                                | 0                                    | 0                                | (49)                             | 0                                | (416)                             | (681)                            |
| 1 561                                            | 29 842                           | (368)                                | 6 888                            | 10 281                           | 472 281                          | 61 076                            | 429 222                          |
| \$ 1 561                                         | \$ 29 842                        | \$ (368)                             | \$ 6 888                         | \$ 10 281                        | \$ 472 281                       | \$ 61 076                         | \$ 429 222                       |

## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds Emerging Local<br>Bond ESG Fund |                                  | Fonds Emerging Markets<br>Bond Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close le<br>30 juin 2026      | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026    | Période close le<br>30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                       |                                  |                                     |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 8 206                              | \$ 5 304                         | \$ 266 369                          | \$ 187 382                       |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                     | 0                                | 0                                   | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | 947                                   | (1 629)                          | 33 405                              | (51 875)                         |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | (1 569)                               | 1 987                            | (87 953)                            | 79 287                           |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | 374                                   | 8                                | 4 948                               | (1 717)                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (3 049)                               | 11 021                           | 8 463                               | 188 881                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | (1 871)                               | 732                              | (67 729)                            | 78 995                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | 750                                   | (477)                            | 3 054                               | (2 004)                          |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 3 788                                 | 16 946                           | 160 557                             | 478 949                          |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                       |                                  |                                     |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (838)                                 | (512)                            | (30 891)                            | (19 744)                         |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                     | 0                                | (23)                                | (16)                             |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                     | 0                                | (63)                                | (64)                             |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                     | 0                                | (146)                               | (42)                             |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                     | (3)                              | (4)                                 | (2)                              |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (838)                                 | (515)                            | (31 127)                            | (19 868)                         |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 0                                     | 0                                | 0                                   | 0                                |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (838)                                 | (515)                            | (31 127)                            | (19 868)                         |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | <b>2 950</b>                          | <b>16 431</b>                    | <b>129 430</b>                      | <b>459 081</b>                   |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                       |                                  |                                     |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (529)                                 | (326)                            | (6 547)                             | (7 820)                          |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                     | 0                                | 0                                   | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (43)                                  | (3)                              | (53 000)                            | (37 979)                         |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | 5                                     | 0                                | 2 817                               | 1 372                            |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (567)                                 | (329)                            | (56 730)                            | (44 427)                         |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>2 383</b>                          | <b>16 102</b>                    | <b>72 700</b>                       | <b>414 654</b>                   |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | (93)                                  | (80)                             | 83                                  | (266)                            |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | (25)                                  | (15)                             | (142)                               | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>2 265</b>                          | <b>16 007</b>                    | <b>72 641</b>                       | <b>414 388</b>                   |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | <b>\$ 2 265</b>                       | <b>\$ 16 007</b>                 | <b>\$ 72 641</b>                    | <b>\$ 414 388</b>                |

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

| Fonds Emerging Markets<br>Bond ESG Fund |                                  | Fonds Emerging Markets<br>Corporate Bond Fund |                                  | Fonds PIMCO Emerging Markets<br>Opportunities Fund |                                  | Fonds Emerging Markets Short-Term<br>Local Currency Fund |                                  |
|-----------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026        | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026              | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026                   | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026                         | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| \$ 129 697                              | \$ 114 660                       | \$ 5 732                                      | \$ 5 286                         | \$ 46 116                                          | \$ 17 465                        | \$ 749                                                   | \$ 561                           |
| 0                                       | 0                                | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| 14 349                                  | (11 959)                         | 441                                           | (1 359)                          | 9 072                                              | 1 782                            | 145                                                      | 1                                |
| (35 425)                                | 69 840                           | (1 064)                                       | 8 338                            | (19 233)                                           | 10 008                           | 6                                                        | 397                              |
| 1 666                                   | (1 677)                          | 26                                            | 8                                | (2 568)                                            | (713)                            | (13)                                                     | 7                                |
| (31 744)                                | 118 240                          | (1 912)                                       | 4 338                            | 20 613                                             | 18 937                           | 33                                                       | 644                              |
| (48 593)                                | 81 710                           | (4 651)                                       | 6 838                            | (21 254)                                           | 3 448                            | (11)                                                     | 89                               |
| 2 565                                   | (1 963)                          | 14                                            | 7                                | 1 591                                              | (710)                            | 3                                                        | 10                               |
| 32 515                                  | 368 851                          | (1 414)                                       | 23 456                           | 34 337                                             | 50 217                           | 912                                                      | 1 709                            |
| (14 491)                                | (11 510)                         | (862)                                         | (831)                            | (4 408)                                            | (933)                            | (138)                                                    | (119)                            |
| (3)                                     | (5)                              | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| (5)                                     | (6)                              | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| 0                                       | 0                                | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| (1)                                     | (1)                              | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| (14 500)                                | (11 522)                         | (862)                                         | (831)                            | (4 408)                                            | (933)                            | (138)                                                    | (119)                            |
| 0                                       | 0                                | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 2                                                        | 2                                |
| (14 500)                                | (11 522)                         | (862)                                         | (831)                            | (4 408)                                            | (933)                            | (136)                                                    | (117)                            |
| 18 015                                  | 357 329                          | (2 276)                                       | 22 625                           | 29 929                                             | 49 284                           | 776                                                      | 1 592                            |
| (5 500)                                 | (6 722)                          | (30)                                          | (117)                            | (592)                                              | (809)                            | 0                                                        | (8)                              |
| 0                                       | 0                                | 0                                             | 0                                | 0                                                  | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| (18 553)                                | (17 628)                         | 0                                             | 0                                | (930)                                              | (87)                             | 0                                                        | 0                                |
| 351                                     | 546                              | 0                                             | 0                                | 483                                                | 10                               | 0                                                        | 0                                |
| (23 702)                                | (23 804)                         | (30)                                          | (117)                            | (1 039)                                            | (886)                            | 0                                                        | (8)                              |
| (5 687)                                 | 333 525                          | (2 306)                                       | 22 508                           | 28 890                                             | 48 398                           | 776                                                      | 1 584                            |
| (202)                                   | 61                               | (5)                                           | 0                                | (425)                                              | (92)                             | (2)                                                      | (7)                              |
| (68)                                    | 0                                | (3)                                           | 0                                | (166)                                              | 0                                | 0                                                        | 0                                |
| (5 957)                                 | 333 586                          | (2 314)                                       | 22 508                           | 28 299                                             | 48 306                           | 774                                                      | 1 577                            |
| \$ (5 957)                              | \$ 333 586                       | \$ (2 314)                                    | \$ 22 508                        | \$ 28 299                                          | \$ 48 306                        | \$ 774                                                   | \$ 1 577                         |

## Compte de résultat (suite)

|                                                                                                                                                                                                                               | Fonds PIMCO ESG<br>Income Fund   |                                  | Fonds Euro<br>Bond Fund          |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close le<br>30 juin 2026 | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026 | Période close le<br>30 juin 2025 |
| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        |                                  |                                  |                                  |                                  |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                  |                                  |                                  |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 15 297                        | \$ 11 174                        | € 33 910                         | € 25 362                         |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | (250)                            | 420                              | (13 124)                         | (18 823)                         |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 7 411                            | 22 575                           | (5 073)                          | 2 835                            |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | (59)                             | 148                              | 1 921                            | 17 228                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (8 367)                          | 18 300                           | 19 780                           | (36 448)                         |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | (24 768)                         | 12 957                           | (5 505)                          | 22 246                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (774)                            | 100                              | (7 502)                          | 11 371                           |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | (11 510)                         | 65 674                           | 24 407                           | 23 771                           |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                  |                                  |                                  |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (2 011)                          | (1 424)                          | (4 257)                          | (4 206)                          |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                | 0                                | (42)                             | (40)                             |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | (20)                             | (8)                              | 0                                | 0                                |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                | 0                                | (1)                              | (1)                              |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (2 031)                          | (1 432)                          | (4 300)                          | (4 247)                          |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 0                                | 0                                | 32                               | 97                               |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (2 031)                          | (1 432)                          | (4 268)                          | (4 150)                          |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | (13 541)                         | 64 242                           | 20 139                           | 19 621                           |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                  |                                  |                                  |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (126)                            | (48)                             | (3 030)                          | (103)                            |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (5 045)                          | (4 613)                          | (666)                            | (570)                            |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | (18)                             | 9                                | (6)                              | (4)                              |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (5 189)                          | (4 652)                          | (3 702)                          | (677)                            |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | (18 730)                         | 59 590                           | 16 437                           | 18 944                           |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | (27)                             | (3)                              | (27)                             | (33)                             |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | (5)                              | 0                                | 0                                | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | (18 762)                         | 59 587                           | 16 410                           | 18 911                           |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | \$ (18 762)                      | \$ 59 587                        | € 16 410                         | € 18 911                         |

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

| Fonds Euro<br>Credit Fund        |                                  | Fonds Euro Income<br>Bond Fund   |                                  | Fonds Euro Long<br>Average Duration Fund |                                  | Fonds Euro<br>Short-Term Fund    |                                  |
|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026         | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| € 9 014                          | € 8 012                          | € 48 083                         | € 36 007                         | € 33 761                                 | € 25 402                         | € 6 584                          | € 4 352                          |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| 211                              | (4 097)                          | 9 729                            | (71 920)                         | (26 819)                                 | (21 897)                         | (374)                            | 458                              |
| (7 805)                          | 2 834                            | (25 610)                         | 33 786                           | (1 386)                                  | (11 038)                         | (108)                            | 871                              |
| 721                              | 4 585                            | 14 433                           | 57 417                           | 1 671                                    | 10 864                           | (14)                             | (39)                             |
| 637                              | (5 685)                          | 46 353                           | (63 670)                         | 34 412                                   | (63 633)                         | (155)                            | (1 521)                          |
| 7 036                            | (224)                            | 7 088                            | 17 546                           | 1 999                                    | 10 589                           | (1 036)                          | 697                              |
| (3 029)                          | 4 216                            | (60 448)                         | 47 009                           | (5 673)                                  | 5 828                            | 29                               | (58)                             |
| 6 785                            | 9 641                            | 39 628                           | 56 175                           | 37 965                                   | (43 885)                         | 4 926                            | 4 760                            |
| (1 262)                          | (1 138)                          | (13 065)                         | (9 551)                          | (2 835)                                  | (2 754)                          | (1 139)                          | (792)                            |
| 0                                | 0                                | (71)                             | (47)                             | 0                                        | 0                                | (5)                              | (16)                             |
| 0                                | 0                                | (4)                              | (4)                              | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| 0                                | 0                                | (161)                            | (138)                            | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| 0                                | 0                                | (1)                              | (1)                              | (1)                                      | (1)                              | 0                                | 0                                |
| (1 262)                          | (1 138)                          | (13 302)                         | (9 741)                          | (2 836)                                  | (2 755)                          | (1 144)                          | (808)                            |
| 0                                | 0                                | 232                              | 145                              | 3                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| (1 262)                          | (1 138)                          | (13 070)                         | (9 596)                          | (2 833)                                  | (2 755)                          | (1 144)                          | (808)                            |
| 5 523                            | 8 503                            | 26 558                           | 46 579                           | 35 132                                   | (46 640)                         | 3 782                            | 3 952                            |
| (49)                             | (59)                             | (274)                            | (365)                            | (6 091)                                  | (3 963)                          | (1)                              | (3)                              |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| (3)                              | (7)                              | (13 886)                         | (10 609)                         | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| 0                                | 0                                | 884                              | 156                              | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| (52)                             | (66)                             | (13 276)                         | (10 818)                         | (6 091)                                  | (3 963)                          | (1)                              | (3)                              |
| 5 471                            | 8 437                            | 13 282                           | 35 761                           | 29 041                                   | (50 603)                         | 3 781                            | 3 949                            |
| 7                                | (6)                              | (30)                             | (16)                             | 0                                        | 4                                | (17)                             | (53)                             |
| (7)                              | 0                                | (73)                             | 0                                | 0                                        | 0                                | 0                                | 0                                |
| 5 471                            | 8 431                            | 13 179                           | 35 745                           | 29 041                                   | (50 599)                         | 3 764                            | 3 896                            |
| € 5 471                          | € 8 431                          | € 13 179                         | € 35 745                         | € 29 041                                 | € (50 599)                       | € 3 764                          | € 3 896                          |

## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds PIMCO European<br>High Yield Bond Fund |                                  | Fonds PIMCO European Short-Term<br>Opportunities Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close<br>le 30 juin 2026             | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026                      | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                              |                                  |                                                       |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | € 14 719                                     | € 11 455                         | € 26 642                                              | € 17 289                         |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                            | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | (452)                                        | 2 597                            | (1 712)                                               | (20 734)                         |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | (2 512)                                      | 1 975                            | (6 929)                                               | 15 851                           |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | 33                                           | (17)                             | 1 281                                                 | 12 253                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | 304                                          | (3 986)                          | 6 455                                                 | (17 352)                         |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | 383                                          | 3 163                            | (6 782)                                               | 11 673                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | 13                                           | (3)                              | (5 219)                                               | 7 526                            |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 12 488                                       | 15 184                           | 13 736                                                | 26 506                           |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                              |                                  |                                                       |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (1 202)                                      | (798)                            | (2 183)                                               | (1 653)                          |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                            | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                            | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                            | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                            | 0                                | (1)                                                   | 0                                |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (1 202)                                      | (798)                            | (2 184)                                               | (1 653)                          |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 27                                           | 34                               | 39                                                    | 87                               |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (1 175)                                      | (764)                            | (2 145)                                               | (1 566)                          |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | 11 313                                       | 14 420                           | 11 591                                                | 24 940                           |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                              |                                  |                                                       |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (143)                                        | (68)                             | (1 624)                                               | (127)                            |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                            | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (63)                                         | (3)                              | 0                                                     | 0                                |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | 13                                           | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (193)                                        | (71)                             | (1 624)                                               | (127)                            |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | 11 120                                       | 14 349                           | 9 967                                                 | 24 813                           |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | 0                                            | 2                                | 4                                                     | 10                               |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | 0                                            | 0                                | 0                                                     | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | 11 120                                       | 14 351                           | 9 971                                                 | 24 823                           |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | € 11 120                                     | € 14 351                         | € 9 971                                               | € 24 823                         |

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

| Fonds Global Advantage Fund      |                                  | Fonds Global Bond Fund           |                                  | Fonds Global Bond ESG Fund       |                                  | Fonds Global Bond Ex-US Fund     |                                  |
|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| \$ 10 955                        | \$ 9 181                         | \$ 391 250                       | \$ 340 415                       | \$ 92 000                        | \$ 91 753                        | \$ 22 694                        | \$ 20 669                        |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| 1 314                            | (2 900)                          | 43 316                           | (157 664)                        | 14 651                           | (30 712)                         | 1 538                            | (5 015)                          |
| 1 671                            | 11 001                           | (255 817)                        | (9 277)                          | 100 636                          | 92 208                           | (21 050)                         | (33 410)                         |
| 113                              | (1 344)                          | (74 719)                         | (49 077)                         | (6 984)                          | (9 162)                          | 1 389                            | (2 599)                          |
| (9 574)                          | 35 218                           | (346 004)                        | 1 165 734                        | (102 369)                        | 310 922                          | (18 272)                         | 75 895                           |
| (6 403)                          | 7 245                            | 241 709                          | (23 420)                         | (119 367)                        | 76 132                           | 24 898                           | (27 463)                         |
| (33)                             | 303                              | (24 326)                         | 6 616                            | (3 465)                          | 2 103                            | (1 289)                          | 562                              |
| (1 957)                          | 58 704                           | (24 591)                         | 1 273 327                        | (24 898)                         | 533 244                          | 9 908                            | 28 639                           |
| (1 549)                          | (1 532)                          | (50 094)                         | (46 770)                         | (9 709)                          | (9 704)                          | (2 472)                          | (2 284)                          |
| 0                                | 0                                | (571)                            | (812)                            | (6)                              | (10)                             | (11)                             | (11)                             |
| 0                                | 0                                | (73)                             | (69)                             | (56)                             | (39)                             | (21)                             | (27)                             |
| 0                                | 0                                | (63)                             | (71)                             | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| 0                                | 0                                | (7)                              | (8)                              | (2)                              | (2)                              | 0                                | 0                                |
| (1 549)                          | (1 532)                          | (50 808)                         | (47 730)                         | (9 773)                          | (9 755)                          | (2 504)                          | (2 322)                          |
| 6                                | 0                                | 1 142                            | 1 109                            | 7                                | 0                                | 8                                | 0                                |
| (1 543)                          | (1 532)                          | (49 666)                         | (46 621)                         | (9 766)                          | (9 755)                          | (2 496)                          | (2 322)                          |
| (3 500)                          | 57 172                           | (74 257)                         | 1 226 706                        | (34 664)                         | 523 489                          | 7 412                            | 26 317                           |
| (1 070)                          | (870)                            | (19 133)                         | (6 049)                          | (10 366)                         | (7 849)                          | (934)                            | (792)                            |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| (1 898)                          | (1 951)                          | (30 053)                         | (27 649)                         | (12 524)                         | (12 686)                         | (2 171)                          | (2 008)                          |
| 1                                | (187)                            | 65                               | 473                              | 153                              | (415)                            | 23                               | (26)                             |
| (2 967)                          | (3 008)                          | (49 121)                         | (33 225)                         | (22 737)                         | (20 950)                         | (3 082)                          | (2 826)                          |
| (6 467)                          | 54 164                           | (123 378)                        | 1 193 481                        | (57 401)                         | 502 539                          | 4 330                            | 23 491                           |
| 19                               | (45)                             | (212)                            | (54)                             | (16)                             | (4)                              | (49)                             | (28)                             |
| 11                               | (4)                              | (502)                            | 0                                | (115)                            | 0                                | (27)                             | 0                                |
| (6 437)                          | 54 115                           | (124 092)                        | 1 193 427                        | (57 532)                         | 502 535                          | 4 254                            | 23 463                           |
| \$ (6 437)                       | \$ 54 115                        | \$ (124 092)                     | \$ 1 193 427                     | \$ (57 532)                      | \$ 502 535                       | \$ 4 254                         | \$ 23 463                        |



## Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)

|                                                                                                                                                                                                                               | Fonds Global Bond<br>Opportunities Fund       | Fonds Global High Yield<br>Bond Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période du<br>10 juin 2026 au<br>30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2026     | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                               |                                      |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 19                                         | \$ 83 779                            | \$ 90 692                        |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                             | 0                                    | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | 0                                             | 3 899                                | (17 531)                         |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 9                                             | (4 115)                              | 59 836                           |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | (10)                                          | (67)                                 | (1 744)                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | 0                                             | (56 945)                             | 114 732                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | 19                                            | (26 371)                             | 42 380                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (1)                                           | 40                                   | 828                              |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 36                                            | 220                                  | 289 193                          |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                               |                                      |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (2)                                           | (9 969)                              | (10 342)                         |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                             | (11)                                 | (11)                             |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                             | (101)                                | (106)                            |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                             | (156)                                | (159)                            |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                             | (1)                                  | (1)                              |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (2)                                           | (10 238)                             | (10 619)                         |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 0                                             | 0                                    | 0                                |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (2)                                           | (10 238)                             | (10 619)                         |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | <b>34</b>                                     | <b>(10 018)</b>                      | <b>278 574</b>                   |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                               |                                      |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | 0                                             | (440)                                | (1 441)                          |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                             | (132)                                | (140)                            |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | 0                                             | (25 795)                             | (29 577)                         |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | 0                                             | (2 589)                              | (104)                            |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | 0                                             | (28 956)                             | (31 262)                         |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>34</b>                                     | <b>(38 974)</b>                      | <b>247 312</b>                   |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | (1)                                           | 0                                    | 0                                |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | 0                                             | 0                                    | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>33</b>                                     | <b>(38 974)</b>                      | <b>247 312</b>                   |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | <b>\$ 33</b>                                  | <b>\$ (38 974)</b>                   | <b>\$ 247 312</b>                |

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

| Fonds Global High Yield<br>Bond ESG Fund |                                  | Fonds Global Investment<br>Grade Credit Fund |                                  | Fonds Global Investment Grade<br>Credit ESG Fund |                                  | Fonds Global Low Duration Real<br>Return Fund |                                  |
|------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026         | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026             | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026                 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026              | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| \$ 778                                   | \$ 324                           | \$ 183 952                                   | \$ 194 626                       | \$ 53 756                                        | \$ 54 565                        | \$ 75 246                                     | \$ 36 517                        |
| 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                | 0                                                | 0                                | 0                                             | 0                                |
| (34)                                     | 6                                | (4 897)                                      | (87 111)                         | 15 509                                           | (853)                            | 1 228                                         | (2 180)                          |
| (156)                                    | (110)                            | (42 641)                                     | 64 312                           | (1 578)                                          | 116 927                          | 13 243                                        | 3 196                            |
| 6                                        | 0                                | (788)                                        | 1 587                            | 519                                              | (1 952)                          | 148                                           | (389)                            |
| (502)                                    | 356                              | (108 102)                                    | 439 653                          | (61 360)                                         | 157 206                          | (63 841)                                      | 140 416                          |
| 257                                      | (54)                             | 11 545                                       | 141 914                          | (53 619)                                         | 53 726                           | (13 896)                                      | 17 542                           |
| (3)                                      | 1                                | (4 271)                                      | 3 215                            | (428)                                            | 1 027                            | (847)                                         | 604                              |
| 346                                      | 523                              | 34 798                                       | 758 196                          | (47 201)                                         | 380 646                          | 11 281                                        | 195 706                          |
| (33)                                     | (31)                             | (25 978)                                     | (28 122)                         | (6 335)                                          | (6 620)                          | (5 658)                                       | (3 919)                          |
| 0                                        | 0                                | (562)                                        | (657)                            | 0                                                | 0                                | (8)                                           | (7)                              |
| 0                                        | 0                                | (495)                                        | (511)                            | (1 359)                                          | (1 696)                          | 0                                             | 0                                |
| 0                                        | 0                                | (559)                                        | (266)                            | 0                                                | 0                                | 0                                             | 0                                |
| (1)                                      | 0                                | (3)                                          | (4)                              | (1)                                              | (1)                              | (1)                                           | (1)                              |
| (34)                                     | (31)                             | (27 597)                                     | (29 560)                         | (7 695)                                          | (8 317)                          | (5 667)                                       | (3 927)                          |
| 0                                        | 0                                | 451                                          | 450                              | 0                                                | 0                                | 0                                             | 0                                |
| (34)                                     | (31)                             | (27 146)                                     | (29 110)                         | (7 695)                                          | (8 317)                          | (5 667)                                       | (3 927)                          |
| 312                                      | 492                              | 7 652                                        | 729 086                          | (54 896)                                         | 372 329                          | 5 614                                         | 191 779                          |
| 0                                        | 0                                | (8 499)                                      | (1 736)                          | (1 519)                                          | (2 131)                          | (18 488)                                      | (14 774)                         |
| 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                | 0                                                | 0                                | 0                                             | 0                                |
| (1)                                      | (1)                              | (52 987)                                     | (52 973)                         | (7 142)                                          | (7 801)                          | (3 408)                                       | (2 082)                          |
| 0                                        | 0                                | (289)                                        | (2 109)                          | (464)                                            | (536)                            | (11)                                          | (52)                             |
| (1)                                      | (1)                              | (61 775)                                     | (56 818)                         | (9 125)                                          | (10 468)                         | (21 907)                                      | (16 908)                         |
| 311                                      | 491                              | (54 123)                                     | 672 268                          | (64 021)                                         | 361 861                          | (16 293)                                      | 174 871                          |
| 0                                        | 0                                | (215)                                        | (475)                            | (78)                                             | (21)                             | 0                                             | (2)                              |
| 0                                        | 0                                | (138)                                        | 0                                | (21)                                             | 0                                | 0                                             | 0                                |
| 311                                      | 491                              | (54 476)                                     | 671 793                          | (64 120)                                         | 361 840                          | (16 293)                                      | 174 869                          |
| \$ 311                                   | \$ 491                           | \$ (54 476)                                  | \$ 671 793                       | \$ (64 120)                                      | \$ 361 840                       | \$ (16 293)                                   | \$ 174 869                       |

## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds Global Real<br>Return Fund |                                  | Fonds Income Fund                |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026 | Période close le<br>30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                  |                                  |                                  |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 81 550                        | \$ 30 684                        | \$ 3 076 941                     | \$ 2 390 363                     |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                | 0                                | 2 033                            | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | (10 603)                         | (112 907)                        | 79 762                           | 482 254                          |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 1 521                            | (22 848)                         | 201 240                          | 1 486 702                        |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | 828                              | 2 800                            | (418 541)                        | 173 515                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (64 423)                         | 353 490                          | (1 453 311)                      | 3 743 985                        |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | 7 218                            | (1 029)                          | (597 907)                        | 363 115                          |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | 212                              | (5 190)                          | (28 553)                         | (25 021)                         |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 16 303                           | 245 000                          | 861 664                          | 8 614 913                        |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                  |                                  |                                  |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (6 373)                          | (6 154)                          | (565 543)                        | (431 317)                        |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | (41)                             | (56)                             | (10 499)                         | (8 329)                          |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | (78)                             | (78)                             | (40 928)                         | (27 752)                         |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                | 0                                | (2 498)                          | (2 101)                          |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | (1)                              | (1)                              | (51)                             | (45)                             |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (6 493)                          | (6 289)                          | (619 519)                        | (469 544)                        |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 5                                | 0                                | 506                              | 505                              |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (6 488)                          | (6 289)                          | (619 013)                        | (469 039)                        |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | 9 815                            | 238 711                          | 242 651                          | 8 145 874                        |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                  |                                  |                                  |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (20 047)                         | (24 292)                         | (8 907)                          | (13 649)                         |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (4 930)                          | (4 240)                          | (2 015 315)                      | (1 551 393)                      |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | (4)                              | (512)                            | 2 814                            | 5 040                            |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (24 981)                         | (29 044)                         | (2 021 408)                      | (1 560 002)                      |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | (15 166)                         | 209 667                          | (1 778 757)                      | 6 585 872                        |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | 0                                | 0                                | (3 578)                          | 1 422                            |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | 0                                | 0                                | (4 683)                          | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | (15 166)                         | 209 667                          | (1 787 018)                      | 6 587 294                        |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | \$ (15 166)                      | \$ 209 667                       | \$ (1 787 018)                   | \$ 6 587 294                     |

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

| Fonds Income Fund II             |                                  | Fonds Low Average Duration Fund  |                                  | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund |                                  | Fonds Low Duration Income Fund   |                                  |
|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026                       | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| \$ 19 304                        | \$ 8 470                         | \$ 12 244                        | \$ 17 569                        | \$ 25 963                                              | \$ 25 843                        | \$ 134 148                       | \$ 72 845                        |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                                      | 0                                | 0                                | 0                                |
| 1 179                            | 781                              | 1 074                            | (1 763)                          | 15 927                                                 | 3 853                            | (41 986)                         | 17 137                           |
| (1 761)                          | (3 866)                          | (3 981)                          | 3 615                            | (9 799)                                                | 18 719                           | 21 021                           | 46 618                           |
| (195)                            | 218                              | (10)                             | 81                               | (350)                                                  | 706                              | 1 377                            | 2 391                            |
| (10 984)                         | 15 532                           | (4 716)                          | 16 757                           | (36 044)                                               | 55 427                           | (85 428)                         | 157 270                          |
| 1 785                            | 3 911                            | (537)                            | (1 053)                          | (2 958)                                                | 20 592                           | 14 964                           | 30 196                           |
| (75)                             | 20                               | (295)                            | 79                               | (668)                                                  | 513                              | 799                              | 1 097                            |
| 9 253                            | 25 066                           | 3 779                            | 35 285                           | (7 929)                                                | 125 653                          | 44 895                           | 327 554                          |
| (5 335)                          | (2 173)                          | (1 618)                          | (1 958)                          | (3 041)                                                | (2 924)                          | (23 675)                         | (10 520)                         |
| 0                                | 0                                | (17)                             | (15)                             | 0                                                      | 0                                | (184)                            | 0                                |
| 0                                | 0                                | (5)                              | (5)                              | 0                                                      | 0                                | (207)                            | (109)                            |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                                      | 0                                | 0                                | 0                                |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | (1)                                                    | (1)                              | (2)                              | (1)                              |
| (5 335)                          | (2 173)                          | (1 640)                          | (1 978)                          | (3 042)                                                | (2 925)                          | (24 068)                         | (10 630)                         |
| 0                                | 0                                | 48                               | 63                               | 5                                                      | 0                                | 4                                | 0                                |
| (5 335)                          | (2 173)                          | (1 592)                          | (1 915)                          | (3 037)                                                | (2 925)                          | (24 064)                         | (10 630)                         |
| 3 918                            | 22 893                           | 2 187                            | 33 370                           | (10 966)                                               | 122 728                          | 20 831                           | 316 924                          |
| (163)                            | (117)                            | (45)                             | (1 197)                          | (88)                                                   | (338)                            | (470)                            | (659)                            |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                                      | 0                                | 0                                | 0                                |
| (22 365)                         | (9 329)                          | (813)                            | (829)                            | (219)                                                  | (1 088)                          | (38 304)                         | (18 482)                         |
| 238                              | 143                              | (21)                             | (38)                             | (844)                                                  | (12)                             | (1 565)                          | (1 210)                          |
| (22 290)                         | (9 303)                          | (879)                            | (2 064)                          | (1 151)                                                | (1 438)                          | (40 339)                         | (20 351)                         |
| (18 372)                         | 13 590                           | 1 308                            | 31 306                           | (12 117)                                               | 121 290                          | (19 508)                         | 296 573                          |
| (15)                             | 0                                | 0                                | (7)                              | (24)                                                   | (42)                             | (104)                            | 0                                |
| (27)                             | 0                                | 0                                | 0                                | (29)                                                   | 0                                | (311)                            | 0                                |
| (18 414)                         | 13 590                           | 1 308                            | 31 299                           | (12 170)                                               | 121 248                          | (19 923)                         | 296 573                          |
| \$ (18 414)                      | \$ 13 590                        | \$ 1 308                         | \$ 31 299                        | \$ (12 170)                                            | \$ 121 248                       | \$ (19 923)                      | \$ 296 573                       |

## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds Low Duration<br>Opportunities Fund |                                  | Fonds Low Duration<br>Opportunities ESG Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close le<br>30 juin 2026         | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026             | Période close le<br>30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                          |                                  |                                              |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 23 897                                | \$ 18 034                        | \$ 151                                       | \$ 153                           |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | (1 140)                                  | (6 174)                          | 32                                           | (10)                             |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 21 156                                   | 39 815                           | 17                                           | (59)                             |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | (218)                                    | 577                              | 0                                            | 3                                |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (7 033)                                  | 45 847                           | (133)                                        | 295                              |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | (29 603)                                 | 4 391                            | 41                                           | (84)                             |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (331)                                    | 336                              | (2)                                          | 3                                |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 6 728                                    | 102 826                          | 106                                          | 301                              |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                          |                                  |                                              |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (2 618)                                  | (2 038)                          | (14)                                         | (14)                             |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                        | (3)                              | 0                                            | 0                                |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (2 618)                                  | (2 041)                          | (14)                                         | (14)                             |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 95                                       | 94                               | 0                                            | 0                                |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (2 523)                                  | (1 947)                          | (14)                                         | (14)                             |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | <b>4 205</b>                             | <b>100 879</b>                   | <b>92</b>                                    | <b>287</b>                       |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                          |                                  |                                              |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (135)                                    | (154)                            | (19)                                         | (20)                             |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                        | 0                                | 0                                            | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (10 092)                                 | (13 684)                         | 0                                            | 0                                |
| Crédits et (charges) net(te)s de déréquation                                                                                                                                                                                  | (76)                                     | 10                               | 0                                            | 0                                |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (10 303)                                 | (13 828)                         | (19)                                         | (20)                             |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>(6 098)</b>                           | <b>87 051</b>                    | <b>73</b>                                    | <b>267</b>                       |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | (14)                                     | (49)                             | 0                                            | 0                                |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | (15)                                     | 0                                | 0                                            | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>(6 127)</b>                           | <b>87 002</b>                    | <b>73</b>                                    | <b>267</b>                       |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | <b>\$ (6 127)</b>                        | <b>\$ 87 002</b>                 | <b>\$ 73</b>                                 | <b>\$ 267</b>                    |

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

(1) Le Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund a changé de dénomination le 31 juillet 2026, il s'appelait auparavant le Fonds Inflation Multi-Asset Fund.

## Compte de résultat (suite)

| Fonds MAARS<br>Multi-Strategy Fund           |  | Fonds PIMCO MLP & Energy<br>Infrastructure Fund |                                  | Fonds Mortgage Opportunities Fund |                                  | Fonds PIMCO Real Asset<br>Growth Fund <sup>(1)</sup> |                                  |
|----------------------------------------------|--|-------------------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------------------|
| Période du<br>12 mai 2026 au<br>30 juin 2026 |  | Période close le<br>30 juin 2026                | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026  | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026                     | Période close le<br>30 juin 2025 |
| \$ 118                                       |  | \$ 4 239                                        | \$ 3 586                         | \$ 86 714                         | \$ 61 315                        | \$ 5 588                                             | \$ 2 243                         |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | 0                                 | 0                                | 0                                                    | 0                                |
| 16                                           |  | 2 770                                           | 5 340                            | 2 826                             | 10 025                           | 718                                                  | (1 459)                          |
| 230                                          |  | 14 819                                          | 4 852                            | 16 374                            | 30 853                           | 12 088                                               | (1 614)                          |
| (2)                                          |  | (8)                                             | (319)                            | 577                               | (806)                            | (458)                                                | 1 711                            |
| (99)                                         |  | 6 974                                           | (1 153)                          | (42 767)                          | 82 168                           | (6 523)                                              | 17 973                           |
| (175)                                        |  | (999)                                           | 6 720                            | (27 676)                          | 14 031                           | (2 476)                                              | 423                              |
| 0                                            |  | (3)                                             | 6                                | (2 822)                           | (66)                             | 14                                                   | (121)                            |
| 88                                           |  | 27 792                                          | 19 032                           | 33 226                            | 197 520                          | 8 951                                                | 19 156                           |
| (62)                                         |  | (1 468)                                         | (1 107)                          | (10 233)                          | (7 834)                          | (1 283)                                              | (998)                            |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | (69)                              | (59)                             | 0                                                    | 0                                |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | 0                                 | 0                                | (10)                                                 | (7)                              |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | 0                                 | 0                                | 0                                                    | 0                                |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | (1)                               | (1)                              | 0                                                    | 0                                |
| (62)                                         |  | (1 468)                                         | (1 107)                          | (10 303)                          | (7 894)                          | (1 293)                                              | (1 005)                          |
| 1                                            |  | 0                                               | 0                                | 0                                 | 0                                | 0                                                    | 0                                |
| (61)                                         |  | (1 468)                                         | (1 107)                          | (10 303)                          | (7 894)                          | (1 293)                                              | (1 005)                          |
| 27                                           |  | 26 324                                          | 17 925                           | 22 923                            | 189 626                          | 7 658                                                | 18 151                           |
| 0                                            |  | (42)                                            | (55)                             | (13 699)                          | (5 092)                          | (321)                                                | (717)                            |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | 0                                 | 0                                | 0                                                    | 0                                |
| 0                                            |  | (3 171)                                         | (2 705)                          | (3 935)                           | (3 145)                          | (162)                                                | (68)                             |
| 0                                            |  | 168                                             | 69                               | 24                                | 52                               | 7                                                    | (2)                              |
| 0                                            |  | (3 045)                                         | (2 691)                          | (17 610)                          | (8 185)                          | (476)                                                | (787)                            |
| 27                                           |  | 23 279                                          | 15 234                           | 5 313                             | 181 441                          | 7 182                                                | 17 364                           |
| (1)                                          |  | (345)                                           | (252)                            | 8                                 | 0                                | (267)                                                | (87)                             |
| 0                                            |  | 0                                               | 0                                | 0                                 | 0                                | 0                                                    | 0                                |
| 26                                           |  | 22 934                                          | 14 982                           | 5 321                             | 181 441                          | 6 915                                                | 17 277                           |
| \$ 26                                        |  | \$ 22 934                                       | \$ 14 982                        | \$ 5 321                          | \$ 181 441                       | \$ 6 915                                             | \$ 17 277                        |

## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds StocksPLUS™<br>Fund        |                                  | Fonds PIMCO StocksPLUS™<br>AR Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026   | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                  |                                  |                                    |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | \$ 133 708                       | \$ 111 855                       | \$ 275                             | \$ 233                           |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                | 0                                | 0                                  | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | 30 984                           | 6 999                            | 30                                 | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 401 930                          | (199 243)                        | 742                                | (229)                            |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | (962)                            | 1 718                            | (3)                                | 6                                |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | (61 667)                         | 170 045                          | (54)                               | 357                              |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | 78 923                           | 237 441                          | 223                                | 334                              |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (1 642)                          | 355                              | (1)                                | 3                                |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 581 274                          | 329 170                          | 1 212                              | 704                              |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                  |                                  |                                    |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (19 194)                         | (15 597)                         | (42)                               | (34)                             |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | (12)                             | (67)                             | 0                                  | 0                                |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                | 0                                | 0                                  | 0                                |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | (356)                            | (291)                            | 0                                  | 0                                |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | (2)                              | (2)                              | 0                                  | 0                                |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (19 564)                         | (15 957)                         | (42)                               | (34)                             |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 0                                | 0                                | 1                                  | 1                                |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (19 564)                         | (15 957)                         | (41)                               | (33)                             |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | <b>561 710</b>                   | <b>313 213</b>                   | <b>1 171</b>                       | <b>671</b>                       |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                  |                                  |                                    |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (4 023)                          | (1 667)                          | 0                                  | 0                                |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                | 0                                | 0                                  | 0                                |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (981)                            | (838)                            | 0                                  | 0                                |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation                                                                                                                                                                                  | (21)                             | 0                                | 0                                  | 0                                |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (5 025)                          | (2 505)                          | 0                                  | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>556 685</b>                   | <b>310 708</b>                   | <b>1 171</b>                       | <b>671</b>                       |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | 0                                | 51                               | (1)                                | 0                                |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | 0                                | 0                                | 0                                  | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | <b>556 685</b>                   | <b>310 759</b>                   | <b>1 170</b>                       | <b>671</b>                       |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | <b>\$ 556 685</b>                | <b>\$ 310 759</b>                | <b>\$ 1 170</b>                    | <b>\$ 671</b>                    |

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

| Fonds Strategic<br>Income Fund   |                                  | Fonds Total Return<br>Bond Fund  |                                  | Fonds PIMCO TRENDS Managed<br>Futures Strategy Fund |                                  | Fonds UK Corporate<br>Bond Fund  |                                  |
|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026                    | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| \$ 62 152                        | \$ 57 240                        | \$ 98 732                        | \$ 87 314                        | \$ 2 413                                            | \$ 3 394                         | £ 5 624                          | £ 5 056                          |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                                   | 0                                | 0                                | 0                                |
| 87 510                           | 20 906                           | (9 835)                          | (25 879)                         | 45                                                  | (4 281)                          | (2 581)                          | (4 287)                          |
| (24 830)                         | 71 030                           | (25 978)                         | 14 702                           | 2 833                                               | (15 888)                         | (963)                            | 789                              |
| (1 016)                          | 1 380                            | (717)                            | (312)                            | (270)                                               | 2 707                            | 241                              | 857                              |
| (16 876)                         | 173 575                          | (63 194)                         | 242 480                          | 2 013                                               | (3 782)                          | 956                              | 4 930                            |
| (42 976)                         | 64 812                           | 17 764                           | 3 081                            | (616)                                               | 6 255                            | 785                              | (55)                             |
| (104)                            | (77)                             | (226)                            | 799                              | 65                                                  | 66                               | (1 051)                          | 648                              |
| 63 860                           | 388 866                          | 16 546                           | 322 185                          | 6 483                                               | (11 529)                         | 3 011                            | 7 938                            |
| (16 813)                         | (13 507)                         | (15 020)                         | (14 737)                         | (757)                                               | (922)                            | (299)                            | (295)                            |
| (8)                              | (11)                             | (510)                            | (621)                            | 0                                                   | 0                                | 0                                | 0                                |
| 0                                | 0                                | (274)                            | (351)                            | 0                                                   | 0                                | 0                                | 0                                |
| (186)                            | (149)                            | (13)                             | (14)                             | 0                                                   | 0                                | 0                                | 0                                |
| (1)                              | (1)                              | (2)                              | (2)                              | 0                                                   | 0                                | 0                                | 0                                |
| (17 008)                         | (13 668)                         | (15 819)                         | (15 725)                         | (757)                                               | (922)                            | (299)                            | (295)                            |
| 1                                | 0                                | 0                                | 0                                | 19                                                  | 23                               | 4                                | 5                                |
| (17 007)                         | (13 668)                         | (15 819)                         | (15 725)                         | (738)                                               | (899)                            | (295)                            | (290)                            |
| 46 853                           | 375 198                          | 727                              | 306 460                          | 5 745                                               | (12 428)                         | 2 716                            | 7 648                            |
| (200)                            | (2 380)                          | (1 120)                          | (3 804)                          | (26)                                                | (125)                            | (27)                             | (36)                             |
| 0                                | 0                                | 0                                | 0                                | 0                                                   | 0                                | 0                                | 0                                |
| (6 482)                          | (4 099)                          | (16 970)                         | (10 769)                         | (11)                                                | (473)                            | (3 871)                          | (4 194)                          |
| 426                              | 82                               | (523)                            | (264)                            | 1                                                   | (47)                             | 47                               | 72                               |
| (6 256)                          | (6 397)                          | (18 613)                         | (14 837)                         | (36)                                                | (645)                            | (3 851)                          | (4 158)                          |
| 40 597                           | 368 801                          | (17 886)                         | 291 623                          | 5 709                                               | (13 073)                         | (1 135)                          | 3 490                            |
| (2 867)                          | (2 140)                          | 13                               | (9)                              | (1)                                                 | (3)                              | (1)                              | (3)                              |
| (305)                            | (11)                             | (52)                             | 0                                | 0                                                   | (12)                             | (6)                              | 0                                |
| 37 425                           | 366 650                          | (17 925)                         | 291 614                          | 5 708                                               | (13 088)                         | (1 142)                          | 3 487                            |
| \$ 37 425                        | \$ 366 650                       | \$ (17 925)                      | \$ 291 614                       | \$ 5 708                                            | \$ (13 088)                      | £ (1 142)                        | £ 3 487                          |



## Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                                                                                                                        | Fonds UK Long Term Corporate<br>Bond Fund |                                  | Fonds US High Yield<br>Bond Fund |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                               | Période close<br>le 30 juin 2026          | Période close<br>le 30 juin 2025 | Période close<br>le 30 juin 2026 | Période close<br>le 30 juin 2025 |
| <b>Produits</b>                                                                                                                                                                                                               |                                           |                                  |                                  |                                  |
| Produits des intérêts et dividendes                                                                                                                                                                                           | £ 633                                     | £ 2 492                          | \$ 56 120                        | \$ 57 760                        |
| Autres produits                                                                                                                                                                                                               | 0                                         | 0                                | 227                              | 0                                |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers                     | (513)                                     | (11 107)                         | (14 639)                         | (20 470)                         |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                                                | 7                                         | 1 052                            | (9 311)                          | 20 239                           |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change                                                                                                                                                                             | 164                                       | 987                              | 32                               | 284                              |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension, les dépôts auprès d'établissements de crédit et les autres actifs financiers | 205                                       | 8 955                            | (17 122)                         | 38 102                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés                                                                                                                            | (97)                                      | (954)                            | (8 951)                          | 18 363                           |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change                                                                                                                                                         | (288)                                     | 521                              | (75)                             | 94                               |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements                                                                                                                                                                                | 111                                       | 1 946                            | 6 281                            | 114 372                          |
| <b>Charges d'exploitation</b>                                                                                                                                                                                                 |                                           |                                  |                                  |                                  |
| Frais de gestion                                                                                                                                                                                                              | (56)                                      | (217)                            | (5 830)                          | (5 698)                          |
| Frais de services                                                                                                                                                                                                             | 0                                         | 0                                | (413)                            | (437)                            |
| Frais de commercialisation                                                                                                                                                                                                    | 0                                         | 0                                | 0                                | 0                                |
| Frais de distribution                                                                                                                                                                                                         | 0                                         | 0                                | 0                                | 0                                |
| Autres charges                                                                                                                                                                                                                | 0                                         | 0                                | (1)                              | (1)                              |
| Total des charges                                                                                                                                                                                                             | (56)                                      | (217)                            | (6 244)                          | (6 136)                          |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement                                                                                                                                                                  | 0                                         | 0                                | 29                               | 29                               |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                                                                                                 | (56)                                      | (217)                            | (6 215)                          | (6 107)                          |
| <b>Revenu/(perte) net(te) sur investissements</b>                                                                                                                                                                             | 55                                        | 1 729                            | 66                               | 108 265                          |
| <b>Frais financiers</b>                                                                                                                                                                                                       |                                           |                                  |                                  |                                  |
| Frais des intérêts                                                                                                                                                                                                            | (11)                                      | (23)                             | (210)                            | (945)                            |
| Frais de facilité de crédit                                                                                                                                                                                                   | 0                                         | 0                                | (77)                             | (86)                             |
| Distributions aux Porteurs d'actions de participation rachetables                                                                                                                                                             | (33)                                      | (379)                            | (7 722)                          | (4 444)                          |
| Crédits et (charges) net(te)s de déréquation                                                                                                                                                                                  | 0                                         | (91)                             | 921                              | (736)                            |
| Total des frais financiers                                                                                                                                                                                                    | (44)                                      | (493)                            | (7 088)                          | (6 211)                          |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période avant impôt</b>                                                                                                                                                                             | 11                                        | 1 236                            | (7 022)                          | 102 054                          |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement                                                                                                                                       | 0                                         | 1                                | 0                                | 0                                |
| Impôt sur les plus-values                                                                                                                                                                                                     | 0                                         | (10)                             | 0                                | 0                                |
| <b>Bénéfice/(perte) de la période après impôt</b>                                                                                                                                                                             | 11                                        | 1 227                            | (7 022)                          | 102 054                          |
| <b>Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation</b>                                                                                   | £ 11                                      | £ 1 227                          | \$ (7 022)                       | \$ 102 054                       |

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

\* Le Total Société de la période comptable close le 30 juin 2026 et de la période close le 30 juin 2025 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés. Veuillez vous reporter à la note 10 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

| Fonds US Investment Grade<br>Corporate Bond Fund |                                  | Fonds US Short-Term Fund         |                                  | Total Société*                   |                                  |
|--------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Période close le<br>30 juin 2026                 | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026 | Période close le<br>30 juin 2025 | Période close le<br>30 juin 2026 | Période close le<br>30 juin 2025 |
| \$ 10 770                                        | \$ 12 331                        | \$ 61 305                        | \$ 60 197                        | \$ 6 631 542                     | \$ 5 145 897                     |
| 0                                                | 0                                | 0                                | 0                                | 2 345                            | 0                                |
| 662                                              | (3 106)                          | 6 318                            | (1 900)                          | 913 164                          | (117 194)                        |
| (3 885)                                          | 5 454                            | 1 639                            | (3 858)                          | 356 868                          | 2 453 190                        |
| (78)                                             | (440)                            | (1 552)                          | (797)                            | (470 527)                        | 217 865                          |
| (6 635)                                          | 15 727                           | (8 704)                          | 28 746                           | (2 665 779)                      | 9 246 669                        |
| (1 539)                                          | 12 895                           | 2 741                            | (351)                            | (968 764)                        | 1 503 515                        |
| 93                                               | (189)                            | (475)                            | 154                              | (146 917)                        | 56 596                           |
| (612)                                            | 42 672                           | 61 272                           | 82 191                           | 3 651 932                        | 18 506 538                       |
| (1 421)                                          | (1 522)                          | (6 042)                          | (5 205)                          | (1 125 996)                      | (831 854)                        |
| 0                                                | 0                                | (24)                             | (14)                             | (14 065)                         | (12 054)                         |
| 0                                                | 0                                | 0                                | 0                                | (47 218)                         | (32 193)                         |
| 0                                                | 0                                | 0                                | 0                                | (33 324)                         | (12 377)                         |
| 0                                                | 0                                | (1)                              | (1)                              | (102)                            | (95)                             |
| (1 421)                                          | (1 522)                          | (6 067)                          | (5 220)                          | (1 220 705)                      | (888 573)                        |
| 0                                                | 0                                | 454                              | 348                              | 3 852                            | 3 740                            |
| (1 421)                                          | (1 522)                          | (5 613)                          | (4 872)                          | (1 216 853)                      | (884 833)                        |
| (2 033)                                          | 41 150                           | 55 659                           | 77 319                           | 2 435 079                        | 17 621 705                       |
| (44)                                             | (345)                            | (1 455)                          | (97)                             | (172 169)                        | (140 061)                        |
| 0                                                | 0                                | 0                                | 0                                | (259)                            | (341)                            |
| (1 766)                                          | (1 739)                          | (20 592)                         | (21 842)                         | (3 035 314)                      | (2 126 980)                      |
| 79                                               | (104)                            | 1 475                            | (8)                              | 50 797                           | (3 296)                          |
| (1 731)                                          | (2 188)                          | (20 572)                         | (21 947)                         | (3 156 945)                      | (2 270 678)                      |
| (3 764)                                          | 38 962                           | 35 087                           | 55 372                           | (721 866)                        | 15 351 027                       |
| (34)                                             | (44)                             | (19)                             | (4)                              | (24 707)                         | (8 447)                          |
| 0                                                | 0                                | 0                                | 0                                | (7 480)                          | (1 035)                          |
| (3 798)                                          | 38 918                           | 35 068                           | 55 368                           | (754 053)                        | 15 341 545                       |
| \$ (3 798)                                       | \$ 38 918                        | \$ 35 068                        | \$ 55 368                        | \$ (754 053)                     | \$ 15 341 545                    |

## État de l'évolution des actifs nets

| (Montants en milliers)                                                                                                               | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |                               | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund       |                               | Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund     |                               |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                   | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 1 070 680                          | \$ 1 833 693                  | \$ 284 675                                    | \$ 228 519                    | \$ 5 759 330                                    | \$ 1 380 013                  |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 307 235                               | 193 903                       | 50 738                                        | 115 714                       | 12 657 522                                      | 1 452 905                     |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 537                                   | 666                           | 71                                            | 291                           | 4 205                                           | 683                           |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (458 255)                             | (651 729)                     | (46 485)                                      | (100 702)                     | (2 776 559)                                     | (517 426)                     |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                                     | 0                             | 0                                             | 0                             | 0                                               | 0                             |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 14 951                                | 91 272                        | (1 926)                                       | 8 554                         | 661 791                                         | 230 315                       |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 935 148                            | \$ 1 467 805                  | \$ 287 073                                    | \$ 252 376                    | \$ 16 306 289                                   | \$ 2 546 490                  |
|                                                                                                                                      | Fonds Diversified Income Fund         |                               | Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund |                               | Fonds Diversified Income ESG Fund               |                               |
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                   | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 10 206 450                         | \$ 8 784 448                  | \$ 380 653                                    | \$ 296 525                    | \$ 50 129                                       | \$ 49 578                     |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 2 181 895                             | 2 502 596                     | 95 562                                        | 38 587                        | 93                                              | 46                            |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 8 909                                 | 8 221                         | 24                                            | 26                            | 0                                               | 0                             |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (2 764 841)                           | (2 232 357)                   | (58 421)                                      | (35 376)                      | (3 153)                                         | (3 815)                       |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                                     | 0                             | 0                                             | 0                             | 0                                               | 0                             |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (147 917)                             | 678 092                       | 1 561                                         | 29 842                        | (368)                                           | 6 888                         |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 9 484 496                          | \$ 9 741 000                  | \$ 419 379                                    | \$ 329 604                    | \$ 46 701                                       | \$ 52 697                     |
|                                                                                                                                      | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund  |                               | Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund    |                               | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |                               |
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                   | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 3 473 761                          | \$ 2 676 135                  | \$ 167 518                                    | \$ 146 021                    | \$ 751 526                                      | \$ 327 198                    |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 410 031                               | 260 098                       | 8 866                                         | 8 299                         | 1 136 923                                       | 75 659                        |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 2 208                                 | 689                           | 0                                             | 0                             | 39                                              | 52                            |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (415 231)                             | (274 195)                     | (13 464)                                      | (13 210)                      | (134 770)                                       | (18 756)                      |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                                     | 0                             | 0                                             | 0                             | 0                                               | 0                             |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (5 957)                               | 333 586                       | (2 314)                                       | 22 508                        | 28 299                                          | 48 306                        |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 3 464 812                          | \$ 2 996 313                  | \$ 160 606                                    | \$ 163 618                    | \$ 1 782 017                                    | \$ 432 459                    |

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

| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                   |                               | Fonds PIMCO Climate Bond Fund  |                               | Fonds Commodity Real Return Fund   |                               | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund |                               |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------|
| Période close le 30 juin 2026                         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026  | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026      | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026              | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 5 939 296                                          | \$ 4 753 034                  | \$ 370 822                     | \$ 318 213                    | \$ 836 732                         | \$ 739 034                    | \$ 267 262                                 | \$ 125 468                    |
| 718 674                                               | 571 080                       | 86 736                         | 30 505                        | 582 092                            | 114 656                       | 19 464                                     | 123 242                       |
| 4 561                                                 | 3 204                         | 6                              | 5                             | 2                                  | 0                             | 0                                          | 0                             |
| (911 313)                                             | (723 210)                     | (43 502)                       | (37 604)                      | (359 051)                          | (195 866)                     | (38 166)                                   | (13 300)                      |
| 0                                                     | 0                             | 0                              | 0                             | 0                                  | 0                             | 0                                          | 0                             |
| (33 936)                                              | 429 874                       | (7 970)                        | 38 184                        | 97 014                             | 68 188                        | (2 924)                                    | 16 962                        |
| \$ 5 717 282                                          | \$ 5 033 982                  | \$ 406 092                     | \$ 349 303                    | \$ 1 156 789                       | \$ 726 012                    | \$ 245 636                                 | \$ 252 372                    |
| Fonds Dynamic Bond Fund                               |                               | Fonds Emerging Local Bond Fund |                               | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund |                               | Fonds Emerging Markets Bond Fund           |                               |
| Période close le 30 juin 2026                         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026  | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026      | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026              | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 4 554 937                                          | \$ 3 669 925                  | \$ 6 443 057                   | \$ 2 840 608                  | \$ 141 849                         | \$ 116 904                    | \$ 6 712 555                               | \$ 4 179 583                  |
| 465 850                                               | 404 303                       | 2 397 494                      | 1 421 544                     | 82 463                             | 4 662                         | 1 526 229                                  | 1 348 174                     |
| 438                                                   | 308                           | 4 635                          | 1 815                         | 2                                  | 3                             | 2 053                                      | 3 528                         |
| (414 603)                                             | (200 001)                     | (2 328 031)                    | (431 460)                     | (3 227)                            | (4 218)                       | (1 532 785)                                | (1 251 079)                   |
| 0                                                     | 0                             | 0                              | 0                             | 0                                  | 0                             | 0                                          | 0                             |
| 10 281                                                | 472 281                       | 61 076                         | 429 222                       | 2 265                              | 16 007                        | 72 641                                     | 414 388                       |
| \$ 4 616 903                                          | \$ 4 346 816                  | \$ 6 578 231                   | \$ 4 261 729                  | \$ 223 352                         | \$ 133 358                    | \$ 6 780 693                               | \$ 4 694 594                  |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund |                               | Fonds PIMCO ESG Income Fund    |                               | Fonds Euro Bond Fund               |                               | Fonds Euro Credit Fund                     |                               |
| Période close le 30 juin 2026                         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026  | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026      | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026              | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 14 621                                             | \$ 15 660                     | \$ 524 755                     | \$ 351 843                    | € 1 634 324                        | € 1 675 554                   | € 552 204                                  | € 506 513                     |
| 6 951                                                 | 2 948                         | 213 102                        | 175 167                       | 148 033                            | 202 207                       | 29 644                                     | 104 750                       |
| 0                                                     | 0                             | 3 494                          | 2 837                         | 0                                  | 0                             | 0                                          | 0                             |
| (1 729)                                               | (6 055)                       | (73 789)                       | (61 302)                      | (221 468)                          | (257 774)                     | (62 079)                                   | (129 728)                     |
| 0                                                     | 0                             | 0                              | 0                             | 0                                  | 0                             | 0                                          | 0                             |
| 774                                                   | 1 577                         | (18 762)                       | 59 587                        | 16 410                             | 18 911                        | 5 471                                      | 8 431                         |
| \$ 20 617                                             | \$ 14 130                     | \$ 648 800                     | \$ 528 132                    | € 1 577 299                        | € 1 638 898                   | € 525 240                                  | € 489 966                     |

## État de l'évolution des actifs nets (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                               | Fonds Euro Income Bond Fund   |                               | Fonds Euro Long Average Duration Fund |                               | Fonds Euro Short-Term Fund    |                               |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | € 2 627 574                   | € 1 676 869                   | € 1 178 488                           | € 1 188 893                   | € 467 790                     | € 265 893                     |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 631 562                       | 345 441                       | 107 885                               | 98 630                        | 119 410                       | 157 758                       |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 116                           | 19                            | 0                                     | 0                             | 0                             | 0                             |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (418 728)                     | (184 889)                     | (14 928)                              | (24 367)                      | (105 017)                     | (68 803)                      |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                             | 0                             | 0                                     | 0                             | 0                             | 0                             |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 13 179                        | 35 745                        | 29 041                                | (50 599)                      | 3 764                         | 3 896                         |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | € 2 853 703                   | € 1 873 185                   | € 1 300 486                           | € 1 212 557                   | € 485 947                     | € 358 744                     |

|                                                                                                                                      | Fonds Global Bond ESG Fund    |                               | Fonds Global Bond Ex-US Fund  |                               | Fonds Global Bond Opportunities Fund    |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période du 10 juin 2026 au 30 juin 2026 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 4 125 766                  | \$ 3 964 473                  | \$ 1 028 005                  | \$ 1 096 286                  | \$ 0                                    |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 434 041                       | 631 272                       | 205 223                       | 237 661                       | 14 868                                  |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 9 126                         | 8 003                         | 961                           | 937                           | 0                                       |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (627 838)                     | (1 025 945)                   | (176 552)                     | (413 942)                     | 0                                       |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                             | 0                             | 0                             | 0                             | 0                                       |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (57 532)                      | 502 535                       | 4 254                         | 23 463                        | 33                                      |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 3 883 563                  | \$ 4 080 338                  | \$ 1 061 891                  | \$ 944 405                    | \$ 14 901                               |

|                                                                                                                                      | Fonds Global Low Duration Real Return Fund |                               | Fonds Global Real Return Fund |                               | Fonds Income Fund             |                               |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026              | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 1 702 234                               | \$ 1 216 904                  | \$ 1 863 961                  | \$ 2 090 147                  | \$ 121 748 102                | \$ 89 286 860                 |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 775 529                                    | 483 761                       | 914 938                       | 158 813                       | 24 061 762                    | 16 850 266                    |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 1                                          | 0                             | 1 448                         | 836                           | 197 119                       | 130 825                       |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (332 037)                                  | (212 107)                     | (224 100)                     | (555 494)                     | (19 470 429)                  | (13 832 025)                  |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                                          | 0                             | 0                             | 0                             | 0                             | 0                             |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (16 293)                                   | 174 869                       | (15 166)                      | 209 667                       | (1 787 018)                   | 6 587 294                     |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 2 129 434                               | \$ 1 663 427                  | \$ 2 541 081                  | \$ 1 903 969                  | \$ 124 749 536                | \$ 99 023 220                 |

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

| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |                               | Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund |                               | Fonds Global Advantage Fund                            |                               | Fonds Global Bond Fund                        |                               |
|-------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------|
| Période close le 30 juin 2026             | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                      | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                          | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 |
| € 524 488                                 | € 383 525                     | € 1 245 180                                        | € 955 095                     | \$ 441 745                                             | \$ 404 337                    | \$ 17 559 421                                 | \$ 15 803 937                 |
| 104 957                                   | 102 308                       | 213 992                                            | 151 195                       | 4 712                                                  | 24 963                        | 2 497 299                                     | 2 715 448                     |
| 2                                         | 0                             | 0                                                  | 0                             | 0                                                      | 0                             | 3 700                                         | 3 438                         |
| (43 691)                                  | (32 651)                      | (240 046)                                          | (102 969)                     | (8 543)                                                | (42 531)                      | (2 326 610)                                   | (2 776 942)                   |
| 0                                         | 0                             | 0                                                  | 0                             | 0                                                      | 0                             | 0                                             | 0                             |
| 11 120                                    | 14 351                        | 9 971                                              | 24 823                        | (6 437)                                                | 54 115                        | (124 092)                                     | 1 193 427                     |
| € 596 876                                 | € 467 533                     | € 1 229 097                                        | € 1 028 144                   | \$ 431 477                                             | \$ 440 884                    | \$ 17 609 718                                 | \$ 16 939 308                 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund         |                               | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund              |                               | Fonds Global Investment Grade Credit Fund              |                               | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund |                               |
| Période close le 30 juin 2026             | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                      | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                          | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 2 867 321                              | \$ 2 868 819                  | \$ 26 735                                          | \$ 10 456                     | \$ 7 863 675                                           | \$ 8 618 950                  | \$ 2 514 161                                  | \$ 2 115 617                  |
| 543 710                                   | 469 063                       | 0                                                  | 16                            | 947 775                                                | 838 039                       | 205 435                                       | 585 086                       |
| 2 984                                     | 3 144                         | 1                                                  | 1                             | 2 642                                                  | 1 934                         | 3                                             | 3                             |
| (957 384)                                 | (693 079)                     | (16)                                               | 0                             | (1 363 476)                                            | (1 804 018)                   | (378 437)                                     | (517 632)                     |
| 0                                         | 0                             | 0                                                  | 0                             | 0                                                      | 0                             | 0                                             | 0                             |
| (38 974)                                  | 247 312                       | 311                                                | 491                           | (54 476)                                               | 671 793                       | (64 120)                                      | 361 840                       |
| \$ 2 417 657                              | \$ 2 895 259                  | \$ 27 031                                          | \$ 10 964                     | \$ 7 396 140                                           | \$ 8 326 698                  | \$ 2 277 042                                  | \$ 2 544 914                  |
| Fonds Income Fund II                      |                               | Fonds Low Average Duration Fund                    |                               | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund |                               | Fonds Low Duration Income Fund                |                               |
| Période close le 30 juin 2026             | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                      | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                          | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 602 943                                | \$ 273 663                    | \$ 576 265                                         | \$ 676 383                    | \$ 1 330 306                                           | \$ 1 084 966                  | \$ 5 208 161                                  | \$ 2 925 246                  |
| 494 555                                   | 156 882                       | 155 822                                            | 267 068                       | 178 659                                                | 200 828                       | 4 499 265                                     | 1 022 244                     |
| 81                                        | 1                             | 248                                                | 342                           | 9                                                      | 0                             | 399                                           | 172                           |
| (358 622)                                 | (112 266)                     | (210 388)                                          | (156 042)                     | (807 906)                                              | (147 772)                     | (1 177 726)                                   | (1 151 867)                   |
| 0                                         | 0                             | 0                                                  | 0                             | 0                                                      | 0                             | 0                                             | 0                             |
| (18 414)                                  | 13 590                        | 1 308                                              | 31 299                        | (12 170)                                               | 121 248                       | (19 923)                                      | 296 573                       |
| \$ 720 543                                | \$ 331 870                    | \$ 523 255                                         | \$ 819 050                    | \$ 688 898                                             | \$ 1 259 270                  | \$ 8 510 176                                  | \$ 3 092 368                  |

## État de l'évolution des actifs nets (suite)

| (Montants en milliers)                                                                                                               | Fonds Low Duration Opportunities Fund |                               | Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund |                               | Fonds MAARS Multi-Strategy Fund        |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026         | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026             | Période close le 30 juin 2025 | Période du 12 mai 2026 au 30 juin 2026 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 886 858                            | \$ 843 935                    | \$ 5 294                                  | \$ 5 437                      | \$ 0                                   |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 233 119                               | 10 666                        | 0                                         | 0                             | 38 295                                 |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 1 346                                 | 1 790                         | 0                                         | 0                             | 0                                      |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (49 543)                              | (138 330)                     | 0                                         | 0                             | (19)                                   |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                                     | 0                             | 0                                         | 0                             | 0                                      |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (6 127)                               | 87 002                        | 73                                        | 267                           | 26                                     |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 1 065 653                          | \$ 805 063                    | \$ 5 367                                  | \$ 5 704                      | \$ 38 302                              |

|                                                                                                                                      | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund |                               | Fonds Strategic Income Fund   |                               | Fonds Total Return Bond Fund  |                               |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026   | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 11 905                       | \$ 10 118                     | \$ 2 372 262                  | \$ 2 318 366                  | \$ 4 408 319                  | \$ 4 003 163                  |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 413                             | 494                           | 604 109                       | 438 658                       | 887 478                       | 739 693                       |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 0                               | 0                             | 46                            | 32                            | 4 220                         | 6 467                         |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (118)                           | (821)                         | (254 395)                     | (681 725)                     | (1 058 288)                   | (915 720)                     |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                               | 0                             | 0                             | 0                             | 0                             | 0                             |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 1 170                           | 671                           | 37 425                        | 366 650                       | (17 925)                      | 291 614                       |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 13 370                       | \$ 10 462                     | \$ 2 759 447                  | \$ 2 441 981                  | \$ 4 223 804                  | \$ 4 125 217                  |

|                                                                                                                                      | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund |                               | Fonds US Short-Term Fund      |                               | Total Société*                |                               |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                                                                                                                                      | Période close le 30 juin 2026                 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 |
| <b>Actifs nets au début de la période</b>                                                                                            | \$ 393 292                                    | \$ 493 892                    | \$ 2 701 425                  | \$ 2 330 264                  | \$ 247 677 904                | \$ 190 413 110                |
| Produits des actions émises                                                                                                          | 110 252                                       | 70 478                        | 1 359 241                     | 584 239                       | 66 471 236                    | 39 133 621                    |
| Produits des réinvestissements des distributions                                                                                     | 115                                           | 64                            | 15 795                        | 16 276                        | 274 230                       | 198 996                       |
| Paiements au titre du rachat d'actions                                                                                               | (54 352)                                      | (128 345)                     | (575 689)                     | (425 911)                     | (46 647 601)                  | (36 083 932)                  |
| Ajustement du taux de change notionnel                                                                                               | 0                                             | 0                             | 0                             | 0                             | (268 220)                     | 979 293                       |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (3 798)                                       | 38 918                        | 35 068                        | 55 368                        | (754 053)                     | 15 341 545                    |
| <b>Actifs nets à la fin de la période</b>                                                                                            | \$ 445 509                                    | \$ 475 007                    | \$ 3 535 840                  | \$ 2 560 236                  | \$ 266 753 496                | \$ 209 982 633                |

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

(1) Le Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund a changé de dénomination le 31 juillet 2026, il s'appelait auparavant le Fonds Inflation Multi-Asset Fund.

\* Le Total Société de la période comptable close le 30 juin 2026 et de la période close le 30 juin 2025 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés. Veuillez vous reporter à la note 10 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund |                               | Fonds Mortgage Opportunities Fund |                               | Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund <sup>(1)</sup> |                               | Fonds StocksPLUS™ Fund        |                               |
|----------------------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| Période close le 30 juin 2026                | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026     | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026                     | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 168 821                                   | \$ 157 071                    | \$ 2 559 903                      | \$ 1 791 316                  | \$ 203 445                                        | \$ 178 901                    | \$ 6 170 237                  | \$ 5 022 355                  |
| 114 058                                      | 62 486                        | 661 960                           | 587 167                       | 71 488                                            | 13 512                        | 1 464 248                     | 1 641 527                     |
| 33                                           | 22                            | 410                               | 444                           | 25                                                | 13                            | 881                           | 830                           |
| (71 230)                                     | (59 544)                      | (291 457)                         | (285 817)                     | (17 942)                                          | (21 209)                      | (1 660 209)                   | (1 651 627)                   |
| 0                                            | 0                             | 0                                 | 0                             | 0                                                 | 0                             | 0                             | 0                             |
| 22 934                                       | 14 982                        | 5 321                             | 181 441                       | 6 915                                             | 17 277                        | 556 685                       | 310 759                       |
| \$ 234 616                                   | \$ 175 017                    | \$ 2 936 137                      | \$ 2 274 551                  | \$ 263 931                                        | \$ 188 494                    | \$ 6 531 842                  | \$ 5 323 844                  |

| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |                               | Fonds UK Corporate Bond Fund  |                               | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund |                               | Fonds US High Yield Bond Fund |                               |
|--------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|----------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| Période close le 30 juin 2026                    | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026          | Période close le 30 juin 2025 | Période close le 30 juin 2026 | Période close le 30 juin 2025 |
| \$ 106 020                                       | \$ 219 485                    | £ 222 109                     | £ 213 133                     | £ 25 844                               | £ 114 440                     | \$ 1 735 681                  | \$ 1 714 223                  |
| 84 664                                           | 41 398                        | 21 842                        | 15 782                        | 320                                    | 1 414                         | 393 600                       | 241 167                       |
| 11                                               | 219                           | 0                             | 0                             | 1                                      | 1                             | 1 303                         | 853                           |
| (31 878)                                         | (144 954)                     | (16 448)                      | (21 488)                      | (1 449)                                | (83 234)                      | (599 788)                     | (411 811)                     |
| 0                                                | 0                             | 0                             | 0                             | 0                                      | 0                             | 0                             | 0                             |
| 5 708                                            | (13 088)                      | (1 142)                       | 3 487                         | 11                                     | 1 227                         | (7 022)                       | 102 054                       |
| \$ 164 525                                       | \$ 103 060                    | £ 226 361                     | £ 210 914                     | £ 24 727                               | £ 33 848                      | \$ 1 523 774                  | \$ 1 646 486                  |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                             |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>AUSTRALIE</b>                                                                      |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                  |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd.                                                |                                     |                                  |                           | New Metro Global Ltd.                      | \$ 3 000                            | \$ 2 880                         | 0,31                      | 12,750 % éch. 28/11/2040                              | COP 500                             | \$ 0                             | 0,00                      |
| 6,250 % éch. 22/10/2031                                                               | \$ 1 300                            | \$ 1 324                         | 0,14                      | 11,800 % éch. 09/03/2029                   |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     | 10 742                           | 1,15                      |
| 6,750 % éch. 22/04/2034                                                               | 2 200                               | 2 270                            | 0,24                      | New World China Land Ltd.                  | 5 700                               | 5 507                            | 0,59                      | Total Colombie                                        |                                     | 14 989                           | 1,60                      |
| Cdc Data Centres Australia Pty. Ltd.                                                  |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 23/01/2027                    |                                     |                                  |                           | <b>COSTA RICA</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,874 % éch. 12/06/2056                                                               | AUD 400                             | 280                              | 0,03                      | PCPD Capital Ltd.                          | 8 700                               | 8 707                            | 0,93                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 7,332 % éch. 12/06/2056                                                               | 400                                 | 284                              | 0,03                      | Shui On Development Holding Ltd.           | 6 000                               | 6 090                            | 0,65                      | Obligation internationale du gouvernement costaricain |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     | 4 158                            | 0,44                      | 9,750 % éch. 26/01/2029                    |                                     |                                  |                           | 6,001 % éch. 16/01/2036                               | € 500                               | 605                              | 0,06                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                          |                                     |                                  |                           | Tencent Holdings Ltd.                      | 4 300                               | 4 309                            | 0,46                      | <b>HONG KONG</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Treasury Corp. of Victoria                                                            |                                     |                                  |                           | 5,600 % éch. 16/06/2046                    |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                                                               | 10 500                              | 5 107                            | 0,55                      | UPL Corp. Ltd.                             | 1 300                               | 1 205                            | 0,13                      | Central Plaza Development Ltd.                        |                                     |                                  |                           |
| Total Australie                                                                       |                                     | 9 265                            | 0,99                      | 4,625 % éch. 16/06/2030                    |                                     |                                  |                           | 7,150 % éch. 21/03/2028                               | \$ 6 000                            | 6 050                            | 0,65                      |
| <b>BERMUDES</b>                                                                       |                                     |                                  |                           | VLL International, Inc.                    | 1 710                               | 1 174                            | 0,13                      | Fortune Star BVI Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                  |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 20/07/2027                    | 4 100                               | 2 266                            | 0,24                      | 6,800 % éch. 09/09/2029 (i)                           | 10 200                              | 10 102                           | 1,08                      |
| Li & Fung Ltd.                                                                        |                                     |                                  |                           | 9,375 % éch. 29/07/2029                    |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 19/05/2028                               | 4 530                               | 4 654                            | 0,50                      |
| 5,250 % éch. 03/11/2026 (e)                                                           | \$ 1 458                            | 801                              | 0,09                      | Wynn Macau Ltd.                            | 3 300                               | 3 232                            | 0,35                      | Franshion Brilliant Ltd.                              | 3 900                               | 3 607                            | 0,38                      |
| 8,375 % éch. 05/02/2029                                                               | 3 600                               | 3 687                            | 0,39                      | 5,125 % éch. 15/12/2029                    | 7 200                               | 7 181                            | 0,77                      | 4,250 % éch. 23/07/2029                               |                                     |                                  |                           |
| Total Bermudes                                                                        |                                     | 4 488                            | 0,48                      | 5,500 % éch. 01/10/2027                    | 10 650                              | 10 588                           | 1,13                      | Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÎLES CAÏMANS</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/02/2034                    |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 12/11/2029                               | 2 500                               | 1 080                            | 0,11                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                            |                                     |                                  |                           | Zhongsheng Group Holdings Ltd.             | 2 800                               | 2 670                            | 0,29                      | 3,975 % éch. 09/11/2027                               | 8 210                               | 3 703                            | 0,40                      |
| Alibaba Group Holding Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           | 5,980 % éch. 30/01/2028                    |                                     |                                  |                           | Total Hong Kong                                       |                                     | 29 196                           | 3,12                      |
| 0,000 % éch. 15/09/2032 (d)                                                           | 5 050                               | 4 494                            | 0,48                      | Total Îles Caïmans                         |                                     | 119 871                          | 12,82                     | <b>INDE</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| Anlilian Capital Ltd.                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                             |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 05/12/2029 (d)                                                           | € 3 300                             | 3 650                            | 0,39                      | <b>CHINE</b>                               |                                     |                                  |                           | Adani Green Energy UP Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| Baidu, Inc.                                                                           |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                  |                                     |                                  |                           | 6,700 % éch. 12/03/2042                               | 5 965                               | 5 834                            | 0,62                      |
| 0,000 % éch. 12/03/2032 (d)                                                           | \$ 2 300                            | 2 046                            | 0,22                      | Country Garden Holdings                    |                                     |                                  |                           | Adani Renewable Energy RJ Ltd.                        |                                     |                                  |                           |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.                                                      |                                     |                                  |                           | Co. Ltd. (c)                               | 2 910 774                           | 62                               | 0,01                      | 4,625 % éch. 15/10/2039                               | 2 988                               | 2 541                            | 0,27                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                                           | 3 612                               | 253                              | 0,03                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (c)              | 54 996 358                          | 330                              | 0,03                      | Axis Bank Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           |                                            |                                     | 392                              | 0,04                      | 4,100 % éch.                                          |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2026 (d)                                                           | 1 999                               | 7                                | 0,00                      | <b>VALEUR NOMINALE (en milliers)</b>       |                                     |                                  |                           | 08/09/2026 (e)(g)                                     | 4 600                               | 4 589                            | 0,49                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (d)                                                           | 2 498                               | 19                               | 0,00                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b> |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch.                                          |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)                                                           | 3 998                               | 30                               | 0,00                      | Midea Investment Development Co. Ltd.      |                                     |                                  |                           | 30/12/2031 (e)(g)                                     | 3 300                               | 3 322                            | 0,36                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (d)                                                           | 3 998                               | 30                               | 0,00                      | 0,000 % éch. 13/05/2033 (d) HKD            | 31 000                              | 3 967                            | 0,43                      | Continuum Green Energy India Pvt                      |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (d)                                                           | 4 997                               | 31                               | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>       |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 26/06/2033                               | 7 045                               | 7 240                            | 0,77                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                                           | 4 997                               | 19                               | 0,00                      | Flourish Century                           |                                     |                                  |                           | Delhi International Airport Ltd.                      |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (d)                                                           | 8 699                               | 27                               | 0,00                      | 6,600 % éch. 04/02/2049 ^ (h)              | \$ 10 900                           | 0                                | 0,00                      | 6,125 % éch. 31/10/2026                               | 1 700                               | 1 704                            | 0,18                      |
| Wynn Macau Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           | Yango Group Co. Ltd.                       |                                     |                                  |                           | HDFC Bank Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 07/03/2029                                                               | 7 500                               | 7 472                            | 0,80                      | 6,900 % éch. 31/10/2022 ^                  | CNY 40 000                          | 92                               | 0,01                      | 3,700 % éch.                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     | 18 078                           | 1,93                      | Yango Justice International Ltd.           |                                     |                                  |                           | 25/08/2026 (e)(g)                                     | 1 600                               | 1 599                            | 0,17                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                  |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/04/2024 ^                  | \$ 17 800                           | 46                               | 0,01                      | IIFL Finance Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| Champion MTN Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 17/02/2025 ^                  | 3 000                               | 3                                | 0,00                      | 7,600 % éch. 10/09/2029                               | 3 000                               | 3 017                            | 0,32                      |
| 2,950 % éch. 15/06/2030                                                               | 2 000                               | 1 784                            | 0,19                      | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^                  | 5 800                               | 6                                | 0,00                      | 8,750 % éch. 24/07/2028                               | 8 800                               | 9 066                            | 0,97                      |
| China Hongqiao Group Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 25/11/2023 ^                  | 4 400                               | 11                               | 0,00                      | IRB Infrastructure Developers Ltd.                    |                                     |                                  |                           |
| 6,925 % éch. 29/11/2028                                                               | 2 700                               | 2 795                            | 0,30                      | 9,250 % éch. 15/04/2023 ^                  | 10 900                              | 28                               | 0,00                      | 7,110 % éch. 11/03/2032                               | 10 700                              | 10 848                           | 1,16                      |
| eHi Car Services Ltd.                                                                 |                                     |                                  |                           |                                            |                                     | 186                              | 0,02                      | JSW Hydro Energy Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| 12,000 % éch. 26/09/2027                                                              | 1 764                               | 886                              | 0,09                      | Total Chine                                |                                     | 4 545                            | 0,49                      | 4,125 % éch. 18/05/2031                               | 8 977                               | 8 325                            | 0,89                      |
| Greentown China Holdings Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | <b>COLOMBIE</b>                            |                                     |                                  |                           | JSW Steel Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 19/05/2029 (i)                                                           | 4 600                               | 4 476                            | 0,48                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>       |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 05/04/2027                               | 4 900                               | 4 848                            | 0,52                      |
| 8,450 % éch. 24/02/2028                                                               | 4 000                               | 4 027                            | 0,43                      | Ecopetrol S.A.                             |                                     |                                  |                           | Manappuram Finance Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
| Health & Happiness International Holdings Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 01/02/2032                    | 2 500                               | 2 619                            | 0,28                      | 7,375 % éch. 12/05/2028                               | 2 790                               | 2 824                            | 0,30                      |
| 9,125 % éch. 24/07/2028                                                               | 6 900                               | 7 245                            | 0,78                      | Promigas S.A. ESP                          |                                     |                                  |                           | Muthoot Finance Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 24/06/2056                    | 1 600                               | 1 628                            | 0,17                      | 5,750 % éch. 04/08/2030                               | 6 200                               | 6 076                            | 0,65                      |
| 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               | 781                                 | 40                               | 0,00                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>               |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 23/04/2029                               | 4 900                               | 4 910                            | 0,53                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | TES colombien                              |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 02/03/2030                               | 12 700                              | 12 685                           | 1,36                      |
| 6,250 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 3 362                               | 76                               | 0,01                      | 11,000 % éch. 22/08/2029                   | COP 500                             | 0                                | 0,00                      | Piramal Finance Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 11,750 % éch. 24/01/2035                   | 37 705 600                          | 10 742                           | 1,15                      | 7,800 % éch. 29/01/2028                               | 8 000                               | 8 153                            | 0,87                      |
| 6,750 % éch. 28/12/2030 (b)                                                           | 6 783                               | 119                              | 0,01                      | <b>INDONÉSIE</b>                           |                                     |                                  |                           | ReNew Pvt Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>       |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 05/03/2027                               | 2 600                               | 2 598                            | 0,28                      |
| 7,721 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 2 300                               | 43                               | 0,00                      | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT       |                                     |                                  |                           | Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.                          |                                     |                                  |                           |
| Longfor Group Holdings Ltd.                                                           |                                     |                                  |                           | 7,150 % éch.                               |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 02/02/2031                               | 4 500                               | 4 454                            | 0,48                      |
| 3,850 % éch. 13/01/2032                                                               | 2 700                               | 2 003                            | 0,21                      |                                            |                                     |                                  |                           | ReNew Wind Energy AP2                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,950 % éch. 16/09/2029                                                               | 7 600                               | 6 386                            | 0,68                      |                                            |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 14/07/2028                               | 7 688                               | 7 443                            | 0,80                      |
| 4,500 % éch. 16/01/2028                                                               | 4 600                               | 4 074                            | 0,44                      |                                            |                                     |                                  |                           | SAEL Ltd.                                             |                                     |                                  |                           |
| Melco Resorts Finance Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 7,800 % éch. 31/07/2031                               | 4 441                               | 4 506                            | 0,48                      |
| 5,375 % éch. 04/12/2029                                                               | 14 800                              | 14 428                           | 1,54                      |                                            |                                     |                                  |                           | Sammaan Capital Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 17/07/2027                                                               | 5 500                               | 5 492                            | 0,59                      |                                            |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 16/10/2030                               | 5 058                               | 5 121                            | 0,55                      |
| 6,500 % éch. 24/09/2033                                                               | 1 800                               | 1 764                            | 0,19                      |                                            |                                     |                                  |                           | 8,950 % éch. 28/08/2028                               | 2 900                               | 3 017                            | 0,32                      |
| MGM China Holdings Ltd.                                                               |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Total Inde                                            |                                     | 124 720                          | 13,34                     |
| 4,750 % éch. 01/02/2027                                                               | 8 455                               | 8 424                            | 0,90                      |                                            |                                     |                                  |                           | <b>INDONÉSIE</b>                                      |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Garuda Indonesia Persero Tbk PT<br>6,500 % éch. 28/12/2031                    | \$ 7 100                            | \$ 6 222                         | 0,67                      | Development Bank of Mongolia LLC<br>8,500 % éch. 03/07/2028 (h)                  | \$ 4 100                            | \$ 4 259                         | 0,45                      |
| Indika Energy Tbk PT<br>8,750 % éch. 07/05/2029                               | 5 400                               | 5 462                            | 0,58                      | Obligation internationale du gouvernement mongol<br>4,450 % éch. 07/07/2031 (i)  | 2 400                               | 2 244                            | 0,24                      |
| LLPL Capital Pte. Ltd.<br>6,875 % éch. 04/02/2039                             | 1 348                               | 1 370                            | 0,15                      | 5,950 % éch. 09/03/2032                                                          | 4 150                               | 4 168                            | 0,45                      |
| Pakuwon Jati Tbk PT<br>4,875 % éch. 29/04/2028                                | 2 300                               | 2 251                            | 0,24                      | 6,625 % éch. 25/02/2030                                                          | 4 000                               | 4 121                            | 0,44                      |
| Sorik Marapi Geothermal Power PT<br>7,750 % éch. 05/08/2031                   | 187                                 | 188                              | 0,02                      | 7,875 % éch. 05/06/2029                                                          | 3 800                               | 4 039                            | 0,43                      |
| Total Indonésie                                                               |                                     | 25 685                           | 2,75                      |                                                                                  |                                     | 27 506                           | 2,94                      |
| ÎLE DE MAN<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                   |                                     |                                  |                           | Total Mongolie                                                                   |                                     | 31 632                           | 3,38                      |
| Gohl Capital Holdings Ltd.<br>7,625 % éch. 29/10/2031 (e)                     | 5 100                               | 4 944                            | 0,53                      | PAYS-BAS<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                        |                                     |                                  |                           |
| 8,300 % éch. 29/04/2036 (e)                                                   | 2 600                               | 2 506                            | 0,27                      | Mong Duong Finance Holdings BV<br>5,125 % éch. 07/05/2029                        | 5 456                               | 5 390                            | 0,58                      |
| Total Île de Man                                                              |                                     | 7 450                            | 0,80                      | Veon Midco BV<br>3,375 % éch. 25/11/2027                                         | 703                                 | 687                              | 0,07                      |
| JAPON<br>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                                  |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 01/06/2031                                                          | 5 550                               | 5 545                            | 0,59                      |
| Hokkaido Electric Power Co., Inc.<br>0,000 % éch. 03/03/2031 (d)              | ¥ 470 000                           | 2 920                            | 0,31                      | 7,450 % éch. 01/06/2033                                                          | 5 750                               | 5 740                            | 0,62                      |
| Nippon Steel Corp.<br>0,000 % éch. 14/02/2031 (d)                             | 270 000                             | 1 672                            | 0,18                      | Yinson Bergeria Production BV<br>8,498 % éch. 31/01/2045                         | 2 269                               | 2 426                            | 0,26                      |
|                                                                               |                                     | 4 592                            | 0,49                      |                                                                                  |                                     | 19 788                           | 2,12                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                         |                                     |                                  |                           | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,300 % éch. 20/12/2054 | 440 000                             | 1 959                            | 0,21                      | Veon Amsterdam<br>7,924 % éch. 25/03/2027                                        | 6 400                               | 6 392                            | 0,68                      |
| Total Japon                                                                   |                                     | 6 551                            | 0,70                      | Total Pays-Bas                                                                   |                                     | 26 180                           | 2,80                      |
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                 |                                     |                                  |                           | NIGERIA<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                         |                                     |                                  |                           |
| West China Cement Ltd.<br>9,900 % éch. 04/12/2028                             | \$ 900                              | 797                              | 0,09                      | Dangote Fertiliser Ltd.<br>7,750 % éch. 05/05/2031                               | 2 700                               | 2 718                            | 0,29                      |
| 10,500 % éch. 11/11/2029                                                      | 6 400                               | 5 557                            | 0,59                      | PAKISTAN<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                |                                     |                                  |                           |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                                            |                                     | 6 354                            | 0,68                      | Pakistan Global Sukuk Programme Co. Ltd.<br>7,950 % éch. 31/01/2029              | 4 206                               | 4 329                            | 0,46                      |
| KAZAKHSTAN<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES                                           |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement pakistanais<br>6,875 % éch. 05/12/2027 | 13 057                              | 13 190                           | 1,41                      |
| Development Bank of Kazakhstan JSC<br>18,400 % éch. 16/10/2028                | KZT 427 500                         | 931                              | 0,10                      | 6,975 % éch. 24/04/2029                                                          | 2 200                               | 2 207                            | 0,24                      |
| LUXEMBOURG<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                   |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 08/04/2031                                                          | 12 000                              | 12 106                           | 1,29                      |
| Green Palm Bidco SARL<br>5,957 % éch. 30/06/2041                              | \$ 2 300                            | 2 326                            | 0,25                      | 7,875 % éch. 31/03/2036 (i)                                                      | 3 700                               | 3 704                            | 0,40                      |
| 6,462 % éch. 30/06/2046                                                       | 2 300                               | 2 331                            | 0,25                      | 8,875 % éch. 08/04/2051 (i)                                                      | 7 200                               | 7 279                            | 0,78                      |
| Total Luxembourg                                                              |                                     | 4 657                            | 0,50                      | Pakistan Water & Power Development Authority<br>7,500 % éch. 04/06/2031          | 4 900                               | 4 802                            | 0,51                      |
| ÎLE MAURICE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                  |                                     |                                  |                           | Total Pakistan                                                                   |                                     | 47 617                           | 5,09                      |
| Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.<br>4,250 % éch. 25/03/2027          | 2 609                               | 2 578                            | 0,28                      | PHILIPPINES<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                     |                                  |                           |
| Greenko Power Ltd.<br>4,300 % éch. 13/12/2028                                 | 2 368                               | 2 266                            | 0,24                      | Petron Corp.<br>7,350 % éch. 22/08/2028 (e)                                      | 1 500                               | 1 521                            | 0,16                      |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % éch. 27/09/2028               | 12 510                              | 12 616                           | 1,35                      | San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,125 % éch. 02/12/2029 (e)            | 574                                 | 571                              | 0,06                      |
| India Cleantech Energy<br>4,700 % éch. 10/08/2026                             | 1 186                               | 1 182                            | 0,13                      | 8,375 % éch. 20/10/2030 (e)                                                      | 8 500                               | 8 460                            | 0,91                      |
| India Green Power Holdings<br>4,000 % éch. 22/02/2027                         | 5 042                               | 4 981                            | 0,53                      | 8,750 % éch. 12/06/2029 (e)                                                      | 11 500                              | 11 665                           | 1,25                      |
| Total Île Maurice                                                             |                                     | 23 623                           | 2,53                      | 8,950 % éch. 24/04/2030 (e)                                                      | 5 050                               | 5 135                            | 0,55                      |
| MONGOLIE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                     |                                  |                           | Total Philippines                                                                |                                     | 27 352                           | 2,93                      |
| Golomt Bank<br>7,950 % éch. 14/05/2029 (i)                                    | 4 100                               | 4 126                            | 0,44                      | SINGAPOUR<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                         |                                     |                                  |                           | GLP Pte. Ltd.<br>4,600 % éch. 29/06/2027 (e)                                     | 2 300                               | 1 219                            | 0,13                      |
| City of Ulaanbaatar Mongolia<br>7,750 % éch. 21/08/2027                       | 8 500                               | 8 675                            | 0,93                      | 7,865 % éch. 17/11/2026 (e)                                                      | 6 000                               | 3 478                            | 0,37                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 20/05/2028                                                          | 8 600                               | 7 287                            | 0,78                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Medco Cypress Tree Pte. Ltd.<br>8,625 % éch. 19/05/2030 (i)                      | 9 600                               | 10 009                           | 1,07                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Medco Maple Tree Pte. Ltd.<br>8,960 % éch. 27/04/2029                            | 3 800                               | 3 922                            | 0,42                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Seaspan Corp. Pte. Ltd.<br>5,500 % éch. 01/08/2029                               | 8 300                               | 8 150                            | 0,87                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Yinson Production Financial Services Pte. Ltd.<br>9,625 % éch. 03/05/2029        | 5 000                               | 5 298                            | 0,57                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Total Singapour                                                                  |                                     | 39 363                           | 4,21                      |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | AFRIQUE DU SUD<br>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Sasol Financing USA LLC<br>4,500 % éch. 08/11/2027                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | CORÉE DU SUD<br>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                              |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | LG Chem Ltd.<br>1,600 % éch. 18/07/2030                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | ESPAGNE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % éch.<br>14/01/2032 (e)(g)        |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | EnfraGen Energia Sur S.A.U.<br>8,499 % éch. 30/06/2032                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Total Espagne                                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | SRI LANKA<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sri-lankais<br>3,100 % éch. 15/01/2030 |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,350 % éch. 15/03/2033                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/06/2035                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/05/2036 (i)                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/02/2038                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/04/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Total Sri Lanka                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | THAÏLANDE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | GC Treasury Center Co. Ltd.<br>6,500 % éch.<br>10/09/2030 (e)                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch.<br>10/03/2035 (e)                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Kasikornbank PCL<br>4,000 % éch.<br>10/02/2027 (e)(g)                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Muangthai Capital PCL<br>7,550 % éch. 21/07/2030                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Thaioil Treasury Center Co. Ltd.<br>6,100 % éch.<br>15/01/2031 (e)(i)            |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Total Thaïlande                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | ROYAUME-UNI<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC<br>8,000 % éch.<br>07/03/2028 (e)(g)                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | ICBC Standard Bank PLC<br>20,000 % éch.<br>18/09/2029                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 20,000 % éch.<br>13/12/2029                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC<br>8,000 % éch.<br>27/09/2029 (e)(g)                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | NatWest Group PLC<br>7,300 % éch.<br>19/11/2034 (e)(g)                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Standard Chartered PLC<br>4,750 % éch.<br>14/01/2031 (e)(g)                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch.<br>08/06/2033 (e)(g)                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch.<br>16/01/2032 (e)(g)                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch.<br>15/08/2027 (e)(g)(i)                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch.<br>08/03/2030 (e)(g)                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | Vedanta Resources Finance PLC<br>7,375 % éch.<br>13/07/2034 (a)                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch.<br>13/07/2037 (a)                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 9,125 % éch. 15/10/2032                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 9,475 % éch. 24/07/2030                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                               |                                     |                                  |                           | 10,250 % éch.<br>03/06/2028                                                      |                                     |                                  |                           |

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

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 10,875 % éch. 17/09/2029 \$                          | 7 700                               | 8 187                            | 0,88                      | Celestial Dynasty Ltd.               | 6 375                               | 6 264                            | 0,67                      | Yango Justice International Ltd.         |                                     |                                  |                           |
| 11,250 % éch. 03/12/2031                             | 6 000                               | 6 587                            | 0,70                      | 6,375 % éch. 22/08/2028 \$           | 6 300                               | 6 264                            | 0,67                      | 10,250 % éch.                            |                                     |                                  |                           |
| Total Royaume-Uni                                    |                                     | 100 407                          | 10,73                     | Champion Path Holdings Ltd.          |                                     | 873                              | 0,09                      | 15/09/2022 ^                             | \$ 4 500                            | \$ 12                            | 0,00                      |
| <b>ÉTATS-UNIS</b>                                    |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 27/01/2028              | 900                                 |                                  |                           | Total des Instruments à court terme      |                                     | 12 949                           | 1,38                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | Nan Fung Treasury Ltd.               |                                     | 2 201                            | 0,24                      | Total des Valeurs mobilières             |                                     | \$ 925 892                       | 99,00                     |
| RD Michigan Property Owner LLC                       |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 21/05/2036              | 2 200                               | 2 201                            | 0,24                      | <b>ACTIONS</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                              | 2 300                               | 2 294                            | 0,25                      | NWD Finance BVI Ltd.                 |                                     | 2 370                            | 0,25                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>               |                                     |                                  |                           | 10,131 % éch. 30/07/2026 (e)         | 2 450                               | 6 283                            | 0,67                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |                                     |                                  |                           |
| Billets du Trésor américain                          |                                     |                                  |                           | 12,179 % éch. 30/07/2026 (e)         | 6 750                               |                                  |                           | PIMCO Select Funds                       |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 31/12/2030                              | 13 700                              | 13 378                           | 1,43                      | NWD MTN Ltd.                         |                                     | 6 873                            | 0,73                      | plc - Fonds PIMCO                        |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 31/01/2031 (i)                          | 10 800                              | 10 597                           | 1,13                      | 4,125 % éch. 18/07/2029 (i)          | 7 991                               | 4 833                            | 0,52                      | US Dollar Short-                         |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 30/06/2030                              | 27 500                              | 27 184                           | 2,91                      | 8,625 % éch. 08/02/2028              | 3 500                               | 3 391                            | 0,36                      | Term Floating                            |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 15/11/2035                              | 9 500                               | 9 191                            | 0,98                      | SJM International Ltd.               |                                     | 3 086                            | 0,33                      | NAV Fund (f)                             | 2 883 088                           | 28 751                           | 3,08                      |
| 4,125 % éch. 15/02/2036 (i)                          | 4 022                               | 3 925                            | 0,42                      | 6,500 % éch. 15/01/2031              | 3 250                               |                                  |                           | PIMCO Specialty Funds                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     | 64 275                           | 6,87                      | Studio City Finance Ltd.             |                                     | 15 147                           | 1,62                      | Ireland p.l.c. -                         |                                     |                                  |                           |
| Total États-Unis                                     |                                     | 66 569                           | 7,12                      | 5,000 % éch. 15/01/2029              | 15 800                              | 3 637                            | 0,39                      | Fonds PIMCO                              |                                     |                                  |                           |
| <b>VIETNAM</b>                                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/01/2028              | 3 637                               |                                  |                           | China Bond                               |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | Yuexiu REIT MTN Co. Ltd.             |                                     | 4 595                            | 0,49                      | Fund (f)                                 | 419 161                             | 6 564                            | 0,70                      |
| Obligation internationale du gouvernement vietnamien |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 12/02/2029              | 4 500                               |                                  |                           |                                          |                                     | 35 315                           | 3,78                      |
| 5,500 % éch. 12/03/2028                              | 792                                 | 766                              | 0,08                      | Total Îles Vierges britanniques      |                                     | 68 310                           | 7,30                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |                                     |                                  |                           |
| <b>ÎLES VIERGES BRITANNIQUES</b>                     |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>     |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc -                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>BILLETS À COURT TERME</b>         |                                     |                                  |                           | Fonds PIMCO                              |                                     |                                  |                           |
| Cas Capital Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | CS Treasury Management Services Ltd. |                                     | 11 793                           | 1,26                      | US Dollar Short                          |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 13/01/2031 (e)                          | 8 700                               | 8 757                            | 0,94                      | 9,000 % éch. 05/12/2026 (e)          | 11 428                              |                                  |                           | Maturity UCITS                           |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Kona Spc Ltd.                        |                                     | 1 144                            | 0,12                      | ETF (f)                                  | 48 700                              | 4 893                            | 0,52                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 5,718 % éch. 15/09/2026              | 1 000                               |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement         |                                     | \$ 40 208                        | 4,30                      |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Court | 09/2026              | 2                     | \$ (2)                                  | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 17                    | (33)                                    | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 56                    | 21                                      | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026              | 67                    | (62)                                    | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026              | 10                    | (33)                                    | 0,00                |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ (109)                                | (0,01)              |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                      |                       | \$ (109)                                | (0,01)              |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence                        | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | (1,000) %              | 20/12/2029         | \$ 6 300                            | \$ 92                                   | 0,01                   |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 8 000                            | \$ 70                                   | 0,01                   |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable<br>à payer/à<br>recevoir             | Indice de taux variable        | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------|--------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %      | 18/03/2031         | £ 8 010              | \$ (227)                                | (0,02)                 |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,750        | 15/12/2051         | \$ 3 200             | 65                                      | 0,01                   |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750        | 17/12/2035         | 1 530                | (4)                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | CNREPOFIX CNY à 3 mois         | 1,500        | 16/09/2031         | CNY 32 200           | (41)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | KLIBOR MYR à 3 mois            | 3,500        | 16/09/2031         | MYR 47 600           | 8                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | AUD-BBR-BBSW à 6 mois          | 4,250        | 18/03/2036         | AUD 8 220            | (2)                                     | 0,00                   |
|                                                    |                                |              |                    |                      | \$ (201)                                | (0,02)                 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                |              |                    |                      | \$ (39)                                 | 0,00                   |

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

| OPTIONS ACHETÉES  |                                            |                 |                   |                                  |         |              |                     |
|-------------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| OPTIONS DE CHANGE |                                            |                 |                   |                                  |         |              |                     |
| Contrepartie      | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût    | Juste valeur | En % de l'actif net |
| BOA               | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 12 908                           | \$ 131  | \$ 0         | 0,00                |
|                   | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 8 192                            | 56      | 0            | 0,00                |
|                   |                                            |                 |                   |                                  | \$ 187  | \$ 0         | 0,00                |
| OPTIONS VENDUES   |                                            |                 |                   |                                  |         |              |                     |
| OPTIONS DE CHANGE |                                            |                 |                   |                                  |         |              |                     |
| Contrepartie      | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
| BOA               | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 12 908                           | \$ (46) | \$ 0         | 0,00                |
|                   | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 8 192                            | (18)    | 0            | 0,00                |
|                   |                                            |                 |                   |                                  | \$ (64) | \$ 0         | 0,00                |

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

| SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION <sup>(1)</sup> |                                                      |                        |                    |                                     |                           |                                         |                 |                        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| Contrepartie                                                                                                            | Entité de référence                                  | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
| BPS                                                                                                                     | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %              | 20/12/2033         | \$ 9 300                            | \$ (452)                  | \$ 46                                   | \$ (406)        | (0,04)                 |
| BRC                                                                                                                     | Honda Motor Co Ltd.                                  | (1,000)                | 20/12/2029         | ¥ 1 800 000                         | (350)                     | 137                                     | (213)           | (0,02)                 |
| CBK                                                                                                                     | Toyota Motor Corp.                                   | (1,000)                | 20/12/2029         | 1 325 000                           | (380)                     | 152                                     | (228)           | (0,03)                 |
| GST                                                                                                                     | Temasek Financial Ltd.                               | (1,000)                | 20/06/2035         | \$ 1 900                            | (137)                     | 17                                      | (120)           | (0,01)                 |
|                                                                                                                         | Toyota Motor Corp.                                   | (1,000)                | 20/12/2034         | ¥ 320 700                           | (171)                     | 71                                      | (100)           | (0,01)                 |
| JPM                                                                                                                     | Toyota Motor Corp.                                   | (1,000)                | 20/12/2029         | 1 325 000                           | (386)                     | 158                                     | (228)           | (0,03)                 |
| MYC                                                                                                                     | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)                | 20/12/2034         | \$ 10 500                           | (503)                     | 20                                      | (483)           | (0,05)                 |
|                                                                                                                         | Temasek Financial Ltd.                               | (1,000)                | 20/12/2034         | 12 800                              | (884)                     | 114                                     | (770)           | (0,08)                 |
|                                                                                                                         |                                                      |                        |                    |                                     | \$ (3 263)                | \$ 715                                  | \$ (2 548)      | (0,27)                 |

| SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION <sup>(2)</sup> |                                                      |                      |                 |                                  |                        |                                  |              |                     |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| Contrepartie                                                                                                            | Entité de référence                                  | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
| CBK                                                                                                                     | Obligation internationale du gouvernement vietnamien | 1,000 %              | 20/12/2027      | \$ 9 100                         | \$ (263)               | \$ 350                           | \$ 87        | 0,01                |
| DBL                                                                                                                     | Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.            | 1,000                | 20/06/2028      | 6 900                            | (20)                   | 28                               | 8            | 0,00                |
| GST                                                                                                                     | Alibaba Group Holding Ltd.                           | 1,000                | 20/06/2029      | 5 950                            | 32                     | 40                               | 72           | 0,01                |
| MYC                                                                                                                     | Obligation internationale du gouvernement philippin  | 1,000                | 20/06/2031      | 7 700                            | 35                     | 94                               | 129          | 0,01                |
|                                                                                                                         | SoftBank Group Corp.                                 | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 442 800                        | (46)                   | 28                               | (18)         | 0,00                |
|                                                                                                                         |                                                      |                      |                 |                                  | \$ (262)               | \$ 540                           | \$ 278       | 0,03                |

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |            | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |         | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |      |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|------------|--------------------|-----|-----------------------|---------|-----------------------------------------|---------------------|--------|------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 1 232      | \$                | 881        | \$                 | 27  | \$                    | 0       | \$                                      | 27                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | NZD             | 6 326      |                   | 3 736      |                    | 138 |                       | 0       |                                         | 138                 | 0,02   |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 518        |                   | 406        |                    | 6   |                       | 0       |                                         | 6                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 84         | CAD               | 120        |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 2 847      | NZD               | 5 040      |                    | 20  |                       | 0       |                                         | 20                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | CAD             | 119        | \$                | 84         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| BOA          | 08/2026           | NZD             | 5 040      |                   | 2 850      |                    | 0   |                       | (20)    |                                         | (20)                | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 13         |                   | 10         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 18         | ¥                 | 2 912      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 235        | KRW               | 357 353    |                    | 0   |                       | (4)     |                                         | (4)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 478      | NOK               | 14 316     |                    | 0   |                       | (31)    |                                         | (31)                | 0,00   |      |
|              | 08/2026           |                 | 1 465      | HKD               | 11 465     |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | KZT             | 12 011     | \$                | 24         |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | PHP             | 833 955    |                   | 13 524     |                    | 0   |                       | (25)    |                                         | (25)                | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | \$              | 13 189     | PHP               | 798 282    |                    | 0   |                       | (221)   |                                         | (221)               | (0,02) |      |
|              | BPS               | 07/2026         | CNH        | 6 865             | \$         | 1 015              |     | 3                     |         | 0                                       |                     | 3      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CNY        | 21 345            |            | 3 129              |     | 0                     |         | (6)                                     |                     | (6)    | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | £          | 10                |            | 14                 |     | 0                     |         | 0                                       |                     | 0      | 0,00 |
| 07/2026      |                   | IDR             | 27 065 132 |                   | 1 504      |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | ILS             | 2 291      |                   | 777        |                    | 8   |                       | 0       |                                         | 8                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | INR             | 717 156    |                   | 7 567      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 043 500  |                   | 6 525      |                    | 105 |                       | 0       |                                         | 105                 | 0,01   |      |
|              | 07/2026           | THB             | 6 003      |                   | 180        |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 7 629      | £                 | 5 693      |                    | 0   |                       | (73)    |                                         | (73)                | (0,01) |      |
|              | 07/2026           |                 | 6 734      | INR               | 638 852    |                    | 6   |                       | 0       |                                         | 6                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 3 145      | ¥                 | 506 750    |                    | 0   |                       | (27)    |                                         | (27)                | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 77         | TWD               | 2 434      |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 08/2026           |                 | 14         | £                 | 10         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 16 643 777 | \$                | 918        |                    | 0   |                       | (5)     |                                         | (5)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | THB             | 4 589      |                   | 142        |                    | 3   |                       | 0       |                                         | 3                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | \$              | 1 788      | IDR               | 32 361 264 |                    | 7   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 8 352      | INR               | 795 307    |                    | 0   |                       | (5)     |                                         | (5)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 199        | THB               | 6 518      |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
| BRC          | 12/2026           |                 | 704        | IDR               | 12 815 865 |                    | 2   |                       | 0       |                                         | 2                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | ILS             | 2 532      | \$                | 856        |                    | 5   |                       | 0       |                                         | 5                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | NZD             | 9 188      |                   | 5 434      |                    | 207 |                       | 0       |                                         | 207                 | 0,02   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 555      | INR               | 150 211    |                    | 29  |                       | 0       |                                         | 29                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 4 616      | MYR               | 18 749     |                    | 0   |                       | (26)    |                                         | (26)                | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 50         | TRY               | 2 385      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| BSH          | 08/2026           | SGD             | 29         | \$                | 23         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 328        | ¥                 | 52 199     |                    | 0   |                       | (7)     |                                         | (7)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 4 932      | NZD               | 8 730      |                    | 34  |                       | 0       |                                         | 34                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | NZD             | 8 730      | \$                | 4 938      |                    | 0   |                       | (34)    |                                         | (34)                | 0,00   |      |
|              | CBK               | 07/2026         | CHF        | 221               |            | 277                |     | 3                     |         | 0                                       |                     | 3      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | ILS        | 2 555             |            | 879                |     | 22                    |         | 0                                       |                     | 22     | 0,00 |
| 07/2026      |                   | \$              | 1 172      | NOK               | 11 125     |                    | 0   |                       | (47)    |                                         | (47)                | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   |                 | 906        | PLN               | 3 310      |                    | 0   |                       | (25)    |                                         | (25)                | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 28         | TWD               | 872        |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | ILS             | 4 376      | \$                | 1 511      |                    | 41  |                       | 0       |                                         | 41                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | INR             | 335 047    |                   | 3 574      |                    | 49  |                       | 0       |                                         | 49                  | 0,01   |      |
|              | 09/2026           | COP             | 36 693 344 |                   | 9 458      |                    | 0   |                       | (1 002) |                                         | (1 002)             | (0,10) |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 54 529 511 |                   | 3 020      |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | KZT             | 25 082     |                   | 50         |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | PHP             | 1 155      |                   | 19         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | THB             | 12 767     |                   | 385        |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | \$              | 901        | IDR               | 16 075 318 |                    | 0   |                       | (10)    |                                         | (10)                | 0,00   |      |
|              | 10/2026           | UZS             | 11 798 307 | \$                | 902        |                    | 0   |                       | (66)    |                                         | (66)                | (0,01) |      |
|              | 12/2026           | \$              | 3 020      | IDR               | 54 894 630 |                    | 3   |                       | 0       |                                         | 3                   | 0,00   |      |
|              | DUB               | 07/2026         | INR        | 52 744            | \$         | 559                |     | 2                     |         | 0                                       |                     | 2      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | SGD        | 46                |            | 35                 |     | 0                     |         | 0                                       |                     | 0      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | \$         | 1 030             | CNH        | 6 967              |     | 0                     |         | (4)                                     |                     | (4)    | 0,00 |
| 07/2026      |                   |                 | 1 170      | NOK               | 10 870     |                    | 0   |                       | (71)    |                                         | (71)                | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   |                 | 905        | PLN               | 3 358      |                    | 0   |                       | (12)    |                                         | (12)                | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 15         | INR               | 1 447      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           |                 | 35         | SGD               | 46         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 763        | IDR               | 13 846 620 |                    | 5   |                       | 0       |                                         | 5                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 559        | INR               | 53 101     |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |      |
|              | 10/2026           | UZS             | 14 703 803 | \$                | 1 145      |                    | 0   |                       | (61)    |                                         | (61)                | (0,01) |      |
|              | 11/2026           |                 | 27 361 269 |                   | 2 095      |                    | 0   |                       | (139)   |                                         | (139)               | (0,01) |      |
|              | 12/2026           |                 | 17 812 158 |                   | 1 371      |                    | 0   |                       | (79)    |                                         | (79)                | (0,01) |      |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 6 830      |                   | 1 010      |                    | 3   |                       | 0       |                                         | 3                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | HKD             | 169        |                   | 22         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 15 962     |                   | 12 511     |                    | 171 |                       | 0       |                                         | 171                 | 0,02   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 2 161      | CNH               | 14 701     |                    | 4   |                       | 0       |                                         | 4                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 25         | HKD               | 194        |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 7 160      | ¥                 | 1 158 424  |                    | 0   |                       | (32)    |                                         | (32)                | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 3 288      | PLN               | 12 089     |                    | 0   |                       | (72)    |                                         | (72)                | (0,01) |      |
|              | 08/2026           | CNH             | 14 668     | \$                | 2 161      |                    | 0   |                       | (4)     |                                         | (4)                 | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 653      |                   | 577        |                    | 22  |                       | 0       |                                         | 22                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | ¥               | 1 155 393  |                   | 7 160      |                    | 32  |                       | 0       |                                         | 32                  | 0,00   |      |
|              | GLM               | 07/2026         | HKD        | 294 592           |            | 38 093             |     | 511                   |         | 0                                       |                     | 511    | 0,05 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| IND JPM      | 07/2026           | INR             | 170 374 \$        | 1 797              | \$ 0                  | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 8 091 CAD         | 11 514             | 24                    | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 470 CNH           | 3 181              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 11 497 \$         | 8 091              | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 72 430            | 2 243              | 49                    | 49                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 822 IDR         | 50 719 291         | 7                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 4 771 INR         | 458 359            | 39                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 49 MNT            | 179 480            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2027           |                 | 59                | 223 736            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2027           |                 | 58                | 224 965            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2028           |                 | 174               | 689 529            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2028           |                 | 160               | 653 847            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2029           |                 | 149               | 621 852            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2029           |                 | 137               | 589 858            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2030           |                 | 126               | 557 864            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2030           |                 | 116               | 526 220            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2031           |                 | 106               | 490 644            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 38 073 HKD        | 294 592            | 0                     | (492)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | AUD             | 5 332 \$          | 3 801              | 107                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS             | 6 716             | 2 249              | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 46 592            | 4 707              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 630 INR         | 249 043            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 833 PLN         | 6 676              | 0                     | (56)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 8 433 \$          | 2 887              | 54                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 5 445 HKD         | 42 593             | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 4 707 NOK         | 46 612             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 89 133 \$         | 176                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 16 297            | 502                | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 5 428 INR         | 520 535            | 34                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 15 061 MXN        | 261 667            | 0                     | (181)                                   | (0,02)              |
|              | 10/2026           | UZS             | 1 464 508 \$      | 116                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | MXN             | 22 063            | 1 251              | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | UZS             | 752 985           | 56                 | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 553               | 387                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 6 277             | 8 016              | 234                   | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | CNH             | 15 000            | 2 151              | 0                     | (63)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | €               | 244               | 283                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 1 077             | 138                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 52 953            | 561                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 62 200            | 388                | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 15 026            | 1 512              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 711 AUD         | 3 929              | 11                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 50 €              | 43                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 840 ILS           | 2 442              | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 306 ¥             | 48 639             | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 058 KRW         | 6 150 900          | 0                     | (85)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 2 786 NOK         | 25 833             | 0                     | (175)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 014 NZD         | 1 744              | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 3 929 \$          | 2 709              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 512 NOK         | 15 032             | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 14 100            | 422                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 526 INR         | 241 224            | 8                     | (4)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | IDR             | 11 886 534 \$     | 660                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 790 021           | 4 893              | 32                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 43                | 34                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 110 €             | 97                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 £              | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 56 SGD            | 72                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 2 \$              | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 874 INR           | 84 108             | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 808 TRY         | 132 182            | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 3 £               | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 09/2026           |                 | 552 IDR           | 9 814 343          | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 49 995 \$         | 7 325              | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 5 432             | 7 190              | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 135 CNH         | 15 000             | 79                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 1 151 INR         | 110 287            | 13                    | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           |                 | 7 190 £           | 5 432              | 20                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 5 116 HKD         | 40 018             | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 3 932 \$          | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 21 221            | 657                | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 699 IDR           | 12 453 359         | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 11 153 \$         | 1 649              | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 8 771             | 10 231             | 204                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | £               | 248               | 328                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 24                | 19                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 200 AUD         | 3 188              | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 256 €          | 9 015              | 52                    | (2)                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 797 ¥             | 126 654            | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12 754 SGD        | 16 517             | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 3 188 \$          | 2 198              | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 8 947             | 10 191             | 0                     | (52)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 16 480            | 12 754             | 0                     | (16)                                    | 0,00                |



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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 08/2026           | \$              | 328 £             | 248 \$             | 2 \$                  | 2 \$                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 19 SGD            | 24                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 11 835 \$         | 8 583              | 242                   | 242                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | IDR             | 22 346 730        | 1 260              | 16                    | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 74 CAD            | 105                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 105 \$            | 74                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 77 €              | 67                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | HKD             | 68 \$             | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 921 PLN           | 3 366              | 0                     | (26)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           |                 | 8 041 CHF         | 6 492              | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 6 469 \$          | 8 041              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 815           | \$ (3 514)            | \$ (699)                                | (0,07)              |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 999 \$            | 689 \$             | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 706 AUD           | 991                | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 688               | 999                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | AUD             | 524 \$            | 364                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 566 AUD           | 795                | 0                     | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 364               | 524                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 13 \$             | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           |                 | 511               | 355                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 698 AUD           | 979                | 0                     | (20)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 354               | 511                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 833 \$            | 577                | 3                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 30 AUD            | 43                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 15 \$             | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 488 AUD           | 709                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD             | 169 \$            | 117                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 171 AUD           | 240                | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 117               | 169                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 11              | \$ (68)               | \$ (57)                                 | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF             | 25 \$             | 31 \$              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$              | 36 CHF            | 28                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | CHF             | 22 \$             | 28                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           |                 | 37                | 47                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 848 CHF         | 1 443              | 0                     | (59)                                    | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 102 \$            | 130                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 104 CHF         | 1 648              | 0                     | (61)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CHF             | 10 \$             | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | \$              | 25 CHF            | 20                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           |                 | 1 762             | 1 422              | 6                     | 0                                       | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | CHF             | 1 544 \$          | 1 908              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 908 CHF         | 1 538              | 6                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF             | 8 \$              | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 005 CHF         | 1 576              | 0                     | (51)                                    | (0,01)              |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 1 531 \$          | 1 896              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 896 CHF         | 1 525              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 18              | \$ (180)              | \$ (162)                                | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 48 €              | 41 \$              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | €               | 5 415 \$          | 6 177              | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 50 108 €          | 43 031             | 6                     | (917)                                   | (0,10)              |
|              | 08/2026           | €               | 164 \$            | 187                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           |                 | 42                | 49                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 46 320 €          | 39 728             | 0                     | (899)                                   | (0,10)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 065             | 913                | 0                     | (21)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | €               | 38 577 \$         | 43 997             | 0                     | (108)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 08/2026           | \$              | 44 056 €          | 38 577             | 108                   | 0                                       | 0,01                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | € 43 192        | \$ 49 121         | \$ 46              | \$ (306)              | \$ (260)                                | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 2 343        | € 2 020           | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 67            | \$ 77             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 46 390       | € 40 788          | 305                | 0                     | 305                                     | 0,03                |
| SOG          | 07/2026           | € 40 788        | \$ 46 397         | 0                  | (237)                 | (237)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 49 287       | € 42 250          | 0                  | (981)                 | (981)                                   | (0,10)              |
|              | 08/2026           | 46 460          | 40 788            | 236                | 0                     | 236                                     | 0,03                |
| SSB          | 07/2026           | 38              | 33                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 33            | \$ 38             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 702             | \$ (3 519)            | \$ (2 817)                              | (0,30)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 22 037       | £ 16 414          | \$ 0               | \$ (251)              | \$ (251)                                | (0,04)              |
| BPS          | 07/2026           | £ 14 835        | \$ 19 565         | 0                  | (125)                 | (125)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 23 927       | £ 17 854          | 1                  | (230)                 | (229)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 19 564          | 14 835            | 125                | 0                     | 125                                     | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | £ 8             | \$ 10             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 10              | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 23 071       | £ 17 157          | 0                  | (300)                 | (300)                                   | (0,03)              |
| MBC          | 07/2026           | 540             | 403               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 3 482         | \$ 4 583          | 0                  | (39)                  | (39)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 583        | £ 3 482           | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 17 160        | \$ 22 713         | 0                  | (62)                  | (62)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 234        | £ 917             | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 22 712          | 17 160            | 63                 | 0                     | 63                                      | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | £ 17 082        | \$ 22 566         | 0                  | (107)                 | (107)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 22 565       | £ 17 082          | 107                | 0                     | 107                                     | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £ 178           | \$ 236            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 236          | £ 178             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 336             | \$ (1 138)            | \$ (802)                                | (0,09)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 13 432       | SGD 17 127        | \$ 0               | \$ (190)              | \$ (190)                                | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 8 053           | 10 407            | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD 15 013      | \$ 11 599         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 22 592       | SGD 28 853        | 0                  | (286)                 | (286)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | 11 599          | 14 978            | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD 31          | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 150             | 116               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 913          | SGD 1 172         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 502         | \$ 389            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 18 131          | 14 016            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 15 517       | SGD 19 792        | 0                  | (215)                 | (215)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 14 016          | 18 090            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 18 269      | \$ 14 087         | 0                  | (38)                  | (38)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 26 226       | SGD 33 458        | 0                  | (359)                 | (359)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | 14 087          | 18 227            | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 42              | 53                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 145             | 188               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD 3 628       | \$ 2 802          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2 802        | SGD 3 620         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 35 309      | \$ 27 266         | 0                  | (33)                  | (33)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 35           | SGD 45            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 27 266          | 35 230            | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | 209             | 270               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 51          | \$ 39             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 97              | \$ (1 141)            | \$ (1 044)                              | (0,11)              |

|                                                    |             |        |
|----------------------------------------------------|-------------|--------|
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | \$ (7 851)  | (0,84) |
| Total des Investissements                          | \$ 958 101  | 102,45 |
| Autres actifs et passifs à court terme             | \$ (22 953) | (2,45) |
| Actif net                                          | \$ 935 148  | 100,00 |

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.



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

- (b) Titre à rémunération en nature.  
(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.  
(d) Titre à coupon zéro.  
(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.  
(f) Affilié au Fonds.  
(g) Titre convertible conditionnel.  
(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,24 %) :

| Description de l'émetteur        | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat            | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|----------------------------------|---------|-----------------|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| Development Bank of Mongolia LLC | 8,500 % | 03/07/2028      | 14/10/2025 - 22/01/2026 | \$ 4 204 | \$ 4 259     | 0,45                |
| Flourish Century                 | 6,600   | 04/02/2049      | 03/02/2026              | 0        | 0            | 0,00                |
|                                  |         |                 |                         | \$ 4 204 | \$ 4 259     | 0,45                |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 58 280 \$ (31 décembre 2025 : 9 943 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 3 101 \$ (31 décembre 2025 : 12 679 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 9 248 \$ (31 décembre 2025 : 3 535 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 392                                                                            | \$ 912 133                                           | \$ 13 367                                         | \$ 925 892        |
| Fonds d'investissement                        | 40 208                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 40 208            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (35)                                                                              | (7 964)                                              | 0                                                 | (7 999)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 40 565</b>                                                                  | <b>\$ 904 169</b>                                    | <b>\$ 13 367</b>                                  | <b>\$ 958 101</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 2                                                                              | \$ 965 960                                           | \$ 17 720                                         | \$ 983 682          |
| Fonds d'investissement                        | 62 936                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 62 936              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 2 439                                                | 0                                                 | 2 439               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 62 938</b>                                                                  | <b>\$ 968 399</b>                                    | <b>\$ 17 720</b>                                  | <b>\$ 1 049 057</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,760 %        | 29/06/2026        | 06/07/2026         | \$ (300)         | \$ (300)                                 | (0,03)              |
| BPS                                           | 3,000          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (531)            | (540)                                    | (0,06)              |
| JPS                                           | 3,670          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (2 811)          | (2 812)                                  | (0,30)              |
|                                               | 3,710          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (1 196)          | (1 196)                                  | (0,13)              |
|                                               | 3,720          | 08/06/2026        | 06/07/2026         | (793)            | (794)                                    | (0,08)              |
|                                               | 3,760          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (1 600)          | (1 600)                                  | (0,17)              |
|                                               | 3,760          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (3 196)          | (3 196)                                  | (0,34)              |
| MYI                                           | (1,250)        | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (411)            | (408)                                    | (0,04)              |
|                                               | 3,000          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (4 636)          | (4 636)                                  | (0,50)              |
|                                               | 3,250          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (17 364)         | (17 366)                                 | (1,86)              |
|                                               | 3,450          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 757)          | (4 848)                                  | (0,52)              |
|                                               | 3,470          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (7 223)          | (7 224)                                  | (0,77)              |
| SCX                                           | 2,750          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 153)          | (1 158)                                  | (0,12)              |
|                                               | 3,350          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 471)          | (2 484)                                  | (0,27)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (48 562)</b>                       | <b>(5,19)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (278)                                                   | \$ 330                  | \$ 52                             | \$ 370                                                     | \$ (320)                | \$ 50                             |
| BOA          | (570)                                                      | 630                     | 60                                | 111                                                        | 0                       | 111                               |
| BPS          | (1 550)                                                    | 1 640                   | 90                                | (749)                                                      | 864                     | 115                               |
| BRC          | (5)                                                        | 0                       | (5)                               | 1 314                                                      | (1 480)                 | (166)                             |
| BSH          | (921)                                                      | 1 100                   | 179                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| CBK          | (1 199)                                                    | 1 160                   | (39)                              | (152)                                                      | 290                     | 138                               |
| DBL          | 8                                                          | 0                       | 8                                 | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| DUB          | (576)                                                      | 610                     | 34                                | (391)                                                      | 383                     | (8)                               |
| FAR          | (613)                                                      | 630                     | 17                                | 232                                                        | (340)                   | (108)                             |
| GLM          | 593                                                        | (580)                   | 13                                | 102                                                        | 0                       | 102                               |
| GST          | (19)                                                       | 10                      | (9)                               | 81                                                         | 120                     | 201                               |
| IND          | (492)                                                      | 310                     | (182)                             | 34                                                         | 0                       | 34                                |
| JPM          | (281)                                                      | 380                     | 99                                | (346)                                                      | 280                     | (66)                              |
| MBC          | (174)                                                      | 160                     | (14)                              | 703                                                        | (910)                   | (207)                             |
| MYC          | (1 271)                                                    | 1 328                   | 57                                | (1 571)                                                    | 1 598                   | 27                                |
| MYI          | 30                                                         | (10)                    | 20                                | 318                                                        | (320)                   | (2)                               |
| NSL          | 18                                                         | 0                       | 18                                | 67                                                         | 0                       | 67                                |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 5                                                          | 0                       | 5                                 |
| SCX          | 63                                                         | (80)                    | (17)                              | 16                                                         | 0                       | 16                                |
| SOG          | (796)                                                      | 960                     | 164                               | 1 876                                                      | (1 980)                 | (104)                             |
| SSB          | 207                                                        | (30)                    | 177                               | 30                                                         | 0                       | 30                                |
| UAG          | (25)                                                       | 0                       | (25)                              | 11                                                         | (20)                    | (9)                               |
| WST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | (26)                                                       | 0                       | (26)                              |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 75,11            | 79,57                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 16,04            | 9,17                 |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,80             | 0,69                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,99             | 5,72                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,00             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,02             | 0,04                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,42             | 0,71                 |
| Autres actifs                                                    | 3,62             | 4,10                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 0,99             | 0,50                 |
| Bermudes                          | 0,48             | 0,58                 |
| Îles Caïmans                      | 14,75            | 12,81                |
| Chine                             | 0,49             | 0,13                 |
| Colombie                          | 1,60             | 0,98                 |
| Costa Rica                        | 0,06             | S/O                  |
| France                            | S/O              | 0,41                 |
| Hong Kong                         | 3,12             | 3,90                 |
| Inde                              | 13,34            | 12,49                |
| Indonésie                         | 2,75             | 2,06                 |
| Île de Man                        | 0,80             | S/O                  |
| Japon                             | 0,70             | 1,22                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,68             | 0,32                 |
| Kazakhstan                        | 0,10             | 0,08                 |
| Luxembourg                        | 0,50             | 0,28                 |
| Îles Marshall                     | S/O              | 0,75                 |
| Île Maurice                       | 2,53             | 2,25                 |
| Mexique                           | S/O              | 0,25                 |
| Mongolie                          | 3,38             | 3,22                 |
| Pays-Bas                          | 2,80             | 2,25                 |
| Nigeria                           | 0,29             | S/O                  |
| Pakistan                          | 5,09             | 5,09                 |
| Philippines                       | 2,93             | 5,91                 |
| Singapour                         | 4,21             | 3,35                 |
| Afrique du Sud                    | 0,24             | 0,52                 |
| Corée du Sud                      | 0,57             | 0,49                 |
| Espagne                           | 0,39             | 0,75                 |
| Sri Lanka                         | 7,30             | 6,99                 |
| Thaïlande                         | 2,30             | 1,46                 |
| Turquie                           | S/O              | 0,35                 |

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

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Royaume-Uni                                                                                              | 10,73            | 12,30                |
| États-Unis                                                                                               | 7,12             | 2,59                 |
| Vietnam                                                                                                  | 0,08             | 0,07                 |
| Îles Vierges britanniques                                                                                | 7,30             | 5,59                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 1,38             | 1,93                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 4,30             | 5,88                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | (0,01)           | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,01             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,02)           | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | S/O              | 0,03                 |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,03                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | S/O              | (0,01)               |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,27)           | (0,33)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03             | 0,01                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,07)           | (0,01)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,53)           | 0,48                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (2,45)           | 2,02                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

30 juin 2026

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | ACTIONS    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)    | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|------------|-------------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                     |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
| AUSTRALIE                              |                                     |                                  |                           | FWD Group Holdings Ltd.                                                               |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (c)                         | 2 410 253  | \$ 14                               | 0,01                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                     |                                  |                           | 5,836 % éch. 22/09/2035                                                               | \$ 700                              | \$ 701                           | 0,25                      |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,635 % éch. 02/07/2031                                                               | 1 100                               | 1 204                            | 0,42                      |                                                       |            | 20                                  | 0,01                      |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd. |                                     |                                  |                           | Gaci First Investment Co.                                                             |                                     |                                  |                           |                                                       |            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| 6,250 % éch. 22/10/2031                | \$ 500                              | \$ 509                           | 0,18                      | 6,250 % éch. 14/05/2056                                                               | 1 400                               | 1 402                            | 0,49                      |                                                       |            |                                     |                           |
| 6,750 % éch. 22/04/2034                | 600                                 | 619                              | 0,22                      | Greentown China Holdings Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                   |            |                                     |                           |
| Cdc Data Centres Australia Pty. Ltd.   |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 19/05/2029                                                               | 1 400                               | 1 362                            | 0,48                      |                                                       |            |                                     |                           |
| 6,874 % éch. 12/06/2056                | AUD 100                             | 70                               | 0,02                      | 8,450 % éch. 24/02/2028                                                               | 500                                 | 503                              | 0,18                      | Midea Investment Development Co. Ltd.                 |            |                                     |                           |
| 7,332 % éch. 12/06/2056                | 100                                 | 71                               | 0,02                      | Health & Happiness International Holdings Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 13/05/2033 (d) HKD                       | 8 000      | 1 024                               | 0,36                      |
| Dyno Nobel Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 9,125 % éch. 24/07/2028                                                               | 1 400                               | 1 470                            | 0,51                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |            |                                     |                           |
| 5,400 % éch. 08/11/2032                | 200                                 | 135                              | 0,05                      | HPHT Finance Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
| Macquarie Bank Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 17/09/2026                                                               | 400                                 | 398                              | 0,14                      | Flourish Century                                      |            |                                     |                           |
| 6,125 % éch. 08/03/2027 (e)(g)         | \$ 900                              | 909                              | 0,32                      | Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 6,600 % éch. 04/02/2049 ^h) \$                        | 1 700      | 0                                   | 0,00                      |
| Mineral Resources Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               | 32                                  | 2                                | 0,00                      | Industrial & Commercial Bank of China Ltd.            |            |                                     |                           |
| 7,000 % éch. 01/04/2031                | 100                                 | 104                              | 0,04                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch. 24/09/2026 (e)(g)                        | 700        | 697                                 | 0,24                      |
| Perenti Finance Pty. Ltd.              |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 196                                 | 4                                | 0,00                      | Midea Investment Development Co. Ltd.                 |            |                                     |                           |
| 7,500 % éch. 26/04/2029                | 100                                 | 103                              | 0,04                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 2,880 % éch. 24/02/2027                               | 800        | 792                                 | 0,27                      |
| QPH Finance Co. Pty. Ltd.              |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 28/12/2029 (b)                                                           | 328                                 | 7                                | 0,00                      | SF Holding Investment Ltd.                            |            |                                     |                           |
| 5,695 % éch. 05/03/2035                | AUD 800                             | 544                              | 0,19                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 17/11/2026                               | 200        | 198                                 | 0,07                      |
| Santos Finance Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 28/12/2030 (b)                                                           | 395                                 | 7                                | 0,00                      | Yango Group Co. Ltd.                                  |            |                                     |                           |
| 5,250 % éch. 13/03/2029                | \$ 1 000                            | 1 007                            | 0,35                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 6,900 % éch. 31/10/2022^ CNY                          | 20 000     | 46                                  | 0,02                      |
| 5,750 % éch. 13/11/2035                | 100                                 | 101                              | 0,03                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | Yango Justice International Ltd.                      |            |                                     |                           |
| Westpac Banking Corp.                  |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/12/2031 (b)                                                           | 595                                 | 10                               | 0,00                      | 7,875 % éch. 04/09/2024^ \$                           | 700        | 1                                   | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 21/09/2027 (e)(g)         | 1 300                               | 1 303                            | 0,45                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                       |            | 1 734                               | 0,60                      |
| Woodside Finance Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 28/12/2032 (b)                                                           | 559                                 | 11                               | 0,00                      | Total Chine                                           |            |                                     |                           |
| 5,100 % éch. 12/09/2034                | 1 200                               | 1 180                            | 0,41                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                       |            | 2 778                               | 0,97                      |
|                                        |                                     | 6 655                            | 2,32                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           | COLOMBIE                                              |            |                                     |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                  |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |            |                                     |                           |
| Treasury Corp. of Victoria             |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | Ecopetrol S.A.                                        |            |                                     |                           |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                | AUD 3 200                           | 1 556                            | 0,54                      | 7,721 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 134                                 | 3                                | 0,00                      | 7,750 % éch. 01/02/2032                               | 1 200      | 1 257                               | 0,44                      |
| Total Australie                        |                                     | 8 211                            | 2,86                      | Longfor Group Holdings Ltd.                                                           |                                     |                                  |                           | Grupo Nutresa S.A.                                    |            |                                     |                           |
| BERMUDES                               |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 13/04/2027                                                               | 300                                 | 287                              | 0,10                      | 8,000 % éch. 12/05/2030                               | 1 200      | 1 273                               | 0,44                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 16/09/2029                                                               | 1 200                               | 1 008                            | 0,35                      | Promigas S.A. ESP                                     |            |                                     |                           |
| Li & Fung Ltd.                         |                                     |                                  |                           | Meituan                                                                               |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 24/06/2056                               | 500        | 509                                 | 0,18                      |
| 8,375 % éch. 05/02/2029                | \$ 200                              | 205                              | 0,07                      | 5,125 % éch. 05/11/2035                                                               | 1 400                               | 1 351                            | 0,47                      |                                                       |            | 3 039                               | 1,06                      |
| CANADA                                 |                                     |                                  |                           | Melco Resorts Finance Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |            |                                     |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 04/12/2029                                                               | 600                                 | 585                              | 0,21                      | TES colombien                                         |            |                                     |                           |
| First Quantum Minerals Ltd.            |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 17/07/2027                                                               | 2 090                               | 2 087                            | 0,73                      | 11,000 % éch. 22/08/2029 COP                          | 500        | 0                                   | 0,00                      |
| 7,250 % éch. 15/02/2034                | 400                                 | 410                              | 0,14                      | 6,500 % éch. 24/09/2033                                                               | 500                                 | 490                              | 0,17                      | 11,750 % éch. 24/01/2035                              | 10 455 200 | 2 979                               | 1,04                      |
| ÎLES CAÏMANS                           |                                     |                                  |                           | MGM China Holdings Ltd.                                                               |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 28/11/2040                              | 500        | 0                                   | 0,00                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES    |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 01/02/2027                                                               | 690                                 | 687                              | 0,24                      |                                                       |            | 2 979                               | 1,04                      |
| Alibaba Group Holding Ltd.             |                                     |                                  |                           | MTR Corp. CI Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           | Total Colombie                                        |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 15/09/2032 (d)            | 1 400                               | 1 246                            | 0,43                      | 5,625 % éch. 24/09/2035 (e)                                                           | 1 400                               | 1 445                            | 0,50                      |                                                       |            | 6 018                               | 2,10                      |
| Anllian Capital Ltd.                   |                                     |                                  |                           | New World China Land Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | COSTA RICA                                            |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 05/12/2029 (d)            | € 800                               | 885                              | 0,31                      | 4,750 % éch. 23/01/2027                                                               | 500                                 | 483                              | 0,17                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |            |                                     |                           |
| Baidu, Inc.                            |                                     |                                  |                           | PCPD Capital Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 12/03/2032 (d)            | \$ 1 400                            | 1 245                            | 0,43                      | 7,500 % éch. 15/05/2029                                                               | 1 900                               | 1 902                            | 0,66                      | 6,001 % éch. 16/01/2036 €                             | 250        | 303                                 | 0,11                      |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.       |                                     |                                  |                           | QIC Cayman Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           | HONG KONG                                             |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)            | 407                                 | 28                               | 0,01                      | 6,150 % éch. 10/04/2031 (e)                                                           | 600                                 | 596                              | 0,21                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |            |                                     |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd.              |                                     |                                  |                           | QNB Finance Ltd.                                                                      |                                     |                                  |                           | AIA Group Ltd.                                        |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2026 (d)            | 116                                 | 0                                | 0,00                      | 4,538 % éch. 19/09/2027                                                               | 800                                 | 800                              | 0,28                      | 3,580 % éch. 11/06/2035 SGD                           | 1 750      | 1 419                               | 0,49                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (d)            | 145                                 | 1                                | 0,00                      | 4,679 % éch. 27/04/2029                                                               | 1 400                               | 1 407                            | 0,49                      | 5,375 % éch. 05/04/2034 \$                            | 1 000      | 1 018                               | 0,36                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)            | 235                                 | 2                                | 0,00                      | Sands China Ltd.                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 30/09/2054                               | 250        | 238                                 | 0,08                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)            | 243                                 | 2                                | 0,00                      | 2,300 % éch. 08/03/2027                                                               | 850                                 | 837                              | 0,29                      | Bank of East Asia Ltd.                                |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (d)            | 233                                 | 2                                | 0,00                      | 5,400 % éch. 08/08/2028                                                               | 1 000                               | 1 008                            | 0,35                      | 5,375 % éch. 13/05/2032                               | 1 750      | 1 755                               | 0,61                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (d)            | 291                                 | 2                                | 0,00                      | Shui On Development Holding Ltd.                                                      |                                     |                                  |                           | Bright Food Singapore Holdings Pte. Ltd.              |            |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)            | 291                                 | 1                                | 0,00                      | 9,750 % éch. 26/01/2029                                                               | 1 000                               | 1 015                            | 0,35                      | 3,250 % éch. 09/07/2030 €                             | 1 150      | 1 304                               | 0,45                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (d)            | 506                                 | 2                                | 0,00                      | Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | Central Plaza Development Ltd.                        |            |                                     |                           |
| Wynn Macau Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 17/07/2026                                                               | 200                                 | 200                              | 0,07                      | 7,150 % éch. 21/03/2028 \$                            | 500        | 504                                 | 0,18                      |
| 4,500 % éch. 07/03/2029                | 1 200                               | 1 196                            | 0,42                      | Tencent Holdings Ltd.                                                                 |                                     |                                  |                           | CFAMC Co. Ltd.                                        |            |                                     |                           |
|                                        |                                     | 4 610                            | 1,60                      | 3,975 % éch. 11/04/2029                                                               | 1 000                               | 991                              | 0,35                      | 4,500 % éch. 29/05/2029                               | 200        | 198                                 | 0,07                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                     |                                  |                           | 5,600 % éch. 16/06/2046                                                               | 1 400                               | 1 403                            | 0,49                      | 4,875 % éch. 22/11/2026                               | 200        | 200                                 | 0,07                      |
| Champion MTN Ltd.                      |                                     |                                  |                           | VLL International, Inc.                                                               |                                     |                                  |                           | China Cinda Management Ltd.                           |            |                                     |                           |
| 2,950 % éch. 15/06/2030                | 300                                 | 268                              | 0,09                      | 9,375 % éch. 29/07/2029                                                               | 400                                 | 221                              | 0,08                      | 5,750 % éch. 07/02/2027                               | 500        | 502                                 | 0,18                      |
| China Hongqiao Group Ltd.              |                                     |                                  |                           | Wynn Macau Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
| 6,925 % éch. 29/11/2028                | 700                                 | 725                              | 0,25                      | 5,125 % éch. 15/12/2029                                                               | 800                                 | 784                              | 0,27                      | Far East Horizon Ltd.                                 |            |                                     |                           |
| China Modern Dairy Holdings Ltd.       |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/10/2027                                                               | 500                                 | 499                              | 0,17                      | 5,250 % éch. 13/01/2029                               | 900        | 892                                 | 0,31                      |
| 2,125 % éch. 14/07/2026                | 1 200                               | 1 199                            | 0,42                      | 6,750 % éch. 15/02/2034                                                               | 1 700                               | 1 690                            | 0,59                      | 6,625 % éch. 16/04/2027                               | 1 100      | 1 113                               | 0,39                      |
| CK Hutchison International Ltd.        |                                     |                                  |                           | Zhongsheng Group Holdings Ltd.                                                        |                                     |                                  |                           | Fortune Star BVI Ltd.                                 |            |                                     |                           |
| 4,750 % éch. 21/04/2028                | 600                                 | 603                              | 0,21                      | 5,980 % éch. 30/01/2028                                                               | 700                                 |                                  |                           | 5,050 % éch. 27/01/2027                               | 200        | 198                                 | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           | 6,800 % éch. 09/09/2029                               | 1 100      | 1 089                               | 0,38                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 19/05/2028                               | 700        | 719                                 | 0,25                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |
| </                                     |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |            |                                     |                           |

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

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.<br>3,975 % éch. 09/11/2027     | \$ 1 400                            | \$ 632                           | 0,22                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                             |                                     |                                  |                           | Rakuten Group, Inc.<br>4,691 % éch. 23/10/2030 (e)                                       | ¥ 100 000                           | \$ 619                           | 0,21                      |
|                                                                     |                                     | 11 781                           | 4,11                      | Obligation internationale du gouvernement indien<br>6,480 % éch. 06/10/2035 INR 10 000   | \$ 104                              | 0,04                             |                           | Sompo Holdings, Inc.<br>5,411 % éch. 22/04/2037                                          | \$ 1 400                            | 1 376                            | 0,48                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | Total Inde                                                                               | 34 076                              | 11,87                            |                           |                                                                                          |                                     | 6 295                            | 2,19                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>INDONÉSIE</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
| Airport Authority Hong Kong<br>4,875 % éch. 12/01/2030              | 400                                 | 407                              | 0,14                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,300 % éch. 20/12/2054 ¥ 110 000  | 490                                 | 0,17                             |                           |
| Total Hong Kong                                                     |                                     | 12 188                           | 4,25                      | Bank Mandiri Persero Tbk PT<br>4,900 % éch. 24/03/2028 \$ 1 000                          | 998                                 | 0,35                             |                           | Total Japon                                                                              | 8 088                               | 2,82                             |                           |
| <b>INDE</b>                                                         |                                     |                                  |                           | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT<br>7,150 % éch. 22/10/2031 (e)(g) 1 600             | 1 599                               | 0,56                             |                           | <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | Danantara Investment Management PT<br>5,350 % éch. 18/06/2031 300                        | 300                                 | 0,10                             |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Adani Electricity Mumbai Ltd.<br>3,949 % éch. 12/02/2030            | 998                                 | 938                              | 0,33                      | 5,950 % éch. 18/06/2036 300                                                              | 299                                 | 0,10                             |                           | West China Cement Ltd.<br>10,500 % éch. 11/11/2029 \$ 1 400                              | 1 216                               | 0,42                             |                           |
| Adani Green Energy UP Ltd.<br>6,700 % éch. 12/03/2042               | 791                                 | 774                              | 0,27                      | Freeport Indonesia PT<br>5,315 % éch. 14/04/2032 1 800                                   | 1 790                               | 0,62                             |                           | <b>KAZAKHSTAN</b>                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.<br>4,000 % éch. 30/07/2027 | 200                                 | 198                              | 0,07                      | Garuda Indonesia Persero Tbk PT<br>6,500 % éch. 28/12/2031 981                           | 860                                 | 0,30                             |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 04/08/2027                                             | 300                                 | 297                              | 0,10                      | Hutama Karya Persero PT<br>3,750 % éch. 11/05/2030 500                                   | 476                                 | 0,17                             |                           | Development Bank of Kazakhstan JSC<br>18,400 % éch. 16/10/2028 KZT 112 500               | 245                                 | 0,09                             |                           |
| Adani Renewable Energy RJ Ltd.<br>4,625 % éch. 15/10/2039           | 1 454                               | 1 236                            | 0,43                      | Indika Energy Tbk PT<br>8,750 % éch. 07/05/2029 1 200                                    | 1 214                               | 0,42                             |                           | <b>LUXEMBOURG</b>                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Axis Bank Ltd.<br>4,100 % éch. 08/09/2026 (e)(g) 2 000              | 1 995                               | 0,69                             |                           | LLPL Capital Pte. Ltd.<br>6,875 % éch. 04/02/2039 539                                    | 548                                 | 0,19                             |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 30/12/2031 (e)(g) 500                                  | 503                                 | 0,17                             |                           | Majapahit Holding BV<br>7,875 % éch. 29/06/2037 400                                      | 456                                 | 0,16                             |                           | Green Palm Bidco SARL<br>5,957 % éch. 30/06/2041 \$ 700                                  | 708                                 | 0,25                             |                           |
| Continuum Energy Aura Pte. Ltd.<br>9,500 % éch. 24/02/2027          | 500                                 | 504                              | 0,18                      | Pertamina Hulu Energi PT<br>5,250 % éch. 21/05/2030 800                                  | 799                                 | 0,28                             |                           | 6,462 % éch. 30/06/2046 700                                                              | 710                                 | 0,25                             |                           |
| Continuum Green Energy India Pvt<br>7,500 % éch. 26/06/2033         | 185                                 | 191                              | 0,07                      | Pertamina Persero PT<br>6,500 % éch. 27/05/2041 1 100                                    | 1 141                               | 0,40                             |                           | Greensaf Pipelines Bidco SARL<br>5,853 % éch. 23/02/2036 800                             | 817                                 | 0,28                             |                           |
| Delhi International Airport Ltd.<br>6,125 % éch. 31/10/2026         | 1 240                               | 1 243                            | 0,43                      | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara<br>6,150 % éch. 21/05/2048 800 | 765                                 | 0,27                             |                           |                                                                                          | 2 235                               | 0,78                             |                           |
| GMR Hyderabad International Airport Ltd.<br>4,250 % éch. 27/10/2027 | 700                                 | 690                              | 0,24                      | 6,250 % éch. 25/01/2049 500                                                              | 488                                 | 0,17                             |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
| HDFC Bank Ltd.<br>3,700 % éch. 25/08/2026 (e)(g) 1 800              | 1 798                               | 0,63                             |                           |                                                                                          | 13 169                              | 4,59                             |                           | Eagle Funding Luxco SARL<br>5,500 % éch. 17/08/2030 800                                  | 804                                 | 0,28                             |                           |
| 5,067 % éch. 24/06/2031 1 400                                       | 1 400                               | 0,49                             |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                             |                                     |                                  |                           | Total Luxembourg                                                                         | 3 039                               | 1,06                             |                           |
| IIFL Finance Ltd.<br>7,600 % éch. 10/09/2029                        | 700                                 | 704                              | 0,24                      | Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>4,850 % éch. 11/01/2033 900      | 887                                 | 0,31                             |                           | <b>MALAISIE</b>                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 24/07/2028 1 900                                       | 1 957                               | 0,68                             |                           | 5,690 % éch. 29/05/2036 200                                                              | 204                                 | 0,07                             |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| Indian Railway Finance Corp. Ltd.<br>3,570 % éch. 31/10/2032        | 1 000                               | 931                              | 0,32                      | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia<br>4,500 % éch. 01/12/2030 1 300                      | 1 285                               | 0,45                             |                           | Cerah Capital Ltd.<br>2,250 % éch. 14/08/2030 600                                        | 631                                 | 0,22                             |                           |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.<br>7,110 % éch. 11/03/2032       | 1 800                               | 1 825                            | 0,64                      | 4,700 % éch. 06/06/2032 900                                                              | 892                                 | 0,31                             |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| JSW Hydro Energy Ltd.<br>4,125 % éch. 18/05/2031                    | 1 423                               | 1 319                            | 0,46                      | Total Indonésie                                                                          | 16 437                              | 5,73                             |                           | Khazanah Capital Ltd.<br>4,876 % éch. 01/06/2033 300                                     | 303                                 | 0,10                             |                           |
| Manappuram Finance Ltd.<br>7,375 % éch. 12/05/2028                  | 630                                 | 638                              | 0,22                      | <b>ÎLE DE MAN</b>                                                                        |                                     |                                  |                           | MISC Capital Two Labuan Ltd.<br>3,750 % éch. 06/04/2027 900                              | 893                                 | 0,31                             |                           |
| Motherhood Global Investments BV<br>5,625 % éch. 11/07/2029         | 700                                 | 705                              | 0,25                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Petrolim Nasional Bhd.<br>7,625 % éch. 15/10/2026 700                                    | 707                                 | 0,25                             |                           |
| Muthoot Finance Ltd.<br>5,750 % éch. 04/08/2030                     | 1 200                               | 1 176                            | 0,41                      | Gohl Capital Holdings Ltd.<br>7,625 % éch. 29/10/2031 (e) 500                            | 485                                 | 0,17                             |                           | Petronas Capital Ltd.<br>2,480 % éch. 28/01/2032 1 000                                   | 893                                 | 0,31                             |                           |
| 6,375 % éch. 23/04/2029 750                                         | 752                                 | 0,26                             |                           | 8,300 % éch. 29/04/2036 (e) 1 000                                                        | 963                                 | 0,33                             |                           | 3,500 % éch. 21/04/2030 200                                                              | 193                                 | 0,07                             |                           |
| 6,375 % éch. 02/03/2030 1 200                                       | 1 199                               | 0,42                             |                           | Total Île de Man                                                                         | 1 448                               | 0,50                             |                           | 4,500 % éch. 18/03/2045 1 200                                                            | 1 066                               | 0,37                             |                           |
| 7,125 % éch. 14/02/2028 900                                         | 913                                 | 0,32                             |                           | <b>JAPON</b>                                                                             |                                     |                                  |                           | 5,848 % éch. 03/04/2055 600                                                              | 624                                 | 0,22                             |                           |
| Piramal Finance Ltd.<br>7,800 % éch. 29/01/2028                     | 1 520                               | 1 549                            | 0,54                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                          | 4 679                               | 1,63                             |                           |
| Power Finance Corp. Ltd.<br>3,750 % éch. 06/12/2027                 | 830                                 | 818                              | 0,28                      | Hokkaido Electric Power Co., Inc.<br>0,000 % éch. 03/03/2031 (d) ¥ 130 000               | 808                                 | 0,28                             |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
| Reliance Industries Ltd.<br>2,875 % éch. 12/01/2032                 | 300                                 | 270                              | 0,09                      | Nippon Steel Corp.<br>0,000 % éch. 14/02/2031 (d) 80 000                                 | 495                                 | 0,18                             |                           | Export-Import Bank of Malaysia Bhd.<br>1,831 % éch. 26/11/2026 700                       | 693                                 | 0,24                             |                           |
| 3,625 % éch. 12/01/2052 300                                         | 216                                 | 0,07                             |                           |                                                                                          | 1 303                               | 0,46                             |                           | Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>3,900 % éch. 30/11/2026 MYR 8 910 | 2 194                               | 0,77                             |                           |
| ReNew Pvt Ltd.<br>5,875 % éch. 05/03/2027                           | 2 100                               | 2 098                            | 0,73                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>4,070 % éch. 30/09/2026 5 053     | 1 243                               | 0,43                             |                           |
| Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.<br>6,500 % éch. 02/02/2031             | 1 600                               | 1 584                            | 0,55                      | Fukoku Mutual Life Insurance Co.<br>5,750 % éch. 02/09/2055 \$ 1 400                     | 1 389                               | 0,48                             |                           |                                                                                          | 4 130                               | 1,44                             |                           |
| SAEL Ltd.<br>7,800 % éch. 31/07/2031                                | 1 269                               | 1 288                            | 0,45                      | JERA Co., Inc.<br>4,544 % éch. 02/09/2030 2 000                                          | 1 974                               | 0,69                             |                           | Total Malaisie                                                                           | 9 440                               | 3,29                             |                           |
| Sammaan Capital Ltd.<br>7,500 % éch. 16/10/2030                     | 371                                 | 376                              | 0,13                      | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.<br>8,200 % éch. 15/01/2029 (e)(g) 500               | 540                                 | 0,19                             |                           | <b>ÎLE MAURICE</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 8,950 % éch. 28/08/2028 600                                         | 624                                 | 0,22                             |                           | Norinchukin Bank<br>5,356 % éch. 10/03/2036 200                                          | 198                                 | 0,07                             |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Shriram Finance Ltd.<br>6,625 % éch. 22/04/2027                     | 300                                 | 304                              | 0,11                      | 5,359 % éch. 09/09/2035 200                                                              | 199                                 | 0,07                             |                           | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.<br>4,250 % éch. 25/03/2027 \$ 147              | 145                                 | 0,05                             |                           |
| State Bank of India<br>5,125 % éch. 25/11/2029                      | 500                                 | 504                              | 0,18                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % éch. 27/09/2028 1 675                    | 1 689                               | 0,59                             |                           |
| UltraTech Cement Ltd.<br>2,800 % éch. 16/02/2031                    | 500                                 | 455                              | 0,16                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           | India Cleantech Energy<br>4,700 % éch. 10/08/2026 382                                    | 381                                 | 0,13                             |                           |
|                                                                     |                                     | 33 972                           | 11,83                     |                                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| India Green Power Holdings<br>4,000 % éch. 22/02/2027                            | \$ 880                              | \$ 869                           | 0,30                      | Metropolitan Bank & Trust Co.<br>5,500 % éch. 06/03/2034                       | \$ 400                              | \$ 405                           | 0,14                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Total Île Maurice                                                                |                                     | 3 084                            | 1,07                      | Petron Corp.<br>7,350 % éch. 22/08/2028 (e)                                    | 200                                 | 203                              | 0,07                      | Korea Housing Finance Corp.<br>4,875 % éch. 27/08/2027                           | \$ 400                              | \$ 403                           | 0,14                      |
| <b>MEXIQUE</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | PLDT, Inc.<br>2,500 % éch. 23/01/2031                                          | 700                                 | 637                              | 0,22                      | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp.<br>4,875 % éch. 13/04/2031   | 300                                 | 302                              | 0,11                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,125 % éch. 02/12/2029 (e)          | 600                                 | 597                              | 0,21                      | Korea National Oil Corp.<br>2,625 % éch. 18/04/2032                              | 2 300                               | 2 052                            | 0,71                      |
| CFE Fibra<br>5,875 % éch. 23/09/2040                                             | 1 263                               | 1 233                            | 0,43                      | 8,375 % éch. 20/10/2030 (e)                                                    | 1 500                               | 1 493                            | 0,52                      |                                                                                  |                                     | 2 757                            | 0,96                      |
| <b>MONGOLIE</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 12/06/2029 (e)                                                    | 1 500                               | 1 522                            | 0,53                      | Total Corée du Sud                                                               |                                     | 11 101                           | 3,87                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | SMIC SG Holdings Pte. Ltd.<br>5,375 % éch. 24/07/2029                          | 500                                 | 504                              | 0,18                      | <b>ESPAGNE</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Golomt Bank<br>7,950 % éch. 14/05/2029                                           | 500                                 | 503                              | 0,18                      |                                                                                |                                     | 7 575                            | 2,64                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                   |                                     |                                  |                           | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % éch. 14/01/2032 (e)(g)           | 700                                 | 737                              | 0,26                      |
| City of Ulaanbaatar Mongolia<br>7,750 % éch. 21/08/2027                          | 1 800                               | 1 837                            | 0,64                      | Obligation internationale du gouvernement philippin<br>5,000 % éch. 17/07/2033 | 400                                 | 400                              | 0,14                      | <b>SRI LANKA</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Development Bank of Mongolia LLC<br>8,500 % éch. 03/07/2028 (h)                  | 600                                 | 623                              | 0,22                      | 5,000 % éch. 13/01/2037                                                        | 200                                 | 196                              | 0,07                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mongol<br>5,125 % éch. 07/07/2027      | 1 000                               | 982                              | 0,34                      | 5,175 % éch. 05/09/2049                                                        | 2 100                               | 1 945                            | 0,67                      | Obligation internationale du gouvernement sri-lankais<br>3,100 % éch. 15/01/2030 | 770                                 | 787                              | 0,27                      |
| 3,500 % éch. 07/07/2027                                                          | 1 000                               | 982                              | 0,34                      |                                                                                |                                     | 2 541                            | 0,88                      | 3,350 % éch. 15/03/2033                                                          | 3 765                               | 3 627                            | 1,26                      |
| 5,950 % éch. 09/03/2032                                                          | 1 000                               | 1 004                            | 0,35                      | Total Philippines                                                              |                                     | 10 116                           | 3,52                      | 3,600 % éch. 15/05/2036                                                          | 983                                 | 989                              | 0,34                      |
| 6,625 % éch. 25/02/2030                                                          | 200                                 | 206                              | 0,07                      | <b>SINGAPOUR</b>                                                               |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/02/2038                                                          | 2 567                               | 2 598                            | 0,91                      |
| 7,875 % éch. 05/06/2029                                                          | 200                                 | 213                              | 0,07                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                           |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/04/2028                                                          | 228                                 | 221                              | 0,08                      |
|                                                                                  |                                     | 4 865                            | 1,69                      | DBS Bank Ltd.<br>3,989 % éch. 28/08/2028                                       | 1 900                               | 1 888                            | 0,66                      | Total Sri Lanka                                                                  |                                     | 8 222                            | 2,86                      |
| Total Mongolie                                                                   |                                     | 5 368                            | 1,87                      | Foxconn Singapore Pte. Ltd.<br>3,125 % éch. 04/11/2031                         | € 1 200                             | 1 339                            | 0,47                      | <b>THAÏLANDE</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>PAYS-BAS</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | Fubon Life Singapore Pte. Ltd.<br>5,450 % éch. 10/12/2035                      | \$ 1 600                            | 1 581                            | 0,55                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % éch. 20/05/2028                                       | 1 100                               | 932                              | 0,32                      | Advanced Info Service PCL<br>4,894 % éch. 04/03/2036                             | 1 700                               | 1 673                            | 0,58                      |
| ING Groep NV<br>8,000 % éch. 16/05/2030 (e)(g)                                   | 200                                 | 213                              | 0,07                      | Medco Cypress Tree Pte. Ltd.<br>8,625 % éch. 19/05/2030                        | 2 100                               | 2 190                            | 0,76                      | Bangkok Bank PCL<br>5,082 % éch. 26/11/2035                                      | 1 300                               | 1 282                            | 0,45                      |
| Mong Duong Finance Holdings BV<br>5,125 % éch. 07/05/2029                        | 952                                 | 941                              | 0,33                      | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.<br>4,602 % éch. 15/06/2032 (g)              | 1 500                               | 1 499                            | 0,52                      | 5,300 % éch. 21/09/2028                                                          | 1 050                               | 1 063                            | 0,37                      |
| Prosus NV<br>4,193 % éch. 19/01/2032                                             | 500                                 | 475                              | 0,17                      | Singapore Airlines Ltd.<br>3,000 % éch. 20/07/2026                             | 4 300                               | 4 298                            | 1,50                      | GC Treasury Center Co. Ltd.<br>6,500 % éch. 10/09/2030 (e)                       | 700                                 | 693                              | 0,24                      |
| Veon Midco BV<br>6,950 % éch. 01/06/2031                                         | 1 100                               | 1 099                            | 0,38                      | Temasek Financial Ltd.<br>2,050 % éch. 30/07/2035                              | CNY 5 000                           | 732                              | 0,25                      | 7,125 % éch. 10/03/2035 (e)                                                      | 500                                 | 495                              | 0,17                      |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                                                          | 1 100                               | 1 098                            | 0,38                      | Yinson Production Financial Services Pte. Ltd.<br>9,625 % éch. 03/05/2029      | \$ 400                              | 424                              | 0,15                      | Kasikornbank PCL<br>4,000 % éch. 10/02/2027 (e)(g)                               | 300                                 | 297                              | 0,10                      |
| Yinson Bergenia Production BV<br>8,498 % éch. 31/01/2045                         | 592                                 | 633                              | 0,22                      | Total Singapour                                                                |                                     | 14 883                           | 5,18                      | 5,458 % éch. 07/03/2028                                                          | 700                                 | 708                              | 0,25                      |
| Yinson Boronia Production BV<br>8,947 % éch. 31/07/2042                          | 291                                 | 321                              | 0,11                      | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                                          |                                     |                                  |                           | RH International Singapore Corp. Pte. Ltd.<br>4,500 % éch. 27/03/2028            | 900                                 | 892                              | 0,31                      |
|                                                                                  |                                     | 4 780                            | 1,66                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                     |                                     |                                  |                           | Thaioli Treasury Center Co. Ltd.<br>6,100 % éch. 15/01/2031 (e)                  | 400                                 | 391                              | 0,14                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                           |                                     |                                  |                           | <b>CORÉE DU SUD</b>                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     | 7 494                            | 2,61                      |
| Veon Amsterdam<br>7,924 % éch. 25/03/2027                                        | 800                                 | 799                              | 0,28                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Total Pays-Bas                                                                   |                                     | 5 579                            | 1,94                      | Sasol Financing USA LLC<br>4,500 % éch. 08/11/2027                             | 600                                 | 605                              | 0,21                      | Export-Import Bank of Thailand<br>5,354 % éch. 16/05/2029                        | 700                                 | 714                              | 0,25                      |
| <b>NIGERIA</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                           |                                     |                                  |                           | Total Thaïlande                                                                  |                                     | 8 208                            | 2,86                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | LG Chem Ltd.<br>1,600 % éch. 18/07/2030                                        | 1 400                               | 1 387                            | 0,48                      | <b>TURQUIE</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Dangote Fertiliser Ltd.<br>7,750 % éch. 05/05/2031                               | 700                                 | 705                              | 0,24                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                           |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>PAKISTAN</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | GS Caltex Corp.<br>5,375 % éch. 07/08/2028                                     | 900                                 | 912                              | 0,32                      | TT Varlik Kiralama A/S<br>6,500 % éch. 30/10/2030                                | 800                                 | 793                              | 0,28                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Hyundai Card Co. Ltd.<br>5,750 % éch. 24/04/2029                               | 600                                 | 614                              | 0,22                      | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| Pakistan Global Sukuk Programme Co. Ltd.<br>7,950 % éch. 31/01/2029              | 1 100                               | 1 132                            | 0,39                      | Kookmin Bank<br>2,500 % éch. 04/11/2030 (g)                                    | 700                                 | 635                              | 0,22                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais<br>6,875 % éch. 05/12/2027 | 980                                 | 990                              | 0,35                      | LG Energy Solution Ltd.<br>5,375 % éch. 02/07/2029                             | 600                                 | 607                              | 0,21                      | First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,789 % éch. 03/06/2031                             | 500                                 | 501                              | 0,17                      |
| 6,975 % éch. 24/04/2029                                                          | 500                                 | 502                              | 0,18                      | NAVER Corp.<br>4,375 % éch. 21/04/2031                                         | 1 400                               | 1 385                            | 0,48                      | <b>ROYAUME-UNI</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 08/04/2031                                                          | 1 400                               | 1 412                            | 0,49                      | POSCO<br>5,750 % éch. 17/01/2028                                               | 500                                 | 508                              | 0,18                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 31/03/2036                                                          | 400                                 | 401                              | 0,14                      | Shinhan Bank Co. Ltd.<br>4,000 % éch. 23/04/2029 (g)                           | 200                                 | 195                              | 0,07                      | HSBC Holdings PLC<br>6,875 % éch. 11/09/2029 (e)(g)                              | 600                                 | 617                              | 0,21                      |
| 8,875 % éch. 08/04/2051                                                          | 1 100                               | 1 112                            | 0,39                      | 4,500 % éch. 26/03/2028 (g)                                                    | 700                                 | 697                              | 0,24                      | ICBC Standard Bank PLC<br>20,000 % éch. 18/09/2029                               | UZS 7 916 000                       | 659                              | 0,23                      |
| Pakistan Water & Power Development Authority<br>7,500 % éch. 04/06/2031          | 600                                 | 588                              | 0,20                      | Shinhan Card Co. Ltd.<br>2,500 % éch. 27/01/2027                               | 900                                 | 891                              | 0,31                      | 20,000 % éch. 13/12/2029                                                         | 9 839 000                           | 819                              | 0,29                      |
| Total Pakistan                                                                   |                                     | 6 137                            | 2,14                      | SK Hynix, Inc.<br>6,375 % éch. 17/01/2028                                      | 500                                 | 513                              | 0,18                      | Lloyds Banking Group PLC<br>8,000 % éch. 27/09/2029 (e)(g)                       | \$ 500                              | 534                              | 0,19                      |
| <b>PHILIPPINES</b>                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                |                                     | 6 957                            | 2,43                      | Standard Chartered PLC<br>3,603 % éch. 12/01/2033                                | 500                                 | 458                              | 0,16                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Globe Telecom, Inc.<br>2,500 % éch. 23/07/2030                                   | 1 300                               | 1 186                            | 0,41                      |                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| ICTSI Treasury BV<br>3,500 % éch. 16/11/2031                                     | 1 100                               | 1 028                            | 0,36                      |                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |



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

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,300 % éch. 19/08/2028 (e)(g)       | \$ 500                              | \$ 483                           | 0,17                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>               |                                     |                                  |                           | SJM International Ltd.                   |                                     |                                  |                           |
| 5,244 % éch. 13/05/2031              | 1 300                               | 1 315                            | 0,46                      | Obligations du Trésor américain                      |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/01/2031                  | \$ 1 000                            | \$ 950                           | 0,33                      |
| 5,400 % éch. 12/08/2036              | 1 600                               | 1 599                            | 0,56                      | 4,875 % éch. 15/08/2045                              | \$ 39                               | \$ 39                            | 0,01                      | Studio City Finance Ltd.                 |                                     |                                  |                           |
| 5,905 % éch. 14/05/2035              | 500                                 | 515                              | 0,18                      | Billets du Trésor américain                          |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/01/2029                  | 1 600                               | 1 533                            | 0,53                      |
| 6,187 % éch. 06/07/2027              | 700                                 | 700                              | 0,24                      | 3,750 % éch. 31/01/2031                              | 7 900                               | 7 751                            | 2,70                      | Yuexiu REIT MTN Co. Ltd.                 |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 08/06/2033 (e)(g)       | 900                                 | 907                              | 0,32                      | 4,125 % éch. 15/02/2036                              | 100                                 | 98                               | 0,04                      | 6,500 % éch. 12/02/2029                  | 1 700                               | 1 736                            | 0,60                      |
| 7,018 % éch. 08/02/2030              | 2 100                               | 2 209                            | 0,77                      | 4,250 % éch. 15/08/2035                              | 60                                  | 59                               | 0,02                      | Total Îles Vierges britanniques          |                                     | 10 198                           | 3,55                      |
| 7,625 % éch. 16/01/2032 (e)(g)       | 1 610                               | 1 699                            | 0,59                      |                                                      |                                     | 7 947                            | 2,77                      | <b>INSTRUMENTS A COURT TERME</b>         |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 15/08/2027 (e)(g)       | 300                                 | 308                              | 0,11                      | Total États-Unis                                     |                                     | 14 405                           | 5,02                      | <b>BILLETS A COURT TERME</b>             |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 08/03/2030 (e)(g)       | 990                                 | 1 044                            | 0,36                      |                                                      |                                     |                                  |                           | CS Treasury Management Services Ltd.     |                                     |                                  |                           |
| Vedanta Resources Finance PLC        |                                     |                                  |                           | <b>VIETNAM</b>                                       |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 05/12/2026 (e)              | 1 795                               | 1 852                            | 0,64                      |
| 7,375 % éch. 13/07/2034 (a)          | 300                                 | 297                              | 0,10                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | Total des Instruments à court terme      |                                     | 1 852                            | 0,64                      |
| 7,750 % éch. 13/07/2037 (a)          | 300                                 | 298                              | 0,10                      | Obligation internationale du gouvernement vietnamien |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
| 9,125 % éch. 15/10/2032              | 600                                 | 617                              | 0,21                      | 5,500 % éch. 12/03/2028                              | 1 650                               | 1 596                            | 0,56                      | Total des Valeurs mobilières             | \$ 265 383                          |                                  | 92,44                     |
| 9,475 % éch. 24/07/2030              | 950                                 | 963                              | 0,34                      | <b>ÎLES VIERGES BRITANNIQUES</b>                     |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
| 9,850 % éch. 24/04/2033              | 400                                 | 434                              | 0,15                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 10,250 % éch. 03/06/2028             | 500                                 | 513                              | 0,18                      | Cas Capital Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |                                     |                                  |                           |
| 10,875 % éch. 17/09/2029             | 1 400                               | 1 489                            | 0,52                      | 6,250 % éch. 13/01/2031 (e)                          | 600                                 | 604                              | 0,21                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |                                     |                                  |                           |
| 11,250 % éch. 03/12/2031             | 500                                 | 549                              | 0,19                      | Celestial Dynasty Ltd.                               |                                     |                                  |                           | PIMCO Select Funds plc - Fonds           |                                     |                                  |                           |
| Total Royaume-Uni                    |                                     | 19 026                           | 6,63                      | 6,375 % éch. 22/08/2028                              | 600                                 | 597                              | 0,21                      | PIMCO US Dollar Short-Term               | 1 443 09                            |                                  |                           |
| <b>ÉTATS-UNIS</b>                    |                                     |                                  |                           | Champion Path Holdings Ltd.                          |                                     |                                  |                           | Floating NAV Fund (f)                    | 5                                   | 14 391                           | 5,01                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 27/01/2028                              | 700                                 | 679                              | 0,24                      | PIMCO Specialty Funds Ireland            |                                     |                                  |                           |
| Beignet Investor LLC                 |                                     |                                  |                           | HKT Capital Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | p.l.c. - Fonds PIMCO China               |                                     |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049              | 1 900                               | 1 939                            | 0,68                      | 3,000 % éch. 14/07/2026                              | 200                                 | 200                              | 0,07                      | Bond Fund (f)                            | 1 880                               | 29                               | 0,01                      |
| Cantor Fitzgerald LP                 |                                     |                                  |                           | Nan Fung Treasury Ltd.                               |                                     |                                  |                           |                                          |                                     | 14 420                           | 5,02                      |
| 7,200 % éch. 12/12/2028              | 358                                 | 372                              | 0,13                      | 5,750 % éch. 21/05/2036                              | 600                                 | 600                              | 0,21                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |                                     |                                  |                           |
| Kraton Corp.                         |                                     |                                  |                           | NWD Finance BVI Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO             |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 15/07/2027              | 1 000                               | 1 004                            | 0,35                      | 10,131 % éch. 30/07/2026 (e)                         | 400                                 | 387                              | 0,14                      | US Dollar Short Maturity                 |                                     |                                  |                           |
| Las Vegas Sands Corp.                |                                     |                                  |                           | 12,179 % éch. 30/07/2026 (e)                         | 1 100                               | 1 024                            | 0,36                      | UCITS ETF (f)                            | 10 100                              | 1 015                            | 0,36                      |
| 5,625 % éch. 15/06/2028              | 400                                 | 405                              | 0,14                      | NWD MTN Ltd.                                         |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement         | \$ 15 435                           |                                  | 5,38                      |
| 6,000 % éch. 15/08/2029              | 800                                 | 822                              | 0,29                      | 4,125 % éch. 18/07/2029                              | 600                                 | 516                              | 0,18                      |                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 14/06/2030              | 600                                 | 617                              | 0,21                      | 4,500 % éch. 19/05/2030                              | 600                                 | 500                              | 0,17                      |                                          |                                     |                                  |                           |
| RD Michigan Property Owner LLC       |                                     |                                  |                           | 8,625 % éch. 08/02/2028                              | 900                                 | 872                              | 0,30                      |                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045              | 800                                 | 798                              | 0,28                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
| SK Battery America, Inc.             |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 23/01/2027              | 500                                 | 501                              | 0,17                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     | 6 458                            | 2,25                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Court | 09/2026              | 8                     | \$ (9)                                  | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 6                     | (3)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 4                     | (6)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 5                     | (9)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 20                    | (2)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Court | 09/2026              | 12                    | 2                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 179                   | 75                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 19                    | 25                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Long  | 09/2026              | 24                    | 33                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 38                    | 129                                     | 0,04                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 235                                  | 0,08                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                      |                       | \$ 235                                  | 0,08                   |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence                        | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | (1,000) %              | 20/12/2029         | \$ 900                              | \$ 13                                   | 0,00                   |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 2 100                            | \$ 18                                   | 0,01                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 2 050           | \$ (57)                           | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2036      | SGD 2 110         | (25)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 16/09/2031      | CNY 10 590        | (14)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | KORIBOR KRW à 3 mois              | 3,750     | 16/09/2027      | KRW 4 384 340     | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | KLIBOR MYR à 3 mois               | 3,500     | 16/09/2031      | MYR 14 750        | 2                                 | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | AUD 2 500         | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | € 1 400           | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ (93)                           | (0,03)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ (62)                           | (0,02)              |

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

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

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

<sup>(4)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

## OPTIONS ACHETÉES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 3 304                            | \$ 34 | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 2 096                            | 14    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 48 | \$ 0         | 0,00                |

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 3 304                            | \$ (12) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 2 096                            | (4)     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (16) | \$ 0         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %           | 20/12/2033      | \$ 700                           | \$ (34)                | \$ 4                              | \$ (30)      | (0,01)              |
| BRC          | Honda Motor Co Ltd.                                  | (1,000)             | 20/12/2029      | ¥ 200 000                        | (39)                   | 15                                | (24)         | (0,01)              |
| CBK          | Toyota Motor Corp.                                   | (1,000)             | 20/12/2029      | 175 000                          | (50)                   | 20                                | (30)         | (0,01)              |
| GST          | Temasek Financial Ltd.                               | (1,000)             | 20/06/2035      | \$ 1 400                         | (101)                  | 13                                | (88)         | (0,03)              |
|              | Toyota Motor Corp.                                   | (1,000)             | 20/12/2034      | ¥ 203 900                        | (109)                  | 45                                | (64)         | (0,02)              |
| JPM          | Toyota Motor Corp.                                   | (1,000)             | 20/12/2029      | 175 000                          | (51)                   | 21                                | (30)         | (0,01)              |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)             | 20/12/2030      | \$ 1 200                         | (43)                   | 3                                 | (40)         | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)             | 20/12/2034      | 1 000                            | (48)                   | 2                                 | (46)         | (0,02)              |
|              | Temasek Financial Ltd.                               | (1,000)             | 20/12/2034      | 2 200                            | (153)                  | 20                                | (133)        | (0,05)              |
|              |                                                      |                     |                 |                                  | \$ (628)               | \$ 143                            | \$ (485)     | (0,17)              |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement philippin | 1,000 %              | 20/06/2031      | \$ 900                           | \$ 2                   | \$ 13                             | \$ 15        | 0,01                |
| DBL          | Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.           | 1,000                | 20/06/2028      | 1 100                            | (3)                    | 4                                 | 1            | 0,00                |
| GST          | Alibaba Group Holding Ltd.                          | 1,000                | 20/06/2029      | 1 000                            | 5                      | 7                                 | 12           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement philippin | 1,000                | 20/06/2031      | 1 900                            | 9                      | 23                                | 32           | 0,01                |
| MYC          | SoftBank Group Corp.                                | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 113 200                        | (12)                   | 8                                 | (4)          | 0,00                |
|              |                                                     |                      |                 |                                  | \$ 1                   | \$ 55                             | \$ 56        | 0,02                |



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

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 573               | \$ 410             | \$ 13                 | \$ 13                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 518             | 897                | 33                    | 33                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 723               | 567                | 8                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 21                | CAD 29             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 655               | NZD 1 159          | 5                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 29                | \$ 21              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | NZD             | 1 159             | 655                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 2 070             | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 63                | KRW 95 442         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 442               | NOK 4 285          | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | 141               | \$ 18              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 358               | 120                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 09/2026           | KZT             | 3 556             | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             | 216 209           | 3 506              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 417             | PHP 206 814        | 0                     | (57)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | CNH             | 967               | \$ 143             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 836               | 123                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 8 438 311         | 469                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ILS             | 593               | 201                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 221 298           | 2 335              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 252 295           | 1 578              | 26                    | 26                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | THB             | 1 668             | 50                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 743             | £ 1 301            | 0                     | (17)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 2 161             | INR 205 091        | 3                     | 3                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 771               | ¥ 124 300          | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 324               | NZD 557            | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 16                | TWD 518            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 4 240 478         | \$ 234             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 221               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 733               | IDR 12 990 375     | 1                     | (13)                                    | 0,00                |
| DUB          | 09/2026           |                 | 2 420             | INR 230 476        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 60                | THB 1 954          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 175               | IDR 3 194 822      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 655               | \$ 221             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 8 534             | 2 101              | 12                    | 12                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 205             | 1 304              | 50                    | 50                                      | 0,02                |
| FAR          | 07/2026           | TRY             | 762               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 724               | TRY 34 477         | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 571               | \$ 443             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 64                | 80                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 661               | 227                | 6                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 360               | NOK 3 420          | 0                     | (15)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           |                 | 182               | PLN 666            | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 268               | SEK 2 475          | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 960               | \$ 330             | 8                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 89 797            | 958                | 13                    | 13                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | COP             | 10 174 516        | 2 623              | 0                     | (279)                                   | (0,10)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 13 593 501        | 753                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| FAR          | 09/2026           | KZT             | 13 026            | 26                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 4 197             | 127                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 175               | IDR 3 113 353      | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 143 281           | \$ 11              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 753               | IDR 13 684 520     | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 13 236            | \$ 140             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$              | 320               | CNH 2 165          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 94                | INR 9 022          | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 333               | NOK 3 092          | 0                     | (20)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 182               | PLN 675            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 107               | IDR 1 945 792      | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 140               | INR 13 326         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| FAR          | 10/2026           | UZS             | 2 713 948         | \$ 213             | 0                     | (10)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           |                 | 6 747 299         | 516                | 0                     | (34)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           |                 | 8 898 281         | 685                | 0                     | (39)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CNH             | 962               | 142                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 10                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 642               | 82                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SEK             | 1 473             | 152                | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | SGD 6 030       | \$ 4 727          | \$ 65              | \$ 0                  | \$ 65                                   | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 57           | CNH 389           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 682           | ¥ 433 988         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 731             | PLN 2 687         | 0                  | (17)                  | (17)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CNH 388         | \$ 57             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 266         | 93                | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 432 852       | 2 682             | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 152          | SEK 1 470         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 458             | INR 43 880        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 52 620      | \$ 555            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 988        | CAD 2 829         | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 140             | CNH 947           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 2 825       | \$ 1 988          | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 67           | INR 6 456         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 16 093      | \$ 499            | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 500          | IDR 8 973 445     | 1                  | (3)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 124           | INR 107 694       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | 13              | MNT 48 263        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2027           | 16              | 60 164            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2027           | 16              | 60 494            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2028           | 47              | 185 417           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2028           | 43              | 175 822           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2029           | 40              | 167 219           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2029           | 37              | 158 615           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2030           | 34              | 150 012           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2030           | 31              | 141 503           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2031           | 28              | 131 936           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | HKD 168         | \$ 22             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 425        | HKD 49 710        | 0                  | (83)                  | (83)                                    | (0,03)              |
| JPM          | 08/2026           | HKD 82          | \$ 10             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 2 480       | 1 768             | 50                 | 0                     | 50                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | ILS 1 738       | 582               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 13 605      | 1 374             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 812          | INR 76 862        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 548             | PLN 1 996         | 0                  | (17)                  | (17)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 571             | SGD 728           | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 524         | \$ 67             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 442       | 494               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 374        | NOK 13 611        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 8 494       | \$ 263            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 712        | INR 164 376       | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | 3 005           | MXN 52 211        | 0                  | (36)                  | (36)                                    | (0,01)              |
|              | 10/2026           | UZS 429 949     | \$ 34             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | MXN 205         | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | UZS 177 609     | 13                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 10          | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 1 553       | 1 983             | 58                 | 0                     | 58                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH 5 000       | 717               | 0                  | (21)                  | (21)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | € 43            | 50                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 3 865       | 494               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 13 288      | 141               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 34 268        | 215               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 4 388       | 441               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 899         | 92                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 167        | AUD 1 691         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 217             | INR 20 912        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 084           | KRW 1 642 784     | 0                  | (23)                  | (23)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 793             | NOK 7 349         | 0                  | (50)                  | (50)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | AUD 1 691       | \$ 1 166          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 441          | NOK 4 389         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 92              | SEK 898           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 4 230       | \$ 127            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 469          | INR 44 811        | 2                  | (1)                   | 1                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | IDR 3 601 980   | \$ 200            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 242 028       | 1 499             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 52          | 40                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 219          | INR 21 107        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| NSL          | 09/2026           | 107             | IDR 1 900 773     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY 1 958       | \$ 287            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1 241         | 1 643             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 289          | INR 27 676        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 519         | \$ 66             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 643        | £ 1 241           | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 167             | INR 16 035        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 1 214       | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 833       | 181               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 272          | IDR 4 888 808     | 1                  | (2)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CNH 1 571       | \$ 232            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 4 656         | 5 432             | 109                | 0                     | 109                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | £ 57            | 75                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 27 682        | 174               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 947          | AUD 1 372         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SSB          | 07/2026           | \$ 5 345        | € 4 699           | \$ 27              | \$ 0                  | \$ 27                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | 4 660           | SGD 6 034         | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 372       | \$ 946            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 4 699         | 5 353             | 0                  | (27)                  | (27)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | SGD 6 021       | 4 660             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 75           | £ 57              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 2 908       | \$ 2 109          | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | HKD 49 542      | 6 406             | 86                 | 0                     | 86                                      | 0,03                |
|              | 07/2026           | IDR 6 916 845   | 390               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 18           | CAD 26            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | CAD 26          | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 108         | 14                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$ 185          | PLN 677           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 001           | CHF 1 615         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 1 610       | \$ 2 001          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 785             | \$ (892)              | \$ (107)                                | (0,04)              |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 12            | \$ 14             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 395        | € 2 057           | 0                  | (44)                  | (44)                                    | (0,02)              |
| CBK          | 07/2026           | € 20            | \$ 23             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 877           | 2 140             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$ 2 143        | € 1 877           | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 2 103         | \$ 2 391          | 1                  | (15)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14           | € 12              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 276           | 2 001             | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | 2 216           | 1 905             | 0                  | (38)                  | (38)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | € 2 001         | \$ 2 276          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 2 364        | € 2 027           | 0                  | (47)                  | (47)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 2 279           | 2 001             | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 14              | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 12            | \$ 14             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 33              | \$ (161)              | \$ (128)                                | (0,04)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | £ 104           | \$ 137            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 170          | £ 127             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 137             | 104               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 169          | £ 126             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 3               | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 25            | \$ 34             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           | \$ 34           | £ 25              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 121           | \$ 160            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 158          | £ 118             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | 160             | 121               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 120           | \$ 159            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 159          | £ 120             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 1             | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2               | \$ (7)                | \$ (5)                                  | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution et E en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 31 400       | SGD 40 041        | \$ 0               | \$ (444)              | \$ (444)                                | (0,15)              |
|              | 08/2026           | 27 227          | 35 184            | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,01                |
| BOA          | 07/2026           | SGD 18 379      | \$ 14 200         | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 27 970       | SGD 35 725        | 0                  | (351)                 | (351)                                   | (0,12)              |
|              | 08/2026           | 14 200          | 18 337            | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD 168         | \$ 130            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 372          | SGD 479           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 541         | \$ 419            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 22 326          | 17 215            | 0                  | (46)                  | (46)                                    | (0,02)              |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|                                                    | 07/2026           | \$ 32 043       | SGD 40 880        | \$ 0               | \$ (439)              | \$ (439)                                | (0,15)              |
|                                                    | 08/2026           | 17 215          | 22 275            | 47                 | 0                     | 47                                      | 0,02                |
| MBC                                                | 07/2026           | SGD 167         | \$ 130            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 38           | SGD 49            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI                                                | 07/2026           | 112             | 145               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | SGD 4 444       | \$ 3 432          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 3 432        | SGD 4 434         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| RBC                                                | 07/2026           | 36              | 47                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | SGD 43 265      | \$ 33 409         | 0                  | (40)                  | (40)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 5 090        | SGD 6 491         | 0                  | (71)                  | (71)                                    | (0,03)              |
|                                                    | 08/2026           | 33 409          | 43 168            | 43                 | 0                     | 43                                      | 0,01                |
| UAG                                                | 07/2026           | 115             | 149               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 24              | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 142             | \$ (1 406)            | \$ (1 264)                              | (0,44)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (1 933)                              | (0,67)              |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 279 058                              | 97,21               |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 8 015                                | 2,79                |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 287 073                              | 100,00              |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (d) Titre à coupon zéro.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,15 %) :

| Description de l'émetteur        | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat            | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|----------------------------------|---------|-----------------|-------------------------|--------|--------------|---------------------|
| Development Bank of Mongolia LLC | 8,500 % | 03/07/2028      | 14/10/2025 - 22/01/2026 | \$ 613 | \$ 623       | 0,22                |
| Flourish Century                 | 6,600   | 04/02/2049      | 03/02/2026              | 0      | 0            | 0,00                |
|                                  |         |                 |                         | \$ 613 | \$ 623       | 0,22                |

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 1 212 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 406 \$ (31 décembre 2025 : 1 565 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 590 \$ (31 décembre 2025 : 430 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 20                                                                             | \$ 263 041                                           | \$ 2 322                                          | \$ 265 383   |
| Fonds d'investissement                        | 15 435                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 15 435       |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (28)                                                                              | (1 732)                                              | 0                                                 | (1 760)      |
| Totaux                                        | \$ 15 427                                                                         | \$ 261 309                                           | \$ 2 322                                          | \$ 279 058   |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 247 806                                           | \$ 2 950                                          | \$ 250 756   |
| Fonds d'investissement                        | 27 821                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 27 821       |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 13                                                                                | 248                                                  | 0                                                 | 261          |
| Totaux                                        | \$ 27 834                                                                         | \$ 248 054                                           | \$ 2 950                                          | \$ 278 838   |

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

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

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

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (352)                                                   | \$ 280                  | \$ (72)                           | \$ 1                                                       | \$ 0                    | \$ 1                              |
| BOA          | (425)                                                      | 300                     | (125)                             | 22                                                         | 0                       | 22                                |
| BPS          | (75)                                                       | 10                      | (65)                              | (52)                                                       | 0                       | (52)                              |
| BRC          | 42                                                         | 0                       | 42                                | 44                                                         | 0                       | 44                                |
| CBK          | (317)                                                      | 300                     | (17)                              | (19)                                                       | 20                      | 1                                 |
| DBL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| DUB          | (104)                                                      | 0                       | (104)                             | (78)                                                       | 0                       | (78)                              |
| FAR          | (385)                                                      | 310                     | (75)                              | 49                                                         | 0                       | 49                                |
| GLM          | 16                                                         | 0                       | 16                                | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| GST          | (108)                                                      | 110                     | 2                                 | (102)                                                      | 150                     | 48                                |
| IND          | (83)                                                       | 0                       | (83)                              | (6)                                                        | 0                       | (6)                               |
| JPM          | (17)                                                       | 0                       | (17)                              | (36)                                                       | 0                       | (36)                              |
| MBC          | (24)                                                       | 0                       | (24)                              | 116                                                        | 0                       | 116                               |
| MYC          | (223)                                                      | 260                     | 37                                | (239)                                                      | 260                     | 21                                |
| MYI          | 9                                                          | 20                      | 29                                | 206                                                        | (280)                   | (74)                              |
| NSL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 16                                                         | 0                       | 16                                |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| SCX          | (33)                                                       | 0                       | (33)                              | 14                                                         | 0                       | 14                                |
| SOG          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 238                                                        | (290)                   | (52)                              |
| SSB          | 150                                                        | 0                       | 150                               | 16                                                         | 0                       | 16                                |
| UAG          | (5)                                                        | 0                       | (5)                               | 5                                                          | 0                       | 5                                 |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (9)                                                        | 0                       | (9)                               |

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

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 71,77            | 74,94                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 18,37            | 11,01                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,87             | 0,74                 |
| Fonds d'investissement                                           | 5,29             | 9,62                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,09             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,01             | 0,05                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,35             | 0,46                 |
| Autres actifs                                                    | 3,25             | 3,17                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 2,86             | 1,69                 |
| Bermudes                          | 0,07             | 0,53                 |
| Canada                            | 0,14             | 0,37                 |
| Îles Caïmans                      | 12,86            | 10,78                |
| Chili                             | S/O              | 0,23                 |
| Chine                             | 0,97             | 0,72                 |
| Colombie                          | 2,10             | 0,90                 |
| Costa Rica                        | 0,11             | S/O                  |
| France                            | S/O              | 0,24                 |
| Hong Kong                         | 4,25             | 5,04                 |
| Inde                              | 11,87            | 8,69                 |
| Indonésie                         | 5,73             | 8,26                 |
| Île de Man                        | 0,50             | S/O                  |
| Japon                             | 2,82             | 2,93                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,42             | S/O                  |
| Kazakhstan                        | 0,09             | 0,08                 |
| Luxembourg                        | 1,06             | 1,42                 |
| Malaisie                          | 3,29             | 2,40                 |
| Île Maurice                       | 1,07             | 0,85                 |
| Mexique                           | 0,43             | 0,68                 |
| Mongolie                          | 1,87             | 1,18                 |
| Pays-Bas                          | 1,94             | 1,51                 |
| Nouvelle-Zélande                  | S/O              | 0,46                 |
| Nigeria                           | 0,24             | S/O                  |
| Pakistan                          | 2,14             | 2,07                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Philippines                                                                                              | 3,52             | 7,34                 |
| Singapour                                                                                                | 5,18             | 4,24                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 0,21             | 0,20                 |
| Corée du Sud                                                                                             | 3,87             | 4,44                 |
| Espagne                                                                                                  | 0,26             | 0,34                 |
| Sri Lanka                                                                                                | 2,86             | 2,79                 |
| Thaïlande                                                                                                | 2,86             | 2,44                 |
| Turquie                                                                                                  | 0,28             | 0,47                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,17             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                                                              | 6,63             | 8,42                 |
| États-Unis                                                                                               | 5,02             | 2,85                 |
| Vietnam                                                                                                  | 0,56             | 0,57                 |
| Îles Vierges britanniques                                                                                | 3,55             | 2,04                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,64             | 0,92                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 5,38             | 9,77                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,08             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,01             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,03)           | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | S/O              | 0,03                 |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,02                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | S/O              | (0,01)               |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,17)           | (0,22)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | 0,02                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,04)           | (0,02)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,48)           | 0,26                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 2,79             | 2,05                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>              |                                     |                                  |                           | 5,936 % éch. 30/05/2035                      | \$ 9 420                            | \$ 9 669                         | 0,06                      | Goldman Sachs Group, Inc.                                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |                                     |                                  |                           | 6,293 % éch. 14/01/2036                      | 8 100                               | 8 466                            | 0,05                      | 4,148 % éch. 21/01/2029                                                               | \$ 6 500                            | \$ 6 445                         | 0,04                      |
| Altice France S.A.                     |                                     |                                  |                           | 7,003 % éch. 19/10/2034                      | 2 000                               | 2 179                            | 0,01                      | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,798 % éch. 30/04/2028                | \$ 5 064                            | \$ 5 091                         | 0,03                      | CaixaBank S.A.                               |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 29/04/2033                                                               | € 31 800                            | 36 399                           | 0,22                      |
| 8,735 % - 8,736 %                      |                                     |                                  |                           | 5,673 % éch. 15/03/2030                      | 200                                 | 205                              | 0,00                      | HLD Europe S.C.A.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| éch. 30/10/2028                        | 1 376                               | 1 377                            | 0,01                      | 6,037 % éch. 15/06/2035                      | 200                                 | 209                              | 0,00                      | 4,125 % éch. 02/04/2030                                                               | 300                                 | 346                              | 0,00                      |
| 9,048 % éch. 14/05/2029                | 1 669                               | 1 676                            | 0,01                      | CI Financial Corp.                           |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 10,548 % éch. 31/05/2031               | 26 737                              | 27 353                           | 0,17                      | 4,625 % éch. 12/12/2031                      | € 3 880                             | 4 497                            | 0,03                      | 4,041 % éch. 13/03/2028                                                               | \$ 1 000                            | 996                              | 0,01                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.        |                                     |                                  |                           | Citadel Finance LLC                          |                                     |                                  |                           | 6,254 % éch. 09/03/2034                                                               | 1 100                               | 1 166                            | 0,01                      |
| 6,144 % éch. 03/06/2033                | 18 144                              | 18 172                           | 0,11                      | 4,750 % éch. 14/02/2029                      | \$ 1 400                            | 1 378                            | 0,01                      | IHG Finance LLC                                                                       |                                     |                                  |                           |
| DK Crown Holdings, Inc.                |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 14/02/2031                      | 700                                 | 684                              | 0,01                      | 4,375 % éch. 28/11/2029                                                               | € 1 400                             | 1 652                            | 0,01                      |
| 5,374 % éch. 04/03/2032                | 1 975                               | 1 973                            | 0,01                      | Citadel Securities Global Holdings LLC       |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Poseidon Bidco SASU                    |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 27/01/2032                      | 1 700                               | 1 680                            | 0,01                      | 5,550 % éch. 19/03/2035                                                               | \$ 300                              | 306                              | 0,00                      |
| 7,504 % éch. 13/03/2030                | € 600                               | 199                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 27/03/2036                      | 2 600                               | 2 582                            | 0,02                      | Intesa Sanpaolo SpA                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Project Dorchester                     |                                     |                                  |                           | Commerzbank AG                               |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 01/06/2042                                                               | 2 700                               | 2 358                            | 0,02                      |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (l)            | 900                                 | 1 029                            | 0,01                      | 3,625 % éch. 14/01/2032                      | € 100                               | 115                              | 0,00                      | 5,000 % éch. 29/06/2030                                                               | 3 500                               | 3 505                            | 0,02                      |
| République du Panama                   |                                     |                                  |                           | Cousins Properties LP                        |                                     |                                  |                           | Jackson National Life Global Funding                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                | 700                                 | 802                              | 0,00                      | 5,375 % éch. 15/02/2032                      | \$ 100                              | 101                              | 0,00                      | 4,603 % éch. 14/01/2028                                                               | 300                                 | 300                              | 0,00                      |
| Syniverse Holdings, Inc.               |                                     |                                  |                           | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 13/01/2027                                                               | 300                                 | 301                              | 0,00                      |
| 10,732 % éch. 13/05/2027               | \$ 1 179                            | 1 028                            | 0,01                      | 10,100 % éch. 15/12/2043                     | PEN 492                             | 159                              | 0,00                      | JPMorgan Chase & Co.                                                                  |                                     |                                  |                           |
| TransDigm, Inc.                        |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole Assurances S.A.              |                                     |                                  |                           | 2,522 % éch. 22/04/2031                                                               | 1 200                               | 1 106                            | 0,01                      |
| 6,144 % éch. 13/02/2033                | 4 750                               | 4 755                            | 0,03                      | 6,250 % éch.                                 |                                     |                                  |                           | 4,457 % éch. 13/11/2031                                                               | € 25 900                            | 30 951                           | 0,19                      |
| U.S. Renal Care, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 17/06/2035 (h)(j)                            | € 900                               | 1 071                            | 0,01                      | 4,490 % éch. 22/10/2028                                                               | \$ 1 200                            | 1 205                            | 0,01                      |
| 8,758 % éch. 28/06/2028                | 4 464                               | 4 401                            | 0,03                      | Credit Agricole Opportunities Partners       |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     | 67 856                           | 0,42                      | 6,520 % éch. 20/03/2028 (l)                  | \$ 1 000                            | 999                              | 0,01                      | 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               | 14                                  | 1                                | 0,00                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,740 % éch. 20/03/2030 (l)                  | 1 000                               | 996                              | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole S.A.                         |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/12/2028 (c)                                                           | 112                                 | 3                                | 0,00                      |
| <b>BANQUE ET FINANCE</b>               |                                     |                                  |                           | 5,862 % éch. 09/01/2036                      | 1 200                               | 1 236                            | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| ABN AMRO Bank NV                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch.                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 28/12/2029 (c)                                                           | 188                                 | 4                                | 0,00                      |
| 6,875 % éch. 22/09/2031 (h)(j)         | € 3 300                             | 4 109                            | 0,03                      | 23/09/2029 (h)(j)                            | € 600                               | 726                              | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| AIB Group PLC                          |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch.                                 |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 28/12/2030 (c)                                                           | 227                                 | 4                                | 0,00                      |
| 7,125 % éch. 30/10/2029 (h)(j)         | 1 700                               | 2 100                            | 0,01                      | 23/09/2028 (h)(j)                            | 1 800                               | 2 186                            | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| American Express Co.                   |                                     |                                  |                           | Crown Castle, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/12/2031 (c)                                                           | 342                                 | 6                                | 0,00                      |
| 4,009 % éch. 09/02/2029                | \$ 3 500                            | 3 470                            | 0,02                      | 2,900 % éch. 15/03/2027                      | \$ 700                              | 693                              | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| American Honda Finance Corp.           |                                     |                                  |                           | DaVinciRe Holdings Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 28/12/2032 (c)                                                           | 322                                 | 6                                | 0,00                      |
| 4,900 % éch. 12/03/2027                | 200                                 | 201                              | 0,00                      | 5,950 % éch. 15/04/2035                      | 800                                 | 822                              | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| Athene Global Funding                  |                                     |                                  |                           | Deutsche Bank AG                             |                                     |                                  |                           | Lincoln Financial Global Funding                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,204 % éch. 23/02/2027                | € 2 000                             | 2 291                            | 0,02                      | 1,750 % éch. 19/11/2030                      | € 1 900                             | 2 057                            | 0,01                      | 5,300 % éch. 13/01/2030                                                               | 100                                 | 101                              | 0,00                      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.           |                                     |                                  |                           | Equitable Financial Life Global Funding      |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,528 % éch. 18/11/2027                | \$ 95                               | 92                               | 0,00                      | 4,875 % éch. 19/11/2027                      | \$ 1 500                            | 1 505                            | 0,01                      | 3,750 % éch. 18/03/2028                                                               | € 1 100                             | 1 094                            | 0,01                      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA    |                                     |                                  |                           | Erste Group Bank AG                          |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 14/05/2032                                                               | \$ 1 700                            | 1 985                            | 0,01                      |
| 3,625 % éch. 27/11/2030                | € 300                               | 347                              | 0,00                      | 7,000 % éch.                                 |                                     |                                  |                           | 4,241 % éch. 10/02/2030                                                               | 200                                 | 201                              | 0,00                      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.   |                                     |                                  |                           | 15/04/2031 (h)(j)                            | € 1 600                             | 1 989                            | 0,01                      | 4,692 % éch. 26/11/2028                                                               | 200                                 | 201                              | 0,00                      |
| 4,150 % éch. 03/03/2029                | \$ 3 400                            | 3 351                            | 0,02                      | 8,500 % éch.                                 |                                     |                                  |                           | 5,087 % éch. 26/11/2028                                                               | 200                                 | 204                              | 0,00                      |
| 5,381 % éch. 13/03/2029                | 600                                 | 612                              | 0,01                      | 15/10/2028 (h)(j)                            | 1 800                               | 2 247                            | 0,02                      | 5,590 % éch. 26/11/2035                                                               | 200                                 | 204                              | 0,00                      |
| 6,033 % éch. 13/03/2035                | 600                                 | 624                              | 0,01                      | Extra Space Storage LP                       | \$ 1 600                            | 1 638                            | 0,01                      | LPL Holdings, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Banco Santander S.A.                   |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/07/2030                      |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 15/03/2030                                                               | 2 000                               | 2 014                            | 0,01                      |
| 1,722 % éch. 14/09/2027                | 200                                 | 199                              | 0,00                      | F&G Global Funding                           |                                     |                                  |                           | Lseg U.S. Fin Corp.                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,958 % éch. 25/03/2031                | 9 000                               | 8 261                            | 0,05                      | 5,875 % éch. 16/01/2030                      | 1 600                               | 1 619                            | 0,01                      | 4,250 % éch. 23/03/2029                                                               | 2 200                               | 2 175                            | 0,01                      |
| 5,017 % éch. 14/03/2028                | 200                                 | 201                              | 0,00                      | First Abu Dhabi Bank PJSC                    |                                     |                                  |                           | Marex Group PLC                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 5,538 % éch. 14/03/2030                | 300                                 | 306                              | 0,00                      | 4,789 % éch. 03/06/2031                      | 28 000                              | 28 012                           | 0,17                      | 5,680 % éch. 21/04/2031                                                               | 4 800                               | 4 804                            | 0,03                      |
| 5,552 % éch. 14/03/2028                | 400                                 | 403                              | 0,00                      | Ford Motor Credit Co. LLC                    |                                     |                                  |                           | Mizuho Financial Group, Inc.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,565 % éch. 17/01/2030                | 600                                 | 615                              | 0,00                      | 2,900 % éch. 10/02/2029                      | 16 200                              | 15 250                           | 0,09                      | 5,382 % éch. 10/07/2030                                                               | 300                                 | 305                              | 0,00                      |
| 6,033 % éch. 17/01/2035                | 200                                 | 210                              | 0,00                      | 4,970 % éch. 06/04/2029                      | 12 900                              | 12 771                           | 0,08                      | 5,594 % éch. 10/07/2035                                                               | 300                                 | 308                              | 0,00                      |
| 6,938 % éch. 07/11/2033                | 1 200                               | 1 339                            | 0,01                      | 5,113 % éch. 03/05/2029                      | 8 660                               | 8 602                            | 0,05                      | Morgan Stanley                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.              |                                     |                                  |                           | 5,667 % éch. 20/03/2028                      | 4 800                               | 4 861                            | 0,03                      | 3,485 % éch. 11/06/2030                                                               | € 4 600                             | 5 289                            | 0,03                      |
| 5,343 % éch. 29/06/2029                | 4 700                               | 4 719                            | 0,03                      | 5,800 % éch. 05/03/2027                      | 200                                 | 201                              | 0,00                      | 3,790 % éch. 21/03/2030                                                               | 8 100                               | 9 394                            | 0,06                      |
| Bank of America Corp.                  |                                     |                                  |                           | 5,918 % éch. 20/03/2028                      | 1 700                               | 1 722                            | 0,01                      | 4,493 % éch. 16/01/2032                                                               | \$ 12 240                           | 12 005                           | 0,07                      |
| 1,102 % éch. 24/05/2032                | € 2 000                             | 2 055                            | 0,01                      | GA Global Funding Trust                      |                                     |                                  |                           | 5,148 % éch. 25/01/2034                                                               | € 1 500                             | 1 866                            | 0,01                      |
| 4,477 % éch. 23/04/2030                | \$ 16 600                           | 16 497                           | 0,10                      | 5,200 % éch. 09/12/2031                      | 1 300                               | 1 285                            | 0,01                      | Morgan Stanley Private Bank N.A.                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/03/2028 (h)            | 602                                 | 608                              | 0,00                      | 5,400 % éch. 13/01/2030                      | 200                                 | 201                              | 0,00                      | 4,213 % éch. 08/02/2030                                                               | \$ 8 700                            | 8 588                            | 0,05                      |
| Bank of Nova Scotia                    |                                     |                                  |                           | 5,900 % éch. 13/01/2035                      | 200                                 | 202                              | 0,00                      | Nationwide Building Society                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,247 % éch. 02/02/2030                | 5 400                               | 5 335                            | 0,03                      | Gaci First Investment Co.                    |                                     |                                  |                           | 2,972 % éch. 16/02/2028                                                               | 2 100                               | 2 079                            | 0,01                      |
| Barclays PLC                           |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 29/01/2030                      | 3 900                               | 3 937                            | 0,03                      | NatWest Group PLC                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,219 % éch. 24/05/2030                | 7 800                               | 7 671                            | 0,05                      | GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 5,583 % éch. 01/03/2028                                                               | 200                                 | 201                              | 0,00                      |
| 4,972 % éch. 16/05/2029                | 800                                 | 803                              | 0,01                      | 5,617 % éch. 30/06/2032                      | AUD 46 400                          | 32 286                           | 0,20                      | 6,016 % éch. 02/03/2034                                                               | 1 900                               | 1 997                            | 0,01                      |
| 5,367 % éch. 25/02/2031                | 4 920                               | 4 990                            | 0,03                      | Galderma Finance Europe BV                   |                                     |                                  |                           | NatWest Markets PLC                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,674 % éch. 12/03/2028                | 200                                 | 202                              | 0,00                      | 3,500 % éch. 20/03/2030                      | € 300                               | 345                              | 0,00                      | 4,587 % éch. 21/03/2028                                                               | 2 000                               | 2 013                            | 0,01                      |
| Blue Owl Capital Corp.                 |                                     |                                  |                           | GATX Corp.                                   |                                     |                                  |                           | 4,654 % éch. 27/03/2029                                                               | 2 600                               | 2 597                            | 0,02                      |
| 6,450 % éch. 15/09/2028                | 4 500                               | 4 559                            | 0,03                      | 5,400 % éch. 15/03/2027                      | \$ 100                              | 101                              | 0,00                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                                                       |                                     |                                  |                           |
| BNP Paribas S.A.                       |                                     |                                  |                           | General Motors Financial Co., Inc.           |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 30/09/2030                                                               | 5 200                               | 5 116                            | 0,03                      |
| 3,583 % éch. 15/01/2031                | € 1 000                             | 1 151                            | 0,01                      | 2,350 % éch. 26/02/2027                      | 300                                 | 296                              | 0,00                      | Nomura Holdings, Inc.                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 14/08/2028 (h)(j)         | \$ 800                              | 844                              | 0,01                      | GLP Capital LP                               |                                     |                                  |                           | 4,886 % éch. 02/07/2027                                                               | 200                                 | 202                              | 0,00                      |
| BPCE S.A.                              |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 01/03/2036                      | 3 600                               | 3 530                            | 0,02                      | 5,594 % éch. 02/07/2027                                                               | 200                                 | 202                              | 0,00                      |
| 5,389 % éch. 28/05/2031                | 2 040                               | 2 063                            | 0,01                      | Goldman Sachs Bank USA                       |                                     |                                  |                           | 5,783 % éch. 03/07/2034                                                               | 200                                 | 206                              | 0,00                      |
| 5,876 % éch. 14/01/2031                | 250                                 | 257                              | 0,00                      | 4,656 % éch. 03/06/2029                      | 12 000                              | 12 009                           | 0,07                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |



Rapport semestriel | 30 juin 2026 145



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

| DESCRIPTION                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                                           | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Dominion Energy, Inc.<br>5,000 % éch. 15/06/2030                                     | \$                                  | 2 100                            | \$                        | 2 124       | 0,01                                | Titre adossé à des créances hypothécaires uniformes (UMBS), TBA                            |                           | Citigroup Commercial Mortgage Trust |                                     |                                  |                           |
| Edison International<br>5,000 % éch. 05/05/2028                                      |                                     | 3 300                            |                           | 3 305       | 0,02                                | 3,500 % éch. 01/08/2056                                                                    | \$                        | 15 600                              | \$                                  | 13 596                           | 0,08                      |
| 6,250 % éch. 15/03/2030                                                              |                                     | 8 700                            |                           | 8 943       | 0,06                                | 4,000 % éch. 01/08/2056                                                                    |                           | 29 400                              |                                     | 26 656                           | 0,16                      |
| Evergy Kansas Central, Inc.<br>4,700 % éch. 13/03/2028                               |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/09/2056                                                    |                           | 50 000                              |                                     | 46 703                           | 0,29                      |
| NorthWestern Corp.<br>5,073 % éch. 21/03/2030                                        |                                     | 300                              |                           | 303         | 0,00                                | 5,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/09/2056                                                    |                           | 204 280                             |                                     | 195 530                          | 1,20                      |
| ONEOK, Inc.<br>5,200 % éch. 15/07/2048                                               |                                     | 1 600                            |                           | 1 419       | 0,01                                | 6,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/09/2056                                                    |                           | 370 475                             |                                     | 371 199                          | 2,28                      |
| 5,650 % éch. 01/09/2034                                                              |                                     | 2 300                            |                           | 2 345       | 0,02                                | 6,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                                                    |                           | 253 100                             |                                     | 257 875                          | 1,58                      |
| Pacific Gas & Electric Co.<br>2,500 % éch. 01/02/2031                                |                                     | 3 730                            |                           | 3 348       | 0,02                                |                                                                                            |                           | 228 153                             |                                     | 235 804                          | 1,45                      |
| 3,300 % éch. 15/03/2027                                                              |                                     | 400                              |                           | 397         | 0,00                                |                                                                                            |                           |                                     |                                     | 2 546 858                        | 15,62                     |
| 5,000 % éch. 04/06/2028                                                              |                                     | 200                              |                           | 201         | 0,00                                | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                            |                           |                                     |                                     | 4 177 % éch. 20/02/2036          |                           |
| 5,200 % éch. 01/05/2036                                                              |                                     | 11 300                           |                           | 10 980      | 0,07                                | Obligations du Trésor américain                                                            |                           |                                     |                                     | 4,383 % éch. 25/04/2035          |                           |
| 5,700 % éch. 01/03/2035                                                              |                                     | 3 400                            |                           | 3 437       | 0,02                                | 1,375 % éch. 15/11/2040                                                                    |                           | 5 700                               |                                     | 3 687                            | 0,02                      |
| 5,900 % éch. 15/06/2032                                                              |                                     | 5 700                            |                           | 5 897       | 0,04                                | 4,000 % éch. 15/11/2042                                                                    |                           | 3 040                               |                                     | 2 744                            | 0,02                      |
| 6,000 % éch. 15/08/2035                                                              |                                     | 500                              |                           | 516         | 0,00                                | 4,000 % éch. 15/11/2052                                                                    |                           | 2 290                               |                                     | 1 960                            | 0,01                      |
| 6,100 % éch. 15/01/2029                                                              |                                     | 7 500                            |                           | 7 724       | 0,05                                | 4,250 % éch. 15/08/2054                                                                    |                           | 1 000                               |                                     | 893                              | 0,01                      |
| Public Service Enterprise Group, Inc.<br>4,900 % éch. 15/03/2030                     |                                     | 100                              |                           | 101         | 0,00                                | 4,500 % éch. 15/11/2054                                                                    |                           | 5 600                               |                                     | 5 214                            | 0,03                      |
| Severn Trent Utilities Finance PLC<br>3,875 % éch. 04/08/2035                        | €                                   | 200                              |                           | 228         | 0,00                                | 4,625 % éch. 15/11/2045                                                                    |                           | 18 707                              |                                     | 17 971                           | 0,11                      |
| SW Finance PLC<br>5,750 % éch. 19/11/2030                                            | £                                   | 3 300                            |                           | 4 273       | 0,03                                | 4,750 % éch. 15/02/2056                                                                    |                           | 66 076                              |                                     | 64 202                           | 0,39                      |
| 6,125 % éch. 19/11/2033                                                              |                                     | 10 100                           |                           | 12 867      | 0,08                                | 4,875 % éch. 15/08/2045                                                                    |                           | 922                                 |                                     | 915                              | 0,01                      |
| Vistra Operations Co. LLC<br>4,700 % éch. 31/01/2031                                 | \$                                  | 5 370                            |                           | 5 270       | 0,03                                | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (g)                                 |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| Xcel Energy, Inc.<br>1,750 % éch. 15/03/2027                                         |                                     | 400                              |                           | 393         | 0,00                                | 0,625 % éch. 15/02/2043                                                                    |                           | 1 882                               |                                     | 1 374                            | 0,01                      |
| 4,750 % éch. 21/03/2028                                                              |                                     | 100                              |                           | 100         | 0,00                                | 0,750 % éch. 15/02/2045                                                                    |                           | 16 287                              |                                     | 11 576                           | 0,07                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           | 86 392      | 0,53                                | 0,875 % éch. 15/02/2047                                                                    |                           | 1 655                               |                                     | 1 164                            | 0,01                      |
| Total des Obligations et billets privés                                              |                                     |                                  |                           | 920 653     | 5,64                                | 1,000 % éch. 15/02/2048                                                                    |                           | 16 606                              |                                     | 11 825                           | 0,07                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                                                  |                                     |                                  |                           |             |                                     | 1,000 % éch. 15/02/2049                                                                    |                           | 12 304                              |                                     | 8 646                            | 0,05                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.<br>0,000 % éch. 31/12/2026 (e)                             |                                     | 67                               |                           | 0           | 0,00                                | 1,125 % éch. 15/01/2033                                                                    |                           | 16 206                              |                                     | 15 334                           | 0,09                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (e)                                                          |                                     | 84                               |                           | 0           | 0,00                                | 1,375 % éch. 15/07/2033                                                                    |                           | 38 038                              |                                     | 36 499                           | 0,22                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (e)                                                          |                                     | 134                              |                           | 1           | 0,00                                | 1,625 % éch. 15/04/2030                                                                    |                           | 19 871                              |                                     | 19 635                           | 0,12                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (e)                                                          |                                     | 134                              |                           | 1           | 0,00                                | 1,875 % éch. 15/07/2034                                                                    |                           | 82 228                              |                                     | 81 068                           | 0,50                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (e)                                                          |                                     | 167                              |                           | 1           | 0,00                                | 1,875 % éch. 15/07/2035                                                                    |                           | 209 494                             |                                     | 204 914                          | 1,26                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (e)                                                          |                                     | 167                              |                           | 1           | 0,00                                | 2,125 % éch. 15/02/2054                                                                    |                           | 3 037                               |                                     | 2 655                            | 0,02                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (e)                                                          |                                     | 291                              |                           | 1           | 0,00                                | Billets du Trésor américain                                                                |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5           | 0,00                                | 4,000 % éch. 31/07/2029                                                                    |                           | 3 400                               |                                     | 3 384                            | 0,02                      |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,000 % éch. 31/07/2032                                                                    |                           | 22 500                              |                                     | 22 178                           | 0,14                      |
| Fannie Mae<br>2,838 % éch. 25/03/2036 (a)                                            |                                     | 60                               |                           | 6           | 0,00                                | 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                    |                           | 810                                 |                                     | 790                              | 0,00                      |
| Freddie Mac<br>2,382 % éch. 15/05/2035                                               |                                     | 122                              |                           | 120         | 0,00                                | 4,375 % éch. 30/11/2030                                                                    |                           | 22 500                              |                                     | 22 655                           | 0,14                      |
| 2,393 % éch. 15/08/2043 (a)                                                          |                                     | 232                              |                           | 29          | 0,00                                | 5,000 % éch. 15/04/2027                                                                    |                           | 5 500                               |                                     | 5 520                            | 0,03                      |
| Ginnie Mae<br>3,000 % éch. 20/05/2052                                                |                                     | 1 758                            |                           | 1 563       | 0,01                                |                                                                                            |                           |                                     |                                     | 546 803                          | 3,35                      |
| 3,500 % éch. 20/02/2055 -<br>20/11/2055                                              |                                     | 27 998                           |                           | 25 166      | 0,15                                | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR<br>DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,509 % éch. 20/09/2071                                                              |                                     | 5 471                            |                           | 5 532       | 0,03                                | AFG Trust<br>5,012 % éch. 10/10/2057                                                       | AUD                       | 8 183                               |                                     | 5 668                            | 0,04                      |
| 4,927 % éch. 20/08/2068                                                              |                                     | 660                              |                           | 662         | 0,00                                | 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                    |                           | 13 400                              |                                     | 9 259                            | 0,06                      |
| Ginnie Mae, TBA<br>3,500 % éch. 01/07/2056                                           |                                     | 6 000                            |                           | 5 389       | 0,03                                | American Home Mortgage Investment Trust<br>4,343 % éch. 25/11/2045                         | \$                        | 4 643                               |                                     | 4 268                            | 0,03                      |
| 5,000 % éch. 01/08/2056                                                              |                                     | 47 000                           |                           | 46 292      | 0,28                                | 5,876 % éch. 25/12/2036                                                                    |                           | 404                                 |                                     | 343                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                                              |                                     | 2 100                            |                           | 2 108       | 0,01                                | Aran Funding DAC<br>3,379 % éch. 24/12/2065                                                |                           | 9 947                               |                                     | 11 391                           | 0,07                      |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                                              |                                     | 3 900                            |                           | 3 973       | 0,03                                | Atlas Funding PLC<br>4,563 % éch. 20/01/2068                                               | £                         | 17 800                              |                                     | 23 671                           | 0,15                      |
| 6,500 % éch. 01/08/2056                                                              |                                     | 5 900                            |                           | 6 104       | 0,04                                | 5,034 % éch. 20/09/2061                                                                    |                           | 949                                 |                                     | 1 265                            | 0,01                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>3,000 % éch. 01/10/2053 |                                     | 30 433                           |                           | 26 573      | 0,16                                | Auburn PLC<br>0,000 % éch.                                                                 |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/02/2055 -<br>01/05/2056                                              |                                     | 68 002                           |                           | 63 617      | 0,39                                | 20/07/2045 (e)                                                                             |                           | 3 726                               |                                     | 3 571                            | 0,02                      |
| 4,500 % éch. 01/02/2056                                                              |                                     | 52 203                           |                           | 50 046      | 0,31                                | 0,000 % éch.                                                                               |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/02/2053 -<br>01/05/2056                                              |                                     | 323 079                          |                           | 318 315     | 1,95                                | 20/07/2045 (a)(e)                                                                          |                           | 180                                 |                                     | 0                                | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/04/2054 -<br>01/11/2055                                              |                                     | 125 994                          |                           | 126 596     | 0,78                                | 5,734 % éch. 20/07/2045                                                                    |                           | 137                                 |                                     | 18                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 01/10/2053 -<br>01/08/2055                                              |                                     | 163 241                          |                           | 167 108     | 1,03                                | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust<br>3,966 % éch. 10/08/2033                   | \$                        | 4 719                               |                                     | 4 411                            | 0,03                      |
| 6,500 % éch. 01/04/2055                                                              |                                     | 158                              |                           | 165         | 0,00                                | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust<br>4,073 % éch. 25/07/2036                     |                           | 68                                  |                                     | 59                               | 0,00                      |
| 7,000 % éch. 01/01/2054                                                              |                                     | 980                              |                           | 1 043       | 0,01                                | 4,329 % éch. 25/02/2036                                                                    |                           | 28                                  |                                     | 26                               | 0,00                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | Bear Stearns Mortgage Funding Trust<br>4,063 % éch. 25/04/2037                             |                           | 1 111                               |                                     | 1 037                            | 0,01                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,123 % éch. 25/10/2036                                                                    |                           | 2 473                               |                                     | 2 223                            | 0,01                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | Benchmark Mortgage Trust<br>3,976 % éch. 15/07/2051                                        |                           | 7 236                               |                                     | 7 221                            | 0,04                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,077 % éch. 15/07/2051                                                                    |                           | 1 631                               |                                     | 1 627                            | 0,01                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,149 % éch. 15/01/2052                                                                    |                           | 5 301                               |                                     | 5 292                            | 0,03                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,203 % éch. 10/10/2051                                                                    |                           | 868                                 |                                     | 867                              | 0,01                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,377 % éch. 15/05/2053                                                                    |                           | 6 081                               |                                     | 6 071                            | 0,04                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | Bletchley Park Funding PLC<br>5,034 % éch. 27/07/2070                                      | £                         | 1 500                               |                                     | 2 001                            | 0,01                      |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                                            |                           |                                     |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| IndyMac Mortgage Loan Trust                         |                                     |                                     |                           | 3,462 % éch. 25/08/2055                                        | \$ 3 500                            | \$ 3 242                         | 0,02                      | Invesco Commercial Real Estate Finance Trust LLC                           |                                     |                                  |                           |
| 3,603 % éch. 25/10/2035                             | \$ 523                              | \$ 415                              | 0,00                      | 3,500 % éch. 25/02/2055                                        | 312                                 | 310                              | 0,00                      | 5,050 % éch. 19/01/2044                                                    | \$ 12 000                           | \$ 12 006                        | 0,07                      |
| 4,083 % éch. 25/04/2037                             | 1 271                               | 1 156                               | 0,01                      | 3,631 % éch. 25/06/2057                                        | 2 245                               | 1 965                            | 0,01                      | 5,120 % éch. 19/12/2043                                                    | 29 200                              | 29 235                           | 0,18                      |
| 4,323 % éch. 25/07/2035                             | 79                                  | 56                                  | 0,00                      | 3,719 % éch. 25/10/2056                                        | 2 877                               | 2 613                            | 0,02                      | LRECS LLC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/08/2037                             | 1 502                               | 521                                 | 0,00                      | 3,750 % éch. 25/07/2056                                        | 1 364                               | 1 349                            | 0,01                      | 5,139 % éch. 19/08/2043                                                    | 10 400                              | 10 403                           | 0,06                      |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust |                                     |                                     |                           | 3,909 % éch. 25/07/2056                                        | 3 474                               | 3 321                            | 0,02                      |                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,802 % éch. 05/07/2033                             | 510                                 | 494                                 | 0,00                      | 4,000 % éch. 25/04/2056                                        | 501                                 | 499                              | 0,00                      |                                                                            |                                     | 77 057                           | 0,47                      |
| JPMorgan Mortgage Trust                             |                                     |                                     |                           | 4,072 % éch. 25/04/2056                                        | 6 192                               | 5 991                            | 0,04                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,701 % éch. 25/11/2035                             | 2 268                               | 1 756                               | 0,01                      | 4,294 % éch. 25/02/2055                                        | 4 484                               | 4 286                            | 0,03                      | Aames Mortgage Investment Trust                                            |                                     |                                  |                           |
| Kinbane DAC                                         |                                     |                                     |                           | Trinity Square PLC                                             |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/04/2036                                                    | 66                                  | 63                               | 0,00                      |
| 3,378 % éch. 24/08/2075                             | € 11 769                            | 13 479                              | 0,08                      | 5,047 % éch. 15/07/2059                                        | £ 1 900                             | 2 525                            | 0,02                      | 4,738 % éch. 25/10/2035                                                    | 2 500                               | 1 474                            | 0,01                      |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust            |                                     |                                     |                           | Triton Bond Trust                                              |                                     |                                  |                           | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 15/08/2057                             | AUD 12 023                          | 8 326                               | 0,05                      | 5,000 % éch. 15/02/2058                                        | AUD 426                             | 295                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                                                    | 216                                 | 160                              | 0,00                      |
| 5,167 % éch. 13/11/2057                             | 18 600                              | 12 888                              | 0,08                      | 5,250 % éch. 15/02/2058                                        | 27 300                              | 18 858                           | 0,12                      | 4,453 % éch. 25/11/2035                                                    | 2 612                               | 2 601                            | 0,02                      |
| 5,507 % éch. 13/11/2057                             | 18 600                              | 12 895                              | 0,08                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/08/2035                                                    | 602                                 | 593                              | 0,00                      |
| Lehman XS Trust                                     |                                     |                                     |                           | 4,283 % éch. 25/11/2045                                        | \$ 1 936                            | 1 839                            | 0,01                      | 4,888 % éch. 25/04/2035                                                    | 157                                 | 145                              | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/08/2046                             | \$ 723                              | 715                                 | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/04/2045                                        | 1 248                               | 1 222                            | 0,01                      | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates     |                                     |                                  |                           |
| 4,283 % éch. 25/02/2046                             | 806                                 | 743                                 | 0,01                      | 4,423 % éch. 25/01/2045                                        | 1 537                               | 1 510                            | 0,01                      | 4,408 % éch. 25/12/2035                                                    | 3 291                               | 3 135                            | 0,02                      |
| 4,303 % éch. 25/12/2035                             | 1 431                               | 1 379                               | 0,01                      | 4,483 % éch. 25/07/2045                                        | 81                                  | 78                               | 0,00                      | 5,713 % éch. 25/06/2034                                                    | 494                                 | 479                              | 0,00                      |
| Liberty Trust                                       |                                     |                                     |                           | 4,563 % éch. 25/01/2045                                        | 396                                 | 385                              | 0,00                      | Ameriquet Mortgage Securities Trust                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,012 % éch. 10/10/2058                             | AUD 7 012                           | 4 857                               | 0,03                      | 4,683 % éch. 25/10/2044                                        | 63                                  | 62                               | 0,00                      | 3,923 % éch. 25/10/2036                                                    | 8 890                               | 2 687                            | 0,02                      |
| 5,305 % éch. 25/04/2058                             | 9 817                               | 6 809                               | 0,04                      | Warwick Finance Residential Mortgages PLC                      |                                     |                                  |                           | Ameriquet Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 5,312 % éch. 10/10/2058                             | 14 500                              | 10 030                              | 0,06                      | 5,396 % éch. 21/12/2049                                        | £ 2 013                             | 2 689                            | 0,02                      | 4,513 % éch. 25/01/2036                                                    | 291                                 | 288                              | 0,00                      |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust               |                                     |                                     |                           | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust     |                                     |                                  |                           | 4,678 % éch. 25/01/2035                                                    | 775                                 | 829                              | 0,01                      |
| 4,243 % éch. 25/05/2037                             | \$ 507                              | 200                                 | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                        | \$ 385                              | 276                              | 0,00                      | 5,638 % éch. 25/07/2034                                                    | 654                                 | 648                              | 0,00                      |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust              |                                     |                                     |                           | 7,000 % éch. 25/04/2037                                        | 321                                 | 167                              | 0,00                      | Argent Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 25/10/2036                             | 203                                 | 69                                  | 0,00                      | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                          |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/07/2036                                                    | 2 092                               | 1 119                            | 0,01                      |
| Merrion Square Residential DAC                      |                                     |                                     |                           | 4,058 % éch. 15/08/2051                                        | 6 810                               | 6 796                            | 0,04                      | 4,083 % éch. 25/05/2036                                                    | 371                                 | 87                               | 0,00                      |
| 3,378 % éch. 24/03/2081                             | € 1 282                             | 1 471                               | 0,01                      | 5,761 % éch. 15/09/2040                                        | 10 000                              | 9 871                            | 0,06                      | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates             |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                  |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     | 718 848                          | 4,41                      | 4,453 % éch. 25/11/2035                                                    | 609                                 | 550                              | 0,00                      |
| 3,943 % éch. 25/08/2036                             | \$ 2 639                            | 536                                 | 0,00                      | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                     |                                     |                                  |                           | Asset-Backed Funding Certificates Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,962 % éch. 25/06/2036                             | 820                                 | 215                                 | 0,00                      | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES                  |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/10/2036                                                    | 100                                 | 93                               | 0,00                      |
| Newgate Funding PLC                                 |                                     |                                     |                           | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                              |                                     |                                  |                           | 4,463 % éch. 25/06/2034                                                    | 352                                 | 344                              | 0,00                      |
| 4,066 % éch. 01/12/2050                             | £ 2 074                             | 2 673                               | 0,02                      | 2,953 % éch. 26/12/2041                                        | € 27 100                            | 31 038                           | 0,19                      | 4,498 % éch. 25/03/2035                                                    | 626                                 | 601                              | 0,00                      |
| Pepper Prime Trust                                  |                                     |                                     |                           | AutoFlorence SRL                                               |                                     |                                  |                           | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 4,999 % éch. 12/04/2067                             | AUD 2 630                           | 1 822                               | 0,01                      | 2,968 % éch. 24/12/2044                                        | 8 400                               | 9 633                            | 0,06                      | 3,589 % éch. 25/01/2036                                                    | 229                                 | 224                              | 0,00                      |
| PMF PLC                                             |                                     |                                     |                           | Bavarian Sky S.A.                                              |                                     |                                  |                           | 3,638 % éch. 25/12/2036                                                    | 291                                 | 288                              | 0,00                      |
| 4,495 % éch. 16/02/2063                             | £ 29 200                            | 38 779                              | 0,24                      | 2,705 % éch. 20/02/2034                                        | 7 500                               | 8 579                            | 0,05                      | 4,858 % éch. 25/02/2035                                                    | 521                                 | 542                              | 0,00                      |
| Polaris PLC                                         |                                     |                                     |                           | BBVA Consumer Auto                                             |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 27/03/2069                             | 24 200                              | 32 164                              | 0,20                      | 2,819 % éch. 25/02/2042                                        | 26 500                              | 30 325                           | 0,19                      | 4,043 % éch. 25/11/2036                                                    | 234                                 | 232                              | 0,00                      |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust              |                                     |                                     |                           | 2,879 % éch. 19/05/2042                                        | 5 600                               | 6 409                            | 0,04                      | 4,603 % éch. 25/08/2036                                                    | 434                                 | 429                              | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/06/2046                             | \$ 1 259                            | 260                                 | 0,00                      | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC                       |                                     |                                  |                           | Carrington Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/09/2036                             | 122                                 | 98                                  | 0,00                      | 2,779 % éch. 15/08/2033                                        | 5 674                               | 6 499                            | 0,04                      | 4,063 % éch. 25/08/2036                                                    | 2 897                               | 2 830                            | 0,02                      |
| 6,000 % éch. 25/12/2036                             | 241                                 | 202                                 | 0,00                      | E-Carat DE                                                     |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/10/2036                                                    | 452                                 | 445                              | 0,00                      |
| Resimac Premier Trust                               |                                     |                                     |                           | 2,634 % éch. 25/10/2034                                        | 17 000                              | 19 452                           | 0,12                      | 4,588 % éch. 25/02/2035                                                    | 138                                 | 138                              | 0,00                      |
| 5,093 % éch. 11/02/2058                             | AUD 19 500                          | 13 511                              | 0,08                      | FACT S.A.                                                      |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/05/2035                                                    | 384                                 | 374                              | 0,00                      |
| 5,423 % éch. 11/02/2058                             | 22 500                              | 15 590                              | 0,10                      | 2,915 % éch. 20/04/2033                                        | 18 350                              | 21 011                           | 0,13                      | 5,563 % éch. 25/05/2035                                                    | 400                                 | 347                              | 0,00                      |
| RMAC Securities PLC                                 |                                     |                                     |                           | First Mobility Swiss Lease                                     |                                     |                                  |                           | Centex Home Equity Loan Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,136 % éch. 12/06/2044                             | £ 405                               | 526                                 | 0,00                      | 2,959 % éch. 23/09/2033                                        | 24 078                              | 27 566                           | 0,17                      | 4,813 % éch. 25/10/2035                                                    | 993                                 | 989                              | 0,01                      |
| Santander Residential FT                            |                                     |                                     |                           | FTA Santander Consumer Spain Auto                              |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates       |                                     |                                  |                           |
| 3,088 % éch. 18/10/2068                             | € 8 321                             | 9 538                               | 0,06                      | 3,236 % éch. 22/09/2039                                        | 5 853                               | 6 710                            | 0,04                      | 4,768 % éch. 25/10/2034                                                    | 589                                 | 555                              | 0,00                      |
| Sapphire Trust Central Finance                      |                                     |                                     |                           | Fulvia SPV SRL                                                 |                                     |                                  |                           | 3,688 % éch. 25/10/2034                                                    | 2 327                               | 1 885                            | 0,01                      |
| 4,999 % éch. 12/02/2067                             | AUD 458                             | 317                                 | 0,00                      | 3,030 % éch. 23/12/2041                                        | 8 166                               | 9 358                            | 0,06                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,999 % éch. 12/12/2067                             | 10 167                              | 7 041                               | 0,04                      | Hill FL BV                                                     |                                     |                                  |                           | 4,798 % éch. 25/05/2035                                                    | 280                                 | 266                              | 0,00                      |
| 5,299 % éch. 12/12/2067                             | 14 500                              | 10 018                              | 0,06                      | 2,909 % éch. 18/10/2033                                        | 6 900                               | 7 890                            | 0,05                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |                                     |                                  |                           |
| Stratton Mortgage Funding PLC                       |                                     |                                     |                           | 2,939 % éch. 18/06/2034                                        | 13 500                              | 15 452                           | 0,09                      | 3,333 % éch. 25/03/2035                                                    | 1 110                               | 1 019                            | 0,01                      |
| 4,649 % éch. 28/06/2050                             | £ 797                               | 1 059                               | 0,01                      | Metro Finance Trust                                            |                                     |                                  |                           | 3,837 % éch. 25/12/2034                                                    | 1 605                               | 1 516                            | 0,01                      |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust         |                                     |                                     |                           | 5,370 % éch. 16/02/2033                                        | AUD 28 849                          | 19 989                           | 0,12                      | 3,943 % éch. 25/06/2047                                                    | 588                                 | 556                              | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/02/2037                             | \$ 272                              | 268                                 | 0,00                      | Panorama Auto Trust                                            |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/06/2047                                                    | 345                                 | 332                              | 0,00                      |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                 |                                     |                                     |                           | 5,230 % éch. 20/04/2034                                        | 14 137                              | 9 788                            | 0,06                      | 4,023 % éch. 25/12/2036                                                    | 159                                 | 150                              | 0,00                      |
| 5,178 % éch. 25/09/2037                             | 1 640                               | 1 361                               | 0,01                      | 5,367 % éch. 20/05/2034                                        | 45 000                              | 31 177                           | 0,19                      | 4,023 % éch. 25/06/2047                                                    | 2 919                               | 2 404                            | 0,02                      |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                     |                                     |                                     |                           | SC Sweden SARL                                                 |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/05/2035                                                    | 519                                 | 505                              | 0,00                      |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                             | £ 15 286                            | 20 301                              | 0,12                      | 2,825 % éch. 25/12/2039                                        | € 26 500                            | 30 334                           | 0,19                      | 4,108 % éch. 25/05/2047                                                    | 10 489                              | 10 275                           | 0,06                      |
| 5,147 % éch. 20/02/2054                             | 721                                 | 959                                 | 0,01                      | VCL Multi-Compartment S.A.                                     |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/06/2047                                                    | 301                                 | 290                              | 0,00                      |
| 7,247 % éch. 20/07/2053                             | 1 250                               | 1 661                               | 0,01                      | 2,394 % éch. 21/03/2033                                        | 26 500                              | 30 314                           | 0,18                      | 4,223 % éch. 25/05/2037                                                    | 7 252                               | 6 734                            | 0,04                      |
| 8,247 % éch. 20/07/2053                             | 1 250                               | 1 664                               | 0,01                      | 2,715 % éch. 21/11/2032                                        | 10 892                              | 12 465                           | 0,08                      | 4,423 % éch. 25/06/2036                                                    | 3 016                               | 2 923                            | 0,02                      |
| Towd Point Mortgage Trust                           |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,552 % éch. 25/05/2036                                                    | 3 151                               | 2 617                            | 0,02                      |
| 2,750 % éch. 25/06/2057                             | \$ 2 687                            | 2 647                               | 0,02                      |                                                                |                                     | 333 989                          | 2,05                      | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 2,750 % éch. 25/10/2057                             | 2 773                               | 2 746                               | 0,02                      | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES COMMERCIALES AUTRES |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 25/08/2055                             | 2 818                               | 2 745                               | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 25/06/2057                             | 3 912                               | 3 727                               | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 25/10/2057                             | 5 896                               | 5 683                               | 0,04                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/07/2056                             | 119                                 | 119                                 | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/10/2056                             | 158                                 | 158                                 | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/06/2057                             | 5 966                               | 5 400                               | 0,03                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/10/2057                             | 14 628                              | 13 034                              | 0,08                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
| 3,375 % éch. 25/10/2056                             | 2 904                               | 2 810                               | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 | 459                              | 0,00                      |
|                                                     |                                     |                                     |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                    | 466                                 |                                  |                           |

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

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC    |                                     |                                  |                           | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | Aurium CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,065 % éch. 25/07/2035                              | \$ 446                              | \$ 416                           | 0,00                      | 4,498 % éch. 25/09/2035                                            | \$ 1 199                            | \$ 1 179                         | 0,01                      | 3,011 % éch. 22/05/2034                           | € 8 698                             | \$ 9 951                         | 0,06                      |
| Ellington Loan Acquisition Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,588 % éch. 25/07/2035                                            | 551                                 | 533                              | 0,00                      | 3,113 % éch. 28/10/2034                           | 3 250                               | 3 720                            | 0,02                      |
| 4,863 % éch. 25/05/2037                              | 948                                 | 926                              | 0,01                      | 5,938 % éch. 25/10/2034                                            | 3 173                               | 2 740                            | 0,02                      | 3,347 % éch. 22/06/2034                           | 3 398                               | 3 882                            | 0,02                      |
| FBR Securitization Trust                             |                                     |                                  |                           | People's Choice Home Loan Securities Trust                         |                                     |                                  |                           | Barings Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| 4,468 % éch. 25/11/2035                              | 615                                 | 609                              | 0,00                      | 5,488 % éch. 25/10/2034                                            | 719                                 | 656                              | 0,00                      | 3,145 % éch. 25/07/2035                           | 8 200                               | 9 382                            | 0,06                      |
| Fremont Home Loan Trust                              |                                     |                                  |                           | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                            |                                     |                                  |                           | 3,426 % éch. 15/08/2039                           | 9 000                               | 10 298                           | 0,06                      |
| 4,063 % éch. 25/10/2036                              | 5 992                               | 2 341                            | 0,02                      | 3,265 % éch. 25/01/2036                                            | 239                                 | 231                              | 0,00                      | 3,444 % éch. 21/10/2038                           | 7 800                               | 8 931                            | 0,05                      |
| 4,438 % éch. 25/01/2036                              | 5 000                               | 4 306                            | 0,03                      | 4,258 % éch. 25/07/2036                                            | 167                                 | 159                              | 0,00                      | 4,154 % éch. 21/10/2038                           | 2 750                               | 3 164                            | 0,02                      |
| 4,828 % éch. 25/06/2035                              | 212                                 | 210                              | 0,00                      | Quest Trust                                                        |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 21/10/2038                           | 1 600                               | 1 839                            | 0,01                      |
| GSAA Home Equity Trust                               |                                     |                                  |                           | 4,343 % éch. 25/08/2036                                            | 672                                 | 606                              | 0,00                      | Bayfront IABS Pte Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| 4,708 % éch. 25/08/2035                              | 900                                 | 885                              | 0,01                      | RAAC Trust                                                         |                                     |                                  |                           | 4,992 % éch. 11/07/2047                           | \$ 12 900                           | 12 900                           | 0,08                      |
| GSAMP Trust                                          |                                     |                                  |                           | 4,588 % éch. 25/05/2046                                            | 912                                 | 905                              | 0,01                      | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.          |                                     |                                  |                           |
| 3,903 % éch. 25/12/2036                              | 158                                 | 78                               | 0,00                      | Renaissance Home Equity Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | 4,941 % éch. 11/04/2045                           | 1 594                               | 1 590                            | 0,01                      |
| 4,083 % éch. 25/04/2036                              | 1 226                               | 802                              | 0,01                      | 4,703 % éch. 25/05/2034                                            | 1 814                               | 1 650                            | 0,01                      | 4,951 % éch. 11/04/2045                           | 1 833                               | 1 829                            | 0,01                      |
| 4,263 % éch. 25/05/2046                              | 363                                 | 351                              | 0,00                      | 6,166 % éch. 25/05/2036                                            | 13 327                              | 6 061                            | 0,04                      | BBVA Consumer FTA                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,438 % éch. 25/11/2035                              | 358                                 | 351                              | 0,00                      | Residential Asset Securities Corp. Trust                           |                                     |                                  |                           | 2,849 % éch. 20/05/2039                           | € 7 596                             | 8 679                            | 0,05                      |
| Home Equity Asset Trust                              |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/11/2036                                            | 2 375                               | 2 043                            | 0,01                      | BCRED PC Static LLC                               |                                     |                                  |                           |
| 4,438 % éch. 25/02/2036                              | 1 776                               | 1 742                            | 0,01                      | 4,198 % éch. 25/06/2036                                            | 1 141                               | 1 127                            | 0,01                      | 4,974 % éch. 27/04/2036                           | \$ 30 000                           | 29 999                           | 0,18                      |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust                 |                                     |                                  |                           | 6,238 % éch. 25/11/2034                                            | 1 003                               | 1 008                            | 0,01                      | 5,334 % éch. 27/04/2036                           | 5 000                               | 5 000                            | 0,03                      |
| 4,103 % éch. 25/12/2036                              | 23 111                              | 5 568                            | 0,04                      | Saxon Asset Securities Trust                                       |                                     |                                  |                           | 5,534 % éch. 27/04/2036                           | 5 000                               | 5 000                            | 0,03                      |
| 4,143 % éch. 25/01/2037                              | 10 165                              | 7 021                            | 0,04                      | 4,563 % éch. 25/09/2047                                            | 10 946                              | 9 145                            | 0,06                      | Blackrock European CLO DAC                        |                                     |                                  |                           |
| 4,288 % éch. 25/02/2036                              | 1 000                               | 868                              | 0,01                      | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                     |                                     |                                  |                           | 3,158 % éch. 20/01/2036                           | € 2 000                             | 2 289                            | 0,01                      |
| 4,423 % éch. 25/12/2035                              | 3 154                               | 2 771                            | 0,02                      | 4,463 % éch. 25/05/2037                                            | 99                                  | 78                               | 0,00                      | BNPP AM Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch. 25/01/2036                              | 1 500                               | 1 304                            | 0,01                      | 4,483 % éch. 25/10/2035                                            | 600                                 | 542                              | 0,00                      | 3,454 % éch. 15/04/2031                           | 1 100                               | 1 260                            | 0,01                      |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.                  |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 25/02/2034                                            | 177                                 | 187                              | 0,00                      | Bosphorus CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,348 % éch. 25/05/2035                              | 236                                 | 235                              | 0,00                      | SG Mortgage Securities Trust                                       |                                     |                                  |                           | 4,295 % éch. 25/05/2034                           | 2 200                               | 2 521                            | 0,02                      |
| 4,468 % éch. 25/09/2035                              | 69                                  | 70                               | 0,00                      | 4,438 % éch. 25/10/2035                                            | 81                                  | 81                               | 0,00                      | Cairn CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,663 % éch. 25/09/2035                              | 1 800                               | 1 649                            | 0,01                      | Soundview Home Loan Trust                                          |                                     |                                  |                           | 3,434 % éch. 15/01/2040                           | 8 000                               | 9 154                            | 0,06                      |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/10/2036                                            | 1 411                               | 1 364                            | 0,01                      | 4,304 % éch. 15/01/2040                           | 4 000                               | 4 608                            | 0,03                      |
| 4,033 % éch. 25/06/2037                              | 1 006                               | 987                              | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/11/2036                                            | 675                                 | 649                              | 0,00                      | Capital Four CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/03/2037                              | 1 000                               | 973                              | 0,01                      | 4,318 % éch. 25/03/2036                                            | 280                                 | 275                              | 0,00                      | 3,854 % éch. 15/04/2038                           | 8 300                               | 9 503                            | 0,06                      |
| 4,183 % éch. 25/10/2036                              | 54                                  | 54                               | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/01/2037                                            | 1 046                               | 1 022                            | 0,01                      | Carlyle Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| 4,213 % éch. 25/07/2036                              | 6 000                               | 5 529                            | 0,03                      | 4,453 % éch. 25/12/2035                                            | 3 688                               | 3 457                            | 0,02                      | 3,151 % éch. 15/03/2032                           | 490                                 | 560                              | 0,00                      |
| 4,423 % éch. 25/07/2036                              | 300                                 | 287                              | 0,00                      | 4,588 % éch. 25/06/2035                                            | 3 220                               | 2 506                            | 0,02                      | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC     |                                     |                                  |                           |
| 4,663 % éch. 25/01/2037                              | 7 553                               | 6 486                            | 0,04                      | Structured Asset Investment Loan Trust                             |                                     |                                  |                           | 3,188 % éch. 10/11/2035                           | 13 200                              | 15 102                           | 0,09                      |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | 4,313 % éch. 25/09/2034                                            | 2 131                               | 2 044                            | 0,01                      | CIFC European Funding CLO DAC                     |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/01/2036                              | 1 730                               | 1 569                            | 0,01                      | 4,383 % éch. 25/01/2036                                            | 327                                 | 308                              | 0,00                      | 3,188 % éch. 18/08/2035                           | 1 500                               | 1 716                            | 0,01                      |
| 4,543 % éch. 25/08/2035                              | 348                                 | 345                              | 0,00                      | 4,393 % éch. 25/11/2035                                            | 343                                 | 338                              | 0,00                      | 3,194 % éch. 23/11/2034                           | 2 000                               | 2 288                            | 0,01                      |
| 4,678 % éch. 25/08/2035                              | 3 600                               | 3 355                            | 0,02                      | 4,483 % éch. 25/04/2035                                            | 31                                  | 31                               | 0,00                      | CQS U.S. CLO Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,038 % éch. 25/02/2035                              | 767                                 | 757                              | 0,01                      | 4,483 % éch. 25/07/2035                                            | 2 284                               | 2 184                            | 0,01                      | 5,101 % éch. 17/01/2039                           | \$ 10 700                           | 10 714                           | 0,07                      |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                  |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |                                     |                                  |                           | Cumulus Static CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 4,183 % éch. 25/05/2037                              | 327                                 | 319                              | 0,00                      | 4,333 % éch. 25/10/2036                                            | 98                                  | 98                               | 0,00                      | 4,183 % éch. 15/11/2033                           | € 1 300                             | 1 492                            | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/10/2036                              | 6 699                               | 2 120                            | 0,01                      | 4,568 % éch. 25/02/2036                                            | 332                                 | 327                              | 0,00                      | CVC Cordatus Loan Fund DAC                        |                                     |                                  |                           |
| 4,213 % éch. 25/05/2037                              | 6 742                               | 5 604                            | 0,04                      | 4,768 % éch. 25/11/2035                                            | 240                                 | 240                              | 0,00                      | 3,066 % éch. 25/04/2036                           | 30 000                              | 34 321                           | 0,21                      |
| 4,588 % éch. 25/10/2034                              | 607                                 | 605                              | 0,00                      | 6,388 % éch. 25/11/2035                                            | 2 600                               | 2 585                            | 0,02                      | 3,130 % éch. 29/07/2034                           | 10 764                              | 12 305                           | 0,08                      |
| Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust     |                                     |                                  |                           | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                          |                                     |                                  |                           | 3,341 % éch. 15/12/2034                           | 20 000                              | 22 883                           | 0,14                      |
| 4,183 % éch. 25/06/2037                              | 3 623                               | 3 659                            | 0,02                      | 3,933 % éch. 25/07/2047                                            | 2 898                               | 1 697                            | 0,01                      | 3,528 % éch. 15/05/2037                           | 2 400                               | 2 751                            | 0,02                      |
| 4,263 % éch. 25/07/2037                              | 703                                 | 710                              | 0,01                      | 4,003 % éch. 25/05/2037                                            | 2 347                               | 2 125                            | 0,01                      | CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC            |                                     |                                  |                           |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust               |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/05/2037                                            | 606                                 | 549                              | 0,00                      | 3,823 % éch. 15/08/2033                           | 4 400                               | 5 042                            | 0,03                      |
| 4,303 % éch. 25/01/2037                              | 321                                 | 310                              | 0,00                      | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust                  |                                     |                                  |                           | DB Master Finance LLC                             |                                     |                                  |                           |
| 4,693 % éch. 25/07/2035                              | 512                                 | 514                              | 0,00                      | 4,073 % éch. 25/08/2036                                            | 373                                 | 350                              | 0,00                      | 2,791 % éch. 20/11/2051                           | \$ 4 584                            | 4 078                            | 0,03                      |
| 4,768 % éch. 25/06/2036                              | 1 851                               | 1 541                            | 0,01                      |                                                                    |                                     | 196 241                          | 1,20                      | Domino's Pizza Master Issuer LLC                  |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               |                                     |                                  |                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES                          |                                     |                                  |                           | 3,151 % éch. 25/04/2051                           | 4 863                               | 4 463                            | 0,03                      |
| 3,873 % éch. 25/03/2037                              | 1 223                               | 492                              | 0,00                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                  |                                     |                                  |                           | Dryden Euro CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |
| 3,893 % éch. 25/10/2036                              | 67                                  | 60                               | 0,00                      | 3,089 % éch. 25/01/2037                                            | 2 422                               | 654                              | 0,00                      | 3,154 % éch. 15/04/2035                           | € 4 250                             | 4 863                            | 0,03                      |
| 3,903 % éch. 25/10/2036                              | 964                                 | 417                              | 0,00                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                |                                     |                                  |                           | 3,704 % éch. 15/04/2034                           | 1 000                               | 1 146                            | 0,01                      |
| 4,063 % éch. 25/06/2036                              | 661                                 | 592                              | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/03/2047                                            | 995                                 | 676                              | 0,01                      | Fondo de Titulizacion Santander Consumo           |                                     |                                  |                           |
| 4,423 % éch. 25/11/2035                              | 1 693                               | 1 639                            | 0,01                      |                                                                    |                                     | 1 330                            | 0,01                      | 2,865 % éch. 25/10/2040                           | 6 600                               | 7 559                            | 0,05                      |
| 4,798 % éch. 25/07/2035                              | 924                                 | 905                              | 0,01                      | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS IMMOBILIERS PRÉFABRIQUÉS AUTRES        |                                     |                                  |                           | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                                  |                           |
| 5,013 % éch. 25/07/2037                              | 782                                 | 704                              | 0,01                      | Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust                     |                                     |                                  |                           | 2,918 % éch. 25/10/2035                           | 9 676                               | 11 072                           | 0,07                      |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | 7,170 % éch. 15/04/2040                                            | 725                                 | 695                              | 0,01                      | 3,158 % éch. 23/12/2036                           | 24 700                              | 28 279                           | 0,17                      |
| 6,077 % éch. 25/10/2046                              | 988                                 | 221                              | 0,00                      | AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                 |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                     |                                     |                                  |                           |
| New Century Home Equity Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | AlbaCore Euro CLO DAC                                              |                                     |                                  |                           | 3,136 % éch. 20/12/2044                           | 11 425                              | 13 097                           | 0,08                      |
| 4,498 % éch. 25/10/2035                              | 490                                 | 433                              | 0,00                      | 3,391 % éch. 15/12/2034                                            | € 16 800                            | 19 217                           | 0,12                      | Grosvenor Place CLO DAC                           |                                     |                                  |                           |
| 4,693 % éch. 25/11/2034                              | 976                                 | 976                              | 0,01                      | Arbour CLO DAC                                                     |                                     |                                  |                           | 3,383 % éch. 15/08/2039                           | 22 175                              | 25 378                           | 0,16                      |
| Nomura Home Equity Loan, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 15/08/2038                                            | 9 400                               | 10 763                           | 0,07                      | 4,208 % éch. 15/08/2039                           | 1 600                               | 1 844                            | 0,01                      |
| 4,043 % éch. 25/01/2037                              | 1 421                               | 1 473                            | 0,01                      | Ares European CLO DAC                                              |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 20/04/2032                                            | 174                                 | 199                              | 0,00                      | 3,054 % éch. 15/01/2032                           | 457                                 | 523                              | 0,00                      |
| 4,393 % éch. 25/02/2036                              | 996                                 | 907                              | 0,01                      | 3,512 % éch. 15/07/2037                                            | 29 700                              | 33 956                           | 0,21                      | 3,154 % éch. 21/10/2034                           | 11 300                              | 12 929                           | 0,08                      |
| Option One Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | Atlantic Avenue Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | 3,464 % éch. 15/10/2038                           | 8 400                               | 9 619                            | 0,06                      |
| 4,498 % éch. 25/05/2035                              | 194                                 | 189                              | 0,00                      | 5,053 % éch. 15/10/2038                                            | \$ 15 000                           | 15 050                           | 0,09                      | 3,523 % éch. 25/07/2037 (b)                       | 27 600                              | 31 555                           | 0,19                      |
| 4,633 % éch. 25/05/2035                              | 1 376                               | 1 222                            | 0,01                      |                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/07/2037 (b)                       | 8 800                               | 10 061                           | 0,06                      |
| 4,693 % éch. 25/08/2035                              | 2 620                               | 2 320                            | 0,02                      | Owinit Mortgage Loan Trust                                         |                                     |                                  |                           | Hayfin Emerald CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 3,372 % éch. 25/01/2037                              | 109                                 | 107                              | 0,00                      | 3,372 % éch. 25/01/2037                                            |                                     |                                  |                           | 3,454 % éch. 15/10/2038                           | 7 300                               | 8 353                            | 0,05                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           | Henley CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           | 3,115 % éch. 25/07/2034                           | 5 045                               | 5 774                            | 0,04                      |

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| ICG Euro CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | <b>PRETS HYPOTHECAIRES ENTIERS EN GARANTIE</b>      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain             |                                     |                                  |                           |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                     | € 15 400                            | \$ 17 625                        | 0,11                      | Bravo Mortgage Asset Trust                          |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 21/11/2030                                           | € 8 500                             | \$ 10 225                        | 0,06                      |
| Indigo Credit Management DAC                |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/07/2036                             | \$ 90                               | \$ 82                            | 0,00                      | 5,950 % éch. 27/04/2033                                           | 4 000                               | 4 879                            | 0,03                      |
| 3,464 % éch. 15/10/2037                     | 4 000                               | 4 578                            | 0,03                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                 |                                     |                                  |                           | Development Bank of Kazakhstan JSC                                |                                     |                                  |                           |
| Invesco Euro CLO DAC                        |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/01/2037                             | 440                                 | 435                              | 0,00                      | 18,400 % éch. 16/10/2028                                          | KZT 3 100 000                       | 6 752                            | 0,04                      |
| 3,454 % éch. 22/10/2036                     | 7 400                               | 8 470                            | 0,05                      | 4,198 % éch. 25/11/2036                             | 65                                  | 65                               | 0,00                      | Eagle Funding Luxco SARL                                          |                                     |                                  |                           |
| Madison Park Euro Funding DAC               |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/01/2036                             | 872                                 | 876                              | 0,01                      | 5,500 % éch. 17/08/2030                                           | \$ 34 490                           | 34 673                           | 0,21                      |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                     | 13 017                              | 14 901                           | 0,09                      | Curzon Mortgages PLC                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                |                                     |                                  |                           |
| 3,084 % éch. 15/07/2035                     | 6 593                               | 7 544                            | 0,05                      | 4,592 % éch. 28/07/2049                             | £ 20 000                            | 26 555                           | 0,16                      | 19,698 % éch. 14/10/2030                                          | EGP 516 600                         | 10 010                           | 0,06                      |
| Marzio Finance SRL                          |                                     |                                  |                           | First Franklin Mortgage Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                           |
| 2,801 % éch. 28/05/2049                     | 1 529                               | 1 755                            | 0,01                      | 3,883 % éch. 25/11/2036                             | \$ 419                              | 396                              | 0,00                      | 4,875 % éch. 30/04/2029                                           | \$ 3 600                            | 3 627                            | 0,02                      |
| MV Credit Euro CLO DAC                      |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/11/2035                             | 3 384                               | 3 320                            | 0,02                      | 5,000 % éch. 30/04/2034                                           | 3 700                               | 3 763                            | 0,02                      |
| 3,583 % éch. 15/02/2038                     | 9 000                               | 10 298                           | 0,06                      | 4,363 % éch. 25/01/2036                             | 756                                 | 695                              | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement israélien               |                                     |                                  |                           |
| Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |                                     |                                  |                           | 4,468 % éch. 25/11/2036                             | 1 181                               | 1 152                            | 0,01                      | 5,375 % éch. 19/02/2030                                           | 1 100                               | 1 116                            | 0,01                      |
| 3,085 % éch. 25/10/2034                     | 10 000                              | 11 427                           | 0,07                      | 4,483 % éch. 25/08/2034                             | 422                                 | 403                              | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement japonais                |                                     |                                  |                           |
| 3,414 % éch. 15/07/2039                     | 29 700                              | 33 998                           | 0,21                      | 4,513 % éch. 25/12/2035                             | 534                                 | 518                              | 0,00                      | 1,600 % éch. 20/03/2044                                           | ¥ 610 000                           | 2 822                            | 0,02                      |
| Palmer Square European Loan Funding DAC     |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/07/2035                             | 1 179                               | 1 172                            | 0,01                      | 2,400 % éch. 20/03/2055                                           | 729 000                             | 3 324                            | 0,02                      |
| 3,150 % éch. 15/10/2035                     | 18 400                              | 21 062                           | 0,13                      | 4,708 % éch. 25/06/2034                             | 389                                 | 387                              | 0,00                      | 3,200 % éch. 20/09/2055                                           | 702 000                             | 3 792                            | 0,02                      |
| 4,173 % éch. 15/05/2034                     | 1 700                               | 1 950                            | 0,01                      | GSAMP Trust                                         |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch. 20/12/2055                                           | 1 260 000                           | 7 076                            | 0,04                      |
| Penta CLO DAC                               |                                     |                                  |                           | 7,138 % éch. 25/06/2034                             | 876                                 | 762                              | 0,01                      | Magyar Export-Import Bank                                         |                                     |                                  |                           |
| 3,015 % éch. 25/07/2036                     | 9 000                               | 10 301                           | 0,06                      | Lehman XS Trust                                     |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 27/11/2031                                           | € 600                               | 706                              | 0,00                      |
| 3,135 % éch. 25/07/2034                     | 15 788                              | 18 065                           | 0,11                      | 3,933 % éch. 25/02/2037                             | 7 621                               | 6 717                            | 0,04                      | Obligation internationale du gouvernement mexicain                |                                     |                                  |                           |
| Planet Fitness Master Issuer LLC            |                                     |                                  |                           | Residential Asset Mortgage Products Trust           |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch.                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,274 % éch. 06/12/2055                     | \$ 1 995                            | 1 981                            | 0,01                      | 4,113 % éch. 25/10/2036                             | 307                                 | 302                              | 0,00                      | 24/08/2034 (g)                                                    | MXN 1 322                           | 73                               | 0,00                      |
| Plenti PL & Green ABS Trust                 |                                     |                                  |                           | 4,523 % éch. 25/03/2036                             | 891                                 | 884                              | 0,01                      | 4,625 % éch. 04/05/2033                                           | € 500                               | 584                              | 0,00                      |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                     | AUD 9 670                           | 6 692                            | 0,04                      | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust      |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 22/03/2031                                           | \$ 1 700                            | 1 660                            | 0,01                      |
| Providus CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/11/2036                             | 2 513                               | 644                              | 0,00                      | 5,625 % éch. 09/02/2034                                           | 6 350                               | 6 256                            | 0,04                      |
| 3,189 % éch. 20/05/2034                     | € 1 500                             | 1 717                            | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/09/2036                             | 2 939                               | 2 661                            | 0,02                      | 5,625 % éch. 22/09/2035                                           | 2 100                               | 2 044                            | 0,01                      |
| 3,415 % éch. 20/11/2038                     | 18 300                              | 20 933                           | 0,13                      | 4,103 % éch. 25/08/2036                             | 491                                 | 157                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 13/05/2030                                           | 200                                 | 205                              | 0,00                      |
| 3,513 % éch. 15/11/2039                     | 7 400                               | 8 470                            | 0,05                      | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust  |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 27/08/2037                                           | 4 700                               | 4 706                            | 0,03                      |
| 3,904 % éch. 15/07/2038                     | 5 000                               | 5 728                            | 0,04                      | 4,043 % éch. 25/09/2037                             | 4 335                               | 4 121                            | 0,03                      | 6,875 % éch. 13/05/2037                                           | 400                                 | 420                              | 0,00                      |
| 3,995 % éch. 20/11/2038                     | 16 700                              | 19 126                           | 0,12                      |                                                     |                                     | 52 304                           | 0,32                      | 7,375 % éch. 13/05/2055                                           | 200                                 | 212                              | 0,00                      |
| RIN LLC                                     |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 1 645 005                        | 10,09                     | 7,750 % éch. 29/05/2031                                           | MXN 62 900                          | 3 500                            | 0,02                      |
| 5,044 % éch. 20/07/2037 (b)                 | \$ 32 700                           | 32 700                           | 0,20                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 23/11/2034                                           | 45 000                              | 2 398                            | 0,02                      |
| Riserva CLO Ltd.                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement argentin  |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 01/03/2029                                           | 96 400                              | 5 600                            | 0,04                      |
| 4,725 % éch. 18/01/2034                     | 9 977                               | 9 981                            | 0,06                      | 7,050 % éch. 09/07/2030                             | 28 210                              | 24 759                           | 0,15                      | 8,500 % éch. 31/05/2029                                           | 89 600                              | 5 199                            | 0,03                      |
| Rockford Tower Europe CLO DAC               |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 09/07/2041                             | 10 200                              | 7 650                            | 0,05                      | Obligation internationale du gouvernement péruvien                |                                     |                                  |                           |
| 3,121 % éch. 24/01/2035                     | € 14 900                            | 17 039                           | 0,10                      | 4,125 % éch. 09/07/2035                             | 9 853                               | 7 873                            | 0,05                      | 1,862 % éch. 01/12/2032                                           | \$ 1 800                            | 1 496                            | 0,01                      |
| 3,489 % éch. 29/08/2036                     | 9 300                               | 10 645                           | 0,07                      | Balterek National Investment Holding JSC            |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 12/08/2034                                           | PEN 3 400                           | 974                              | 0,01                      |
| 3,504 % éch. 15/07/2038                     | 15 000                              | 17 172                           | 0,11                      | 16,950 % éch. 02/04/2029                            | KZT 2 318 000                       | 4 926                            | 0,03                      | 6,150 % éch. 12/08/2032                                           | 37 300                              | 11 848                           | 0,07                      |
| SC Germany S.A., Compartment Consumer       |                                     |                                  |                           | 16,950 % éch. 02/04/2031                            | 1 868 000                           | 4 022                            | 0,03                      | 6,850 % éch. 12/08/2035                                           | 143 300                             | 44 230                           | 0,27                      |
| 2,859 % éch. 14/12/2038                     | 7 078                               | 8 117                            | 0,05                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien |                                     |                                  |                           | 7,300 % éch. 12/08/2033                                           | 37 980                              | 12 478                           | 0,08                      |
| Sculptor European CLO DAC                   |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 23/04/2036                             | € 9 600                             | 11 107                           | 0,07                      | 7,600 % éch. 12/08/2039                                           | 1 900                               | 599                              | 0,00                      |
| 3,054 % éch. 15/04/2034                     | 1 001                               | 1 145                            | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement bulgare   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement qatari                  |                                     |                                  |                           |
| 3,082 % éch. 10/10/2034                     | 13 500                              | 15 445                           | 0,09                      | 4,125 % éch. 07/05/2038                             | 1 100                               | 1 262                            | 0,01                      | 4,800 % éch. 08/04/2033                                           | \$ 6 900                            | 6 937                            | 0,04                      |
| 3,254 % éch. 15/10/2034                     | 997                                 | 1 142                            | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement chilien   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain                 |                                     |                                  |                           |
| SLM Student Loan Trust                      |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 14/01/2032                             | 600                                 | 695                              | 0,01                      | 5,250 % éch. 10/03/2030                                           | € 1 000                             | 1 188                            | 0,01                      |
| 2,565 % éch. 25/10/2039                     | 1 732                               | 1 853                            | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement colombien |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 30/05/2032                                           | 1 700                               | 1 984                            | 0,01                      |
| 2,715 % éch. 25/07/2039                     | 772                                 | 836                              | 0,01                      | 5,375 % éch. 21/01/2029                             | \$ 13 800                           | 13 775                           | 0,09                      | 5,375 % éch. 07/06/2033                                           | 11 100                              | 12 822                           | 0,08                      |
| Sound Point CLO Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 19/02/2036                             | € 3 400                             | 3 866                            | 0,02                      | 5,625 % éch. 30/05/2037                                           | 1 400                               | 1 579                            | 0,01                      |
| 5,087 % éch. 18/04/2031                     | \$ 149                              | 149                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 26/11/2034                             | 4 100                               | 4 775                            | 0,03                      | 6,250 % éch. 10/09/2034                                           | 9 000                               | 10 874                           | 0,07                      |
| Sound Point Euro CLO Funding DAC            |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 21/01/2031                             | \$ 1 400                            | 1 415                            | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien                |                                     |                                  |                           |
| 2,985 % éch. 25/05/2034                     | € 3 498                             | 3 997                            | 0,02                      | 6,500 % éch. 21/01/2033                             | 1 300                               | 1 322                            | 0,01                      | 3,375 % éch. 05/03/2032                                           | 400                                 | 452                              | 0,00                      |
| Taco Bell Funding LLC                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 26/11/2038                             | € 2 900                             | 3 491                            | 0,02                      | 3,750 % éch. 05/03/2037                                           | 500                                 | 561                              | 0,00                      |
| 1,946 % éch. 25/08/2051                     | \$ 4 323                            | 4 247                            | 0,03                      | TES colombien                                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain            |                                     |                                  |                           |
| 2,542 % éch. 25/08/2051                     | 5 620                               | 4 923                            | 0,03                      | 9,250 % éch. 28/05/2042                             | COP 6 433 000                       | 1 519                            | 0,01                      | 7,000 % éch. 28/02/2031                                           | ZAR 204 200                         | 12 034                           | 0,07                      |
| Tikehau CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 22/08/2029                            | 15 155 600                          | 4 266                            | 0,03                      | 8,000 % éch. 31/01/2030                                           | 5 000                               | 308                              | 0,00                      |
| 3,483 % éch. 20/04/2038                     | € 16 900                            | 19 350                           | 0,12                      | 11,500 % éch. 25/07/2046                            | 7 007 000                           | 1 972                            | 0,01                      | 8,500 % éch. 31/01/2037                                           | 1 097 200                           | 66 690                           | 0,41                      |
| 4,098 % éch. 20/04/2038                     | 4 100                               | 4 696                            | 0,03                      | 11,750 % éch. 24/01/2035                            | 172 586 600                         | 49 166                           | 0,30                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                           | 230 340                             | 14 564                           | 0,09                      |
| Tikehau U.S. CLO Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 28/11/2040                            | 35 315 400                          | 10 686                           | 0,07                      | 9,000 % éch. 31/01/2040                                           | 2 700                               | 167                              | 0,00                      |
| 4,767 % éch. 18/01/2035                     | \$ 29 800                           | 29 814                           | 0,18                      | 13,250 % éch. 09/02/2033                            | 55 739 600                          | 17 059                           | 0,11                      | Obligation internationale du gouvernement espagnol                |                                     |                                  |                           |
| Toro European CLO DAC                       |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 0,700 % éch. 30/04/2032                                           | € 5 000                             | 5 054                            | 0,03                      |
| 3,070 % éch. 12/01/2032                     | € 155                               | 177                              | 0,00                      |                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement turc                    |                                     |                                  |                           |
| 3,194 % éch. 15/07/2034                     | 11 986                              | 13 717                           | 0,08                      |                                                     |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 13/03/2030                                           | \$ 16 900                           | 16 423                           | 0,10                      |
| 3,474 % éch. 15/04/2037                     | 17 800                              | 20 375                           | 0,12                      |                                                     |                                     |                                  |                           | 40,305 % éch. 06/09/2028                                          | TRY 1 400                           | 30                               | 0,00                      |
| Trinitas CLO Ltd.                           |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 19/08/2026                                          | 100                                 | 2                                | 0,00                      |
| 4,777 % éch. 25/01/2034                     | \$ 8 036                            | 8 043                            | 0,05                      |                                                     |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 17/05/2028                                          | 29 700                              | 643                              | 0,00                      |
| Whetstone Park CLO Ltd.                     |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,745 % éch. 20/01/2035                     | 10 500                              | 10 507                           | 0,06                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Wingstop Funding LLC                        |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,841 % éch. 05/12/2050                     | 6 427                               | 6 247                            | 0,04                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                             |                                     | 983 389                          | 6,03                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |



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

|                                                          | ACTIONS    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                          | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                     | ACTIONS    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------|------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|------------|----------------------------------|---------------------------|
| ACTIONS ORDINAIRES                                       |            |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |                                                     |            |                                  |                           |
| SERVICES DE COMMUNICATION                                |            |                                  |                           | Hennes & Mauritz AB « B » (d)            | 359 957   | \$ 6 204                         | 0,04                      | Marathon Petroleum Corp.                            | 266 850    | \$68 226                         | 0,42                      |
| Advanced Info Service PCL                                | 812 300    | \$ 8 999                         | 0,05                      | Hero MotoCorp Ltd. (d)                   | 108 866   | 5 526                            | 0,03                      | Oil & Natural Gas Corp. Ltd. (d)                    | 2 038 167  | 5 054                            | 0,03                      |
| Airtel Africa PLC                                        | 215 372    | 937                              | 0,01                      | Isuzu Motors Ltd. (d)                    | 290 600   | 3 871                            | 0,02                      | ORLEN S.A.                                          | 523 371    | 17 611                           | 0,11                      |
| Alphabet, Inc. « A »                                     | 151 524    | 54 150                           | 0,33                      | Kingfisher PLC                           | 1 075 569 | 4 041                            | 0,03                      | Petroleo Brasileiro S.A.                            | 3 401 200  | 27 454                           | 0,17                      |
| Alphabet, Inc. « C »                                     | 100 711    | 35 584                           | 0,22                      | Li Ning Co. Ltd.                         | 1 722 500 | 3 248                            | 0,02                      | PTT Exploration & Production PCL                    | 1 037 600  | 4 170                            | 0,02                      |
| America Movil S.A.B.<br>de C.V. « B » (d)                | 6 237 800  | 8 086                            | 0,05                      | LPP S.A. (d)                             | 231       | 1 125                            | 0,01                      | Shaanxi Coal Industry Co. Ltd. « A »                | 429 700    | 1 288                            | 0,01                      |
| AT&T, Inc. (d)                                           | 4 518 644  | 93 536                           | 0,57                      | Lululemon Athletica, Inc. (d)            | 48 175    | 5 501                            | 0,03                      | Suncor Energy, Inc.                                 | 11 659     | 627                              | 0,00                      |
| China United Network<br>Communications Ltd. « A »        | 602 400    | 356                              | 0,00                      | Magna International, Inc.                | 236 368   | 15 537                           | 0,10                      | Tenaris S.A.                                        | 281 276    | 7 791                            | 0,05                      |
| Comcast Corp. « A » (d)                                  | 546 008    | 13 405                           | 0,08                      | Midea Group Co. Ltd. « A »               | 143 700   | 1 602                            | 0,01                      | Turkiye Petrol Rafinerileri A/S (d)                 | 748 394    | 3 637                            | 0,02                      |
| Elisa Oyj (d)                                            | 53 940     | 2 265                            | 0,01                      | Midea Group Co. Ltd. « H »               | 349 400   | 3 692                            | 0,02                      | Ultrapar Participacoes S.A.                         | 521 500    | 2 626                            | 0,02                      |
| Emirates Telecommunications<br>Group Co. PJSC            | 226 778    | 1 186                            | 0,01                      | Next PLC (d)                             | 85 600    | 16 526                           | 0,10                      | United Tractors Tbk PT                              | 274 000    | 353                              | 0,00                      |
| Focus Media Information<br>Technology Co. Ltd. « A » (d) | 278 100    | 199                              | 0,00                      | NVR, Inc. (d)                            | 1 281     | 8 728                            | 0,05                      | Valero Energy Corp.                                 | 185 494    | 48 310                           | 0,30                      |
| Fox Corp. « A »                                          | 175 714    | 9 165                            | 0,06                      | O'Reilly Automotive, Inc. (d)            | 240 646   | 22 161                           | 0,14                      | Var Energi ASA                                      | 818 031    | 3 390                            | 0,02                      |
| Fox Corp. « B »                                          | 111 328    | 5 215                            | 0,03                      | Ross Stores, Inc.                        | 284 793   | 60 618                           | 0,37                      |                                                     | 347 368    | 2,13                             |                           |
| Hellenic Telecommunications<br>Organization S.A. (d)     | 45 897     | 1 020                            | 0,01                      | Sony Group Corp. (d)                     | 1 410 100 | 28 389                           | 0,17                      | SERVICES FINANCIERS                                 |            |                                  |                           |
| International Games System Co.<br>Ltd. « C » (d)         | 63 000     | 1 569                            | 0,01                      | Suzuki Motor Corp. (d)                   | 408 600   | 4 944                            | 0,03                      | Aflac, Inc.                                         | 63 916     | 7 494                            | 0,05                      |
| Meta Platforms, Inc. « A »                               | 299 374    | 168 634                          | 1,03                      | Techtronic Industries Co. Ltd.           | 1 244 500 | 20 713                           | 0,13                      | AIB Group PLC                                       | 1 072 010  | 12 607                           | 0,08                      |
| NetEase, Inc.                                            | 1 210 300  | 31 086                           | 0,19                      | TJX Cos., Inc. (d)                       | 958 913   | 145 275                          | 0,89                      | Allstate Corp.                                      | 231 663    | 55 122                           | 0,34                      |
| Ooredoo QPSC                                             | 332 272    | 1 209                            | 0,01                      | Tongcheng Travel Holdings Ltd.           | 512 400   | 784                              | 0,00                      | Ameriprise Financial, Inc.                          | 82 914     | 38 038                           | 0,23                      |
| PLDT, Inc.                                               | 5 895      | 108                              | 0,00                      | Ultra Beauty, Inc. (d)                   | 38 850    | 17 521                           | 0,11                      | Amundi S.A.                                         | 30 993     | 2 977                            | 0,02                      |
| T-Mobile U.S., Inc. (d)                                  | 185 947    | 31 189                           | 0,19                      | Vibra Energia S.A.                       | 968 300   | 5 592                            | 0,03                      | Arch Capital Group Ltd. (d)                         | 317 584    | 30 825                           | 0,19                      |
| Telefonica Brasil S.A.                                   | 485 600    | 3 185                            | 0,02                      | Yadea Group Holdings Ltd.                | 306 000   | 348                              | 0,00                      | Banca Mediolanum SpA                                | 152 957    | 3 814                            | 0,02                      |
| Telefonica S.A. (d)                                      | 1 052 772  | 4 234                            | 0,03                      | Yamaha Motor Co. Ltd. (d)                | 720 000   | 5 469                            | 0,03                      | Banco Bilbao Vizcaya<br>Argentaria S.A.             | 2 856 604  | 71 964                           | 0,44                      |
| Telkom Indonesia Persero Tbk PT                          | 26 418 900 | 3 509                            | 0,02                      | BIENS DE CONSOMMATION COURANTE           |           |                                  |                           | Banco BPM SpA                                       | 514 694    | 8 906                            | 0,05                      |
| TIM S.A.                                                 | 633 700    | 2 678                            | 0,02                      | Altria Group, Inc.                       | 1 515 845 | 109 065                          | 0,67                      | Banco de Chile                                      | 28 822 068 | 5 642                            | 0,03                      |
| Vodacom Group Ltd.                                       | 498 838    | 4 619                            | 0,03                      | Ambev S.A.                               | 1 632 500 | 5 138                            | 0,03                      | Bank Hapoalim B.M.                                  | 1 176 565  | 27 105                           | 0,17                      |
| Vodafone Group PLC                                       | 14 227 331 | 18 842                           | 0,12                      | Archer-Daniels-Midland Co.               | 146 908   | 11 224                           | 0,07                      | Bank Leumi Le-Israel B.M.                           | 1 152 667  | 25 764                           | 0,16                      |
|                                                          |            | 504 965                          | 3,10                      | Carrefour S.A.                           | 46 434    | 863                              | 0,01                      | Bank Mandiri Persero Tbk PT                         | 32 482 400 | 7 006                            | 0,04                      |
| BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE                    |            |                                  |                           | Colgate-Palmolive Co. (d)                | 113 088   | 10 368                           | 0,06                      | Bank of Communications Co.<br>Ltd. « H » (d)        | 1 633 000  | 1 405                            | 0,01                      |
| Abu Dhabi National Oil Co. for<br>Distribution PJSC      | 1 186 141  | 1 266                            | 0,01                      | Costco Wholesale Corp.                   | 61 170    | 57 223                           | 0,35                      | Bank of New York Mellon Corp.                       | 529 967    | 76 639                           | 0,47                      |
| Airbnb, Inc. « A » (d)                                   | 383 810    | 54 923                           | 0,34                      | Dollar General Corp. (d)                 | 195 622   | 22 518                           | 0,14                      | Bank Rakyat Indonesia Persero<br>Tbk PT             | 52 746 400 | 8 076                            | 0,05                      |
| Aisin Corp. (d)                                          | 239 300    | 3 250                            | 0,02                      | Empire Co. Ltd. « A » (d)                | 21 347    | 747                              | 0,00                      | BB Seguridade<br>Participacoes S.A.                 | 566 400    | 4 286                            | 0,03                      |
| Allwyn AG                                                | 114 412    | 1 824                            | 0,01                      | George Weston Ltd.                       | 59 707    | 4 284                            | 0,02                      | Canara Bank                                         | 863 638    | 1 147                            | 0,01                      |
| Amazon.com, Inc. (d)                                     | 605 312    | 144 270                          | 0,89                      | Imperial Brands PLC (d)                  | 651 825   | 24 105                           | 0,15                      | Charles Schwab Corp.                                | 1 238 945  | 114 317                          | 0,70                      |
| Avolta AG                                                | 38 880     | 2 602                            | 0,02                      | Jeronimo Martins SGPS S.A.               | 243 281   | 4 662                            | 0,03                      | China Construction Bank Corp.<br>« A » (d)          | 589 200    | 836                              | 0,01                      |
| Booking Holdings, Inc.                                   | 552 787    | 98 529                           | 0,60                      | Koninklijke Ahold Delhaize NV            | 797 045   | 32 095                           | 0,20                      | China Construction Bank Corp.<br>« H » (d)          | 53 090 000 | 54 765                           | 0,33                      |
| Bosideng International Holdings<br>Ltd. (d)              | 2 652 000  | 1 451                            | 0,01                      | Kroger Co. (d)                           | 60 419    | 3 355                            | 0,02                      | China Merchants Bank Co. Ltd.<br>« A » (d)          | 900 300    | 4 714                            | 0,03                      |
| Bridgestone Corp. (d)                                    | 934 400    | 19 711                           | 0,12                      | Procter & Gamble Co.                     | 4 515     | 662                              | 0,00                      | China Merchants Bank Co. Ltd.<br>« H » (d)          | 1 349 000  | 7 746                            | 0,05                      |
| Cie Générale des Établissements<br>Michelin S.C.A.       | 557 797    | 21 561                           | 0,13                      | Target Corp. (d)                         | 410 343   | 53 595                           | 0,33                      | China Pacific Insurance Group<br>Co. Ltd. « A » (d) | 253 900    | 1 071                            | 0,01                      |
| Continental AG                                           | 96 211     | 7 966                            | 0,05                      | Tingyi Cayman Islands<br>Holding Corp.   | 1 304 000 | 1 626                            | 0,01                      | China Pacific Insurance Group<br>Co. Ltd. « H »     | 1 008 800  | 3 470                            | 0,02                      |
| Deckers Outdoor Corp. (d)                                | 122 869    | 12 200                           | 0,08                      | Wal-Mart de Mexico S.A.B. de<br>C.V. (d) | 4 301 900 | 12 647                           | 0,08                      | CITIC Securities Co. Ltd. « A »                     | 515 500    | 2 189                            | 0,01                      |
| Dollar Tree, Inc. (d)                                    | 118 775    | 14 366                           | 0,09                      | Want Want China<br>Holdings Ltd. (d)     | 762 000   | 329                              | 0,00                      | CITIC Securities Co. Ltd. « H »                     | 1 338 000  | 4 671                            | 0,03                      |
| eBay, Inc.                                               | 269 544    | 30 122                           | 0,18                      | ÉNERGIE                                  |           |                                  |                           | CME Group, Inc.                                     | 78 679     | 17 375                           | 0,11                      |
| Expedia Group, Inc.                                      | 79 600     | 20 368                           | 0,13                      | Adnoc Drilling Co PJSC                   | 525 329   | 820                              | 0,01                      | Credicorp Ltd.                                      | 61 433     | 23 933                           | 0,15                      |
| Fuyao Glass Industry Group Co.<br>Ltd. « A »             | 25 300     | 189                              | 0,00                      | Adnoc Gas PLC                            | 1 607 042 | 1 506                            | 0,01                      | Erste Bank Polska S.A.                              | 5 339      | 917                              | 0,01                      |
| Fuyao Glass Industry Group Co.<br>Ltd. « H »             | 443 200    | 2 898                            | 0,02                      | Aker BP ASA                              | 23 144    | 706                              | 0,00                      | Fairfax Financial Holdings Ltd.                     | 16 305     | 26 809                           | 0,16                      |
| Garmin Ltd. (d)                                          | 91 641     | 21 768                           | 0,13                      | Bharat Petroleum Corp. Ltd.              | 1 038 576 | 3 341                            | 0,02                      | Goldman Sachs Group, Inc.                           | 23 941     | 24 213                           | 0,15                      |
| Geely Automobile Holdings Ltd.                           | 4 583 000  | 9 853                            | 0,06                      | China Coal Energy Co.<br>Ltd. « H » (d)  | 1 343 000 | 1 687                            | 0,01                      | Hartford Insurance Group, Inc.                      | 251 442    | 33 321                           | 0,20                      |
| General Motors Co.                                       | 364 514    | 28 097                           | 0,17                      | China Oilfield Services<br>Ltd. « H »    | 1 160 000 | 922                              | 0,01                      | IGM Financial, Inc.                                 | 60 090     | 3 354                            | 0,02                      |
| Great Wall Motor Co. Ltd. « H »<br>(d)                   | 1 128 000  | 1 267                            | 0,01                      | Coal India Ltd. (d)                      | 1 258 055 | 5 844                            | 0,04                      | Intesa Sanpaolo SpA                                 | 41 488     | 285                              | 0,00                      |
|                                                          |            |                                  |                           | ConocoPhillips Co.                       | 61 890    | 6 434                            | 0,04                      | Israel Discount Bank Ltd. « A »                     | 1 045 281  | 10 337                           | 0,06                      |
|                                                          |            |                                  |                           | ENEOS Holdings, Inc. (d)                 | 878 000   | 6 502                            | 0,04                      |                                                     |            |                                  |                           |
|                                                          |            |                                  |                           | EOG Resources, Inc. (d)                  | 480 606   | 62 349                           | 0,38                      |                                                     |            |                                  |                           |
|                                                          |            |                                  |                           | Equinor ASA (d)                          | 631 470   | 19 918                           | 0,12                      |                                                     |            |                                  |                           |
|                                                          |            |                                  |                           | Expand Energy Corp.                      | 217 831   | 19 864                           | 0,12                      |                                                     |            |                                  |                           |
|                                                          |            |                                  |                           | Halliburton Co.                          | 740 942   | 25 155                           | 0,15                      |                                                     |            |                                  |                           |
|                                                          |            |                                  |                           | Indian Oil Corp. Ltd. (d)                | 1 207 257 | 1 783                            | 0,01                      |                                                     |            |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                     | ACTIONS    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | ACTIONS     | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------|------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|
| JPMorgan Chase & Co. (d)                        | 101 360    | \$ 33 178                        | 0,20                      | Otsuka Holdings Co. Ltd. (d)                       | 187 100     | \$12 459                         | 0,08                      | Metso Oyj (d)                                  | 483 995   | \$ 8 421                         | 0,05                      |
| Mastercard, Inc. « A » (d)                      | 43 612     | 22 399                           | 0,14                      | Regeneron Pharmaceuticals, Inc.                    | 94 149      | 58 706                           | 0,36                      | Mitsubishi Heavy Industries Ltd. (d)           | 2 905 200 | 66 042                           | 0,40                      |
| Meritz Financial Group, Inc.                    | 11 766     | 808                              | 0,00                      | Roche Holding AG                                   | 143 824     | 59 264                           | 0,36                      | NARI Technology Co. Ltd. « A »                 | 258 500   | 873                              | 0,01                      |
| Metropolitan Bank & Trust Co.                   | 232 670    | 247                              | 0,00                      | Sanofi S.A.                                        | 599 553     | 51 295                           | 0,31                      | Nidec Corp.                                    | 43 300    | 712                              | 0,00                      |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd.                       | 114 450    | 7 571                            | 0,05                      | UCB S.A.                                           | 6 981       | 2 091                            | 0,01                      | Ningbo Deye Technology Co. Ltd. « A »          | 52 220    | 819                              | 0,01                      |
| Morgan Stanley                                  | 399 703    | 83 554                           | 0,51                      | United Therapeutics Corp. (d)                      | 35 038      | 18 985                           | 0,12                      | Nippon Yusen KK (d)                            | 340 000   | 11 002                           | 0,07                      |
| Muthoot Finance Ltd.                            | 79 773     | 2 533                            | 0,01                      |                                                    |             |                                  |                           | Nordson Corp.                                  | 40 999    | 12 369                           | 0,08                      |
| NatWest Group PLC                               | 5 160 518  | 45 564                           | 0,28                      |                                                    |             | 978 225                          | 6,00                      | Obayashi Corp. (d)                             | 135 600   | 2 741                            | 0,02                      |
| New China Life Insurance Co. Ltd. « A » (d)     | 47 700     | 421                              | 0,00                      | <b>INDUSTRIE</b>                                   |             |                                  |                           | Orient Overseas International Ltd.             | 71 000    | 1 107                            | 0,01                      |
| New China Life Insurance Co. Ltd. « H » (d)     | 722 900    | 4 261                            | 0,03                      | ABB Ltd.                                           | 586 091     | 63 861                           | 0,39                      | Otis Worldwide Corp.                           | 345 292   | 24 723                           | 0,15                      |
| Northern Trust Corp.                            | 159 292    | 27 691                           | 0,17                      | ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.   | 144 111     | 21 206                           | 0,13                      | PACCAR, Inc.                                   | 51 283    | 6 160                            | 0,04                      |
| Postal Savings Bank of China Co. Ltd. « H » (d) | 2 462 000  | 1 438                            | 0,01                      | AerCap Holdings NV                                 | 143 137     | 20 867                           | 0,13                      | Rockwell Automation, Inc. (d)                  | 87 492    | 43 316                           | 0,27                      |
| Poste Italiane SpA                              | 29 325     | 960                              | 0,01                      | AGC, Inc. (d)                                      | 148 000     | 6 398                            | 0,04                      | Sany Heavy Industry Co. Ltd. « A » (d)         | 235 700   | 602                              | 0,00                      |
| Power Finance Corp. Ltd. (d)                    | 1 030 403  | 4 627                            | 0,03                      | AP Moller - Maersk A/S « A »                       | 384         | 887                              | 0,01                      | Schindler Holding AG                           | 35 240    | 11 702                           | 0,07                      |
| Progressive Corp. (d)                           | 442 270    | 96 614                           | 0,59                      | Astra International Tbk PT                         | 12 002 300  | 3 034                            | 0,02                      | Seibu Holdings, Inc. (d)                       | 144 400   | 2 830                            | 0,02                      |
| Punjab National Bank                            | 777 834    | 878                              | 0,01                      | BAE Systems PLC                                    | 188 665     | 4 626                            | 0,03                      | SF Holding Co. Ltd. « A »                      | 196 900   | 909                              | 0,01                      |
| Raymond James Financial, Inc. (d)               | 72 434     | 11 012                           | 0,07                      | BOC Aviation Ltd.                                  | 57 800      | 601                              | 0,00                      | Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. « A »    | 19 800    | 194                              | 0,00                      |
| REC Ltd. (d)                                    | 679 395    | 2 615                            | 0,02                      | Bouygues S.A.                                      | 85 246      | 4 763                            | 0,03                      | Siemens AG                                     | 11 956    | 3 846                            | 0,02                      |
| SBI Holdings, Inc.                              | 364 800    | 5 985                            | 0,04                      | Brambles Ltd.                                      | 208 853     | 2 822                            | 0,02                      | Siemens Energy India Ltd.                      | 45 498    | 1 774                            | 0,01                      |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. (d)            | 50 753     | 3 182                            | 0,02                      | Broadridge Financial Solutions, Inc.               | 51 359      | 7 034                            | 0,04                      | SITC International Holdings Co. Ltd.           | 1 049 000 | 4 209                            | 0,03                      |
| Singapore Exchange Ltd.                         | 97 100     | 1 812                            | 0,01                      | Bureau Veritas S.A.                                | 104 301     | 3 197                            | 0,02                      | SKF AB « B » (d)                               | 38 688    | 996                              | 0,01                      |
| State Street Corp. (d)                          | 233 551    | 39 610                           | 0,24                      | Caterpillar, Inc. (d)                              | 35 400      | 37 697                           | 0,23                      | SMC Corp. (d)                                  | 45 400    | 20 306                           | 0,12                      |
| StoneCo Ltd. « A »                              | 144 367    | 1 565                            | 0,01                      | CITIC Ltd.                                         | 886 000     | 1 203                            | 0,01                      | Sungrow Power Supply Co. Ltd. « A »            | 80 800    | 1 896                            | 0,01                      |
| Swiss Re AG                                     | 78 642     | 12 521                           | 0,08                      | Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. « A »     | 225 100     | 13 085                           | 0,08                      | Taisei Corp. (d)                               | 13 800    | 1 222                            | 0,01                      |
| Synchrony Financial                             | 308 762    | 23 481                           | 0,14                      | Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. « H »     | 148 600     | 13 387                           | 0,08                      | Tata Motors Ltd.                               | 1 652 815 | 7 411                            | 0,04                      |
| T. Rowe Price Group, Inc.                       | 197 178    | 22 417                           | 0,14                      | Copart, Inc. (d)                                   | 9 559       | 270                              | 0,00                      | Thales S.A.                                    | 72 306    | 18 594                           | 0,11                      |
| TMBThanachart Bank PCL                          | 12 210 800 | 907                              | 0,01                      | COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. « A »             | 530 500     | 1 038                            | 0,01                      | Trane Technologies PLC (d)                     | 11 434    | 5 616                            | 0,03                      |
| Travelers Cos., Inc.                            | 192 682    | 63 608                           | 0,39                      | COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. « H »             | 1 713 000   | 2 846                            | 0,02                      | United Rentals, Inc.                           | 8 394     | 9 510                            | 0,06                      |
| Turkiye Is Bankasi A.S. « C »                   | 6 797 237  | 2 162                            | 0,01                      | CRRC Corp. Ltd. « A » (d)                          | 336 100     | 258                              | 0,00                      | Veralto Corp.                                  | 222 135   | 19 699                           | 0,12                      |
| Union Bank of India Ltd. (d)                    | 1 044 215  | 1 906                            | 0,01                      | CRRC Corp. Ltd. « H »                              | 1 882 000   | 1 080                            | 0,01                      | Vestas Wind Systems A/S                        | 844 429   | 23 922                           | 0,15                      |
| Washington H Soul Pattinson & Co. Ltd.          | 25 044     | 801                              | 0,00                      | Cummins India Ltd. (d)                             | 64 220      | 3 847                            | 0,02                      | Vinci S.A.                                     | 232 046   | 33 911                           | 0,21                      |
| Wells Fargo & Co.                               | 386 298    | 31 924                           | 0,19                      | Cummins, Inc.                                      | 119 028     | 84 892                           | 0,52                      | Wartsila Oyj Abp (d)                           | 437 708   | 16 727                           | 0,10                      |
| XP, Inc. « A »                                  | 359 653    | 5 848                            | 0,04                      | Curtiss-Wright Corp.                               | 25 041      | 18 975                           | 0,12                      | WEG S.A.                                       | 434 000   | 3 933                            | 0,02                      |
| Yapi ve Kredi Bankasi A/S                       | 2 158 026  | 1 863                            | 0,01                      | Deutsche Post AG                                   | 36 150      | 2 199                            | 0,01                      | Weichai Power Co. Ltd. « A » (d)               | 234 100   | 949                              | 0,01                      |
|                                                 |            | 1 289 103                        | 7,91                      | Eiffage S.A.                                       | 60 045      | 8 862                            | 0,05                      | Weichai Power Co. Ltd. « H » (d)               | 1 701 000 | 7 462                            | 0,05                      |
|                                                 |            |                                  |                           | Eva Airways Corp. (d)                              | 2 063 000   | 2 926                            | 0,02                      | XCMG Construction Machinery Co. Ltd. « A » (d) | 548 000   | 656                              | 0,00                      |
| <b>SOINS DE SANTÉ</b>                           |            |                                  |                           | Expeditors International of Washington, Inc.       | 120 500     | 19 639                           | 0,12                      | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.         | 1 490 200 | 3 954                            | 0,02                      |
| 3SBio, Inc. (d)                                 | 437 500    | 948                              | 0,01                      | Fortive Corp.                                      | 258 280     | 15 778                           | 0,10                      | ZTO Express Cayman, Inc. (I)                   | 322 200   | 7 131                            | 0,04                      |
| AbbVie, Inc. (d)                                | 639 152    | 160 836                          | 0,99                      | GEA Group AG                                       | 106 616     | 7 325                            | 0,04                      |                                                |           | 1 002 220                        | 6,15                      |
| Amgen, Inc.                                     | 447 562    | 162 071                          | 0,99                      | General Dynamics Corp. (d)                         | 208 607     | 73 897                           | 0,45                      | <b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>           |           |                                  |                           |
| Astellas Pharma, Inc. (d)                       | 1 542 700  | 20 645                           | 0,13                      | Graco, Inc. (d)                                    | 146 979     | 11 113                           | 0,07                      | Accenture PLC « A » (d)                        | 225 475   | 28 058                           | 0,17                      |
| AstraZeneca PLC                                 | 335 506    | 62 678                           | 0,38                      | Hitachi Ltd. (d)                                   | 3 167 400   | 87 699                           | 0,54                      | Adobe, Inc. (d)                                | 366 255   | 75 090                           | 0,46                      |
| Bristol-Myers Squibb Co. (d)                    | 1 866 685  | 107 558                          | 0,66                      | Hochtief AG                                        | 6 401       | 3 713                            | 0,02                      | Advantech Co. Ltd. (d)                         | 302 000   | 4 711                            | 0,03                      |
| CSPC Pharmaceutical Group Ltd.                  | 6 100 000  | 5 449                            | 0,03                      | Hyundai Rotem Co. Ltd.                             | 26 742      | 3 014                            | 0,02                      | Analog Devices, Inc.                           | 134 275   | 53 330                           | 0,33                      |
| Gilead Sciences, Inc.                           | 910 058    | 114 977                          | 0,70                      | ITOCHU Corp. (d)                                   | 375 600     | 4 288                            | 0,03                      | Apple, Inc.                                    | 1 046 674 | 302 866                          | 1,86                      |
| GSK PLC                                         | 1 400 231  | 36 782                           | 0,23                      | JB Hunt Transport Services, Inc.                   | 5 750       | 1 664                            | 0,01                      | Applied Materials, Inc. (d)                    | 181 040   | 130 892                          | 0,80                      |
| Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. (d)        | 1 088 000  | 4 123                            | 0,03                      | JD Logistics, Inc. (d)                             | 1 117 600   | 1 682                            | 0,01                      | Arista Networks, Inc. (d)                      | 130 092   | 22 100                           | 0,14                      |
| Incyte Corp. (d)                                | 24 140     | 2 736                            | 0,02                      | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. (d)                     | 307 800     | 4 720                            | 0,03                      | Asia Vital Components Co. Ltd. (d)             | 168 000   | 13 590                           | 0,08                      |
| Innovent Biologics, Inc. (d)                    | 90 500     | 922                              | 0,01                      | Knorr-Bremse AG                                    | 54 862      | 6 388                            | 0,04                      | ASML Holding NV                                | 95 178    | 188 585                          | 1,16                      |
| Ipsen S.A.                                      | 30 407     | 5 864                            | 0,04                      | Kone Oyj « B »                                     | 298 000     | 16 962                           | 0,10                      | Autodesk, Inc. (d)                             | 59 658    | 11 599                           | 0,07                      |
| Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co. Ltd. « A »  | 316 100    | 2 432                            | 0,01                      | Kongsberg Gruppen ASA                              | 97 343      | 2 934                            | 0,02                      | BOE Technology Group Co. Ltd. « A »            | 1 904 700 | 2 450                            | 0,01                      |
| Kyowa Kirin Co. Ltd. (d)                        | 212 300    | 3 380                            | 0,02                      | Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd. | 35 140      | 8 020                            | 0,05                      | Broadcom, Inc.                                 | 200 676   | 75 805                           | 0,46                      |
| Novartis AG                                     | 421 814    | 66 037                           | 0,40                      | Latam Airlines Group S.A.                          | 238 875 538 | 6 945                            | 0,04                      | Canon, Inc. (d)                                | 718 100   | 18 399                           | 0,11                      |
| Novo Nordisk A/S « B »                          | 374 304    | 17 987                           | 0,11                      | Makita Corp. (d)                                   | 176 000     | 6 332                            | 0,04                      |                                                |           |                                  |                           |

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

| DESCRIPTION                                     | ACTIONS    | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                   | ACTIONS   | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | ACTIONS   | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------|------------|-------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------|-----------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-----------|-------------------------------|---------------------------|
| Check Point Software Technologies Ltd. (d)      | 63 782     | \$ 8 383                      | 0,05                      | CF Industries Holdings, Inc.                  | 136 454   | \$ 14 773                     | 0,09                      | Guangdong Investment Ltd. (d)                         | 818 000   | \$ 811                        | 0,00                      |
| Cisco Systems, Inc. (d)                         | 1 414 520  | 166 149                       | 1,02                      | China Gold International Resources Corp. Ltd. | 190 500   | 3 012                         | 0,02                      | Huaneng Power International, Inc. « H »               | 3 500 000 | 2 448                         | 0,02                      |
| Dell International LLC « C » (d)                | 10 785     | 4 653                         | 0,03                      | China Hongqiao Group Ltd.                     | 2 745 000 | 7 079                         | 0,04                      | Kansai Electric Power Co., Inc. (d)                   | 790 300   | 11 173                        | 0,07                      |
| F5, Inc. (d)                                    | 51 262     | 21 323                        | 0,13                      | China Nonferrous Mining Corp. Ltd.            | 998 000   | 1 450                         | 0,01                      | Korea Electric Power Corp.                            | 37 238    | 897                           | 0,01                      |
| Fortinet, Inc. (d)                              | 422 805    | 64 951                        | 0,40                      | Cia de Minas Buenaventura SAA ADR             | 115 555   | 3 385                         | 0,02                      | Kunlun Energy Co. Ltd.                                | 2 456 000 | 2 014                         | 0,01                      |
| GigaDevice Semiconductor, Inc. « A »            | 28 500     | 3 469                         | 0,02                      | Endeavour Mining PLC                          | 183 260   | 8 982                         | 0,05                      | National Grid PLC                                     | 631 824   | 10 427                        | 0,06                      |
| HP, Inc. (d)                                    | 812 374    | 17 823                        | 0,11                      | Fortescue Ltd.                                | 1 234 601 | 16 444                        | 0,10                      | Naturgy Energy Group S.A.                             | 362 741   | 11 377                        | 0,07                      |
| Infosys Ltd.                                    | 2 157 944  | 22 878                        | 0,14                      | Gold Fields Ltd.                              | 803 461   | 26 952                        | 0,17                      | NTPC Ltd. (d)                                         | 206 823   | 780                           | 0,00                      |
| Intuit, Inc. (d)                                | 251 439    | 65 626                        | 0,40                      | Harmony Gold Mining Co. Ltd.                  | 174 899   | 2 674                         | 0,02                      | Osaka Gas Co. Ltd. (d)                                | 45 900    | 1 547                         | 0,01                      |
| Keysight Technologies, Inc. (d)                 | 75 103     | 26 291                        | 0,16                      | ICL Group Ltd.                                | 156 360   | 783                           | 0,00                      | Redeia Corp. S.A.                                     | 287 124   | 4 881                         | 0,03                      |
| Lam Research Corp.                              | 34 449     | 14 928                        | 0,09                      | JFE Holdings, Inc.                            | 141 100   | 1 363                         | 0,01                      | SDIC Power Holdings Co. Ltd. « A » (d)                | 317 814   | 623                           | 0,00                      |
| Largan Precision Co. Ltd.                       | 73 000     | 9 889                         | 0,06                      | Kinross Gold Corp.                            | 1 095 061 | 25 919                        | 0,16                      | Snam SpA                                              | 1 799 073 | 12 996                        | 0,08                      |
| Logitech International S.A. (d)                 | 129 890    | 12 205                        | 0,07                      | Lundin Gold, Inc.                             | 76 570    | 4 129                         | 0,03                      | Tenaga Nasional Bhd.                                  | 2 377 300 | 8 347                         | 0,05                      |
| Micron Technology, Inc. (d)                     | 58 714     | 67 773                        | 0,42                      | LyondellBasell Industries NV « A »            | 228 941   | 12 054                        | 0,07                      | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA                    | 373 637   | 4 366                         | 0,03                      |
| Microsoft Corp. (d)                             | 576 383    | 215 002                       | 1,32                      | National Aluminium Co. Ltd.                   | 720 892   | 2 597                         | 0,02                      | Tokyo Gas Co. Ltd. (d)                                | 93 300    | 3 534                         | 0,02                      |
| Motorola Solutions, Inc.                        | 127 648    | 53 011                        | 0,33                      | Newmont Corp.                                 | 777 342   | 72 604                        | 0,44                      | Verbund AG                                            | 21 864    | 1 386                         | 0,01                      |
| Murata Manufacturing Co. Ltd. (d)               | 363 800    | 26 127                        | 0,16                      | Ningxia Baofeng Energy Group Co. Ltd. « A »   | 301 000   | 901                           | 0,01                      |                                                       |           | 243 094                       | 1,49                      |
| NetApp, Inc. (d)                                | 180 412    | 27 921                        | 0,17                      | Nitto Denko Corp. (d)                         | 350 900   | 6 906                         | 0,04                      |                                                       |           | 9 093 428                     | 55,77                     |
| Novatek Microelectronics Corp. (d)              | 478 000    | 8 084                         | 0,05                      | Nutrien Ltd.                                  | 295 763   | 18 627                        | 0,11                      | <b>DROITS</b>                                         |           |                               |                           |
| NVIDIA Corp.                                    | 1 966 734  | 393 524                       | 2,41                      | Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd. « A » (d) | 230 900   | 1 034                         | 0,01                      | ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.      | 142 808   | 300                           | 0,00                      |
| NXP Semiconductors NV                           | 4 598      | 1 292                         | 0,01                      | Shree Cement Ltd. (d)                         | 2 503     | 668                           | 0,00                      | <b>TITRES PRIVILÉGIÉS</b>                             |           |                               |                           |
| Piotech, Inc. « A »                             | 12 322     | 1 511                         | 0,01                      | Vedanta Aluminium Metal Ltd. (d)              | 190 378   | 902                           | 0,01                      | Cia Energetica de Minas Gerais 0,000 %                | 1 132 900 | 2 379                         | 0,01                      |
| Realtek Semiconductor Corp. (d)                 | 418 000    | 10 669                        | 0,07                      | Vedanta Ltd.                                  | 1 003 849 | 2 989                         | 0,02                      | Gerdau S.A. 0,000 %                                   | 191 000   | 767                           | 0,00                      |
| Samsung Electronics Co. Ltd.                    | 555 187    | 123 194                       | 0,76                      | Wanhua Chemical Group Co. Ltd. « A »          | 134 000   | 1 355                         | 0,01                      | Grupo Cibest S.A. 0,000 %                             | 137 495   | 2 696                         | 0,02                      |
| SK Hynix, Inc.                                  | 43 474     | 76 713                        | 0,47                      | Yara International ASA                        | 139 116   | 6 120                         | 0,04                      | Nationwide Building Society 10,250 %                  | 672       | 115                           | 0,00                      |
| Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.         | 566 800    | 4 439                         | 0,03                      | Yunnan Aluminium Co. Ltd. « A »               | 79 200    | 260                           | 0,00                      | Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %                      | 3 951 000 | 28 854                        | 0,18                      |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. (d) | 4 041 000  | 318 795                       | 1,95                      | Zhejiang NHU Co. Ltd. « A »                   | 126 100   | 529                           | 0,00                      | Samsung Electronics Co. Ltd. 0,000 %                  | 530 282   | 74 781                        | 0,46                      |
| TE Connectivity PLC (d)                         | 225 618    | 45 487                        | 0,28                      | Zijin Mining Group Co. Ltd. « A »             | 1 117 700 | 4 197                         | 0,03                      |                                                       |           | 109 592                       | 0,67                      |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson « B » (d)       | 2 386 028  | 26 809                        | 0,16                      | Zijin Mining Group Co. Ltd. « H »             | 5 374 000 | 19 004                        | 0,12                      | <b>SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER</b>           |           |                               |                           |
| Texas Instruments, Inc.                         | 476 140    | 141 923                       | 0,87                      | <b>IMMOBILIER</b>                             |           |                               |                           | Fibra Uno Administracion S.A. de C.V.                 | 462 500   | 793                           | 0,00                      |
| Tokyo Electron Ltd. (d)                         | 288 500    | 139 941                       | 0,86                      | Aldar Properties PJSC                         | 1 357 383 | 3 063                         | 0,02                      | Klepierre S.A.                                        | 172 270   | 7 204                         | 0,04                      |
| Tower Semiconductor Ltd. (d)                    | 17 918     | 4 634                         | 0,03                      | Central Pattana PCL                           | 1 149 700 | 2 330                         | 0,01                      | Link REIT                                             | 277 800   | 1 296                         | 0,01                      |
| United Microelectronics Corp. (d)               | 10 156 000 | 54 475                        | 0,33                      | China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd.  | 186 400   | 874                           | 0,01                      | VICI Properties, Inc.                                 | 970 375   | 25 764                        | 0,16                      |
| Vanguard International Semiconductor Corp. (d)  | 482 000    | 3 328                         | 0,02                      | CK Asset Holdings Ltd.                        | 1 445 000 | 8 164                         | 0,05                      |                                                       |           | 35 057                        | 0,21                      |
| Yokogawa Electric Corp. (d)                     | 182 800    | 6 427                         | 0,04                      | Emaar Development PJSC                        | 597 633   | 2 252                         | 0,01                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                      |           |                               |                           |
| Zoom Communications, Inc. (d)                   | 125 268    | 10 812                        | 0,07                      | Emaar Properties PJSC                         | 5 208 709 | 16 929                        | 0,10                      | <b>BILLETS À COURT TERME</b>                          |           |                               |                           |
|                                                 |            | 3 127 934                     | 19,18                     | Kaisa Group Holdings Ltd. (d)                 | 1 094 389 | 7                             | 0,00                      | Federal Home Loan Bank 3,500 % éch. 01/07/2026 (e)(f) | \$ 300    | 300                           | 0,00                      |
| <b>MATÉRIAUX</b>                                |            |                               |                           | Swire Pacific Ltd. « A »                      | 105 000   | 1 097                         | 0,01                      | 3,525 % éch. 14/08/2026 (e)(f)                        | 2 700     | 2 688                         | 0,02                      |
| Agnico Eagle Mines Ltd. (I)                     | 127 168    | 19 752                        | 0,12                      | <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>             |           |                               |                           | 3,540 % éch. 02/09/2026 (e)(f)                        | 3 400     | 3 378                         | 0,02                      |
| Aluminum Corp. of China Ltd. « A » (d)          | 456 900    | 559                           | 0,00                      | Acciona S.A. (d)                              | 7 154     | 2 268                         | 0,01                      | 3,545 % éch. 29/07/2026 (e)(f)                        | 5 000     | 4 986                         | 0,03                      |
| Aluminum Corp. of China Ltd. « H »              | 2 834 000  | 2 722                         | 0,02                      | CEZ A/S                                       | 44 844    | 2 625                         | 0,02                      | 3,545 % éch. 09/09/2026 (e)(f)                        | 1 300     | 1 291                         | 0,01                      |
| Anglogold Ashanti PLC                           | 45 822     | 3 691                         | 0,02                      | China Resources Power Holdings Co. Ltd.       | 1 526 000 | 3 299                         | 0,02                      | 3,560 % éch. 21/08/2026 (e)(f)                        | 300       | 298                           | 0,00                      |
| Asahi Kasei Corp. (d)                           | 282 400    | 3 142                         | 0,02                      | China Yangtze Power Co. Ltd. « A » (d)        | 1 140 800 | 4 453                         | 0,03                      | 3,590 % éch. 01/07/2026 (e)(f)                        | 100       | 100                           | 0,00                      |
| Barrick Mining Corp.                            | 672 839    | 24 732                        | 0,15                      | CLP Holdings Ltd.                             | 1 473 500 | 13 774                        | 0,08                      | 3,600 % éch. 09/09/2026 (e)(f)                        | 100       | 99                            | 0,00                      |
| Buzzi Unicem SpA                                | 60 692     | 3 111                         | 0,02                      | Consolidated Edison, Inc.                     | 169 011   | 18 698                        | 0,11                      |                                                       |           |                               |                           |
|                                                 |            |                               |                           | CPFL Energia S.A.                             | 128 600   | 1 113                         | 0,01                      |                                                       |           |                               |                           |
|                                                 |            |                               |                           | Dubai Electricity & Water Authority PJSC (d)  | 1 381 714 | 1 046                         | 0,01                      |                                                       |           |                               |                           |
|                                                 |            |                               |                           | Edison International (d)                      | 302 655   | 22 533                        | 0,14                      |                                                       |           |                               |                           |
|                                                 |            |                               |                           | EDP S.A.                                      | 835 632   | 4 368                         | 0,03                      |                                                       |           |                               |                           |
|                                                 |            |                               |                           | Endesa S.A. (d)                               | 273 338   | 12 427                        | 0,08                      |                                                       |           |                               |                           |
|                                                 |            |                               |                           | Enel SpA (d)                                  | 6 872 896 | 78 883                        | 0,48                      |                                                       |           |                               |                           |

| DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 3,605 % éch. 15/07/2026 (e)(f)     | \$ 2 900                            | \$2 896                          | 0,02                      | 7,393 % éch. 22/07/2026 (e)(f)    | ZAR 16 100                          | \$ 979                           | 0,01                      | 3,710 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,610 % éch. 26/08/2026 (e)(f)     | 6 700                               | 6 661                            | 0,04                      | 7,400 % éch. 05/08/2026 (e)(f)    | 2 300                               | 140                              | 0,00                      | 18/08/2026 (e)(f)                                | \$ 3 600                            | \$ 3 582                         | 0,02                      |
| 3,610 % éch. 16/09/2026 (e)(f)     | 1 600                               | 1 587                            | 0,01                      | 7,400 % éch. 07/10/2026 (e)(f)    | 600                                 | 36                               | 0,00                      | 3,710 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,614 % éch. 30/09/2026 (e)(f)     | 3 400                               | 3 368                            | 0,02                      | 7,401 % éch. 05/08/2026 (e)(f)    | 9 600                               | 582                              | 0,00                      | 03/09/2026 (e)(f)                                | 300                                 | 298                              | 0,00                      |
| 3,620 % éch. 31/07/2026 (e)(f)     | 18 100                              | 18 044                           | 0,11                      | 7,420 % éch. 04/11/2026 (e)(f)    | 300                                 | 18                               | 0,00                      | 3,712 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,620 % éch. 19/08/2026 (e)(f)     | 15 700                              | 15 620                           | 0,10                      |                                   |                                     |                                  |                           | 08/09/2026 (e)(f)                                | 1 900                               | 1 887                            | 0,01                      |
| 3,625 % éch. 31/07/2026 (e)(f)     | 200                                 | 199                              | 0,00                      |                                   |                                     |                                  |                           | 3,716 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,627 % éch. 31/07/2026 (e)(f)     | 300                                 | 299                              | 0,00                      |                                   |                                     |                                  |                           | 10/09/2026 (e)(f)                                | 19 500                              | 19 360                           | 0,12                      |
| 3,630 % éch. 26/08/2026 (e)(f)     | 4 100                               | 4 076                            | 0,03                      | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>   |                                     |                                  |                           | 3,717 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,634 % éch. 28/08/2026 (e)(f)     | 11 700                              | 11 630                           | 0,07                      | 3,583 % éch. 09/07/2026 (e)(f)    | \$ 100                              | 100                              | 0,00                      | 17/09/2026 (e)(f)                                | 400                                 | 397                              | 0,00                      |
| 3,635 % éch. 28/08/2026 (e)(f)     | 2 100                               | 2 088                            | 0,01                      | 3,640 % éch. 14/07/2026 (e)(f)    | 200                                 | 200                              | 0,00                      | 3,718 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,635 % éch. 04/09/2026 (e)(f)     | 1 900                               | 1 887                            | 0,01                      | 3,643 % éch. 21/07/2026 (e)(f)    | 3 700                               | 3 693                            | 0,02                      | 17/09/2026 (e)(f)                                | 1 100                               | 1 091                            | 0,01                      |
| 3,640 % éch. 23/09/2026 (e)(f)     | 1 700                               | 1 685                            | 0,01                      | 3,655 % éch. 20/08/2026 (e)(f)    | 100                                 | 100                              | 0,00                      | 3,721 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,650 % éch. 11/09/2026 (e)(f)     | 600                                 | 596                              | 0,00                      | 3,661 % éch. 23/07/2026 (e)(f)    | 1 700                               | 1 696                            | 0,01                      | 18/08/2026 (e)(f)                                | 8 200                               | 8 160                            | 0,05                      |
|                                    |                                     | 83 776                           | 0,51                      | 3,661 % éch. 30/07/2026 (e)(f)    | 600                                 | 598                              | 0,00                      | 3,722 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>     |                                     |                                  |                           | 3,668 % éch. 07/07/2026 (e)(f)    | 1 400                               | 1 399                            | 0,01                      | 10/09/2026 (e)(f)                                | 1 500                               | 1 489                            | 0,01                      |
| 23,650 % éch. 13/10/2026 (e)(f)    | EGP 154 800                         | 2 954                            | 0,02                      | 3,668 % éch. 21/07/2026 (e)(f)    | 500                                 | 499                              | 0,00                      | 3,723 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 24,000 % éch. 13/10/2026 (e)(f)    | 211 600                             | 4 038                            | 0,03                      | 3,670 % éch. 15/09/2026 (e)(f)    | 100                                 | 99                               | 0,00                      | 10/09/2026 (e)(f)                                | 1 200                               | 1 191                            | 0,01                      |
| 24,060 % éch. 20/10/2026 (e)(f)    | 8 400                               | 160                              | 0,00                      | 3,673 % éch. 27/08/2026 (e)(f)    | 2 400                               | 2 386                            | 0,02                      | 3,728 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     | 7 152                            | 0,05                      | 3,674 % éch. 13/08/2026 (b)(e)(f) | 500                                 | 498                              | 0,00                      | 18/08/2026 (e)(f)                                | 3 900                               | 3 881                            | 0,02                      |
| <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIEN</b>     |                                     |                                  |                           | 3,675 % éch. 23/07/2026 (e)(f)    | 100                                 | 100                              | 0,00                      | 3,730 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 20,422 % éch. 12/01/2027 (e)(f)    | 3 864 60                            |                                  |                           | 3,678 % éch. 21/07/2026 (e)(f)    | 1 200                               | 1 198                            | 0,01                      | 25/08/2026 (e)(f)                                | 3 100                               | 3 083                            | 0,02                      |
|                                    | 0                                   | 2 532                            | 0,02                      | 3,678 % éch. 11/08/2026 (e)(f)    | 300                                 | 299                              | 0,00                      | 3,734 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 21,137 % éch. 06/10/2026 (e)(f)    | 38 851                              | 27                               | 0,00                      | 3,678 % éch. 27/08/2026 (e)(f)    | 900                                 | 895                              | 0,01                      | 18/08/2026 (e)(f)                                | 2 800                               | 2 786                            | 0,02                      |
| 21,241 % éch. 14/07/2026 (e)(f)    | 97 127                              | 70                               | 0,00                      | 3,680 % éch. 30/07/2026 (e)(f)    | 200                                 | 199                              | 0,00                      | 3,765 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 21,322 % éch. 28/07/2026 (e)(f)    | 46 621                              | 33                               | 0,00                      | 3,681 % éch. 23/07/2026 (e)(f)    | 300                                 | 299                              | 0,00                      | 17/09/2026 (e)(f)                                | 6 900                               | 6 846                            | 0,04                      |
| 21,480 % éch. 28/07/2026 (e)(f)    | 58 300                              | 42                               | 0,00                      | 3,681 % éch. 28/07/2026 (e)(f)    | 4 000                               | 3 989                            | 0,03                      | 3,767 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     | 2 704                            | 0,02                      | 3,683 % éch. 09/07/2026 (e)(f)    | 3 500                               | 3 497                            | 0,02                      | 24/09/2026 (e)(f)                                | 800                                 | 793                              | 0,01                      |
| <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAÏN</b> |                                     |                                  |                           | 3,683 % éch. 04/08/2026 (b)(e)(f) | 600                                 | 598                              | 0,00                      | 3,779 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,046 % éch. 27/01/2027 (e)(f)     | ZAR 29 700                          | 1 743                            | 0,01                      | 3,684 % éch. 09/07/2026 (e)(f)    | 100                                 | 100                              | 0,00                      | 24/09/2026 (e)(f)                                | 600                                 | 595                              | 0,00                      |
| 7,066 % éch. 28/10/2026 (e)(f)     | 2 400                               | 143                              | 0,00                      | 3,686 % éch. 09/07/2026 (e)(f)    | 300                                 | 300                              | 0,00                      |                                                  |                                     | 98 255                           | 0,60                      |
| 7,304 % éch. 19/08/2026 (e)(f)     | 9 000                               | 544                              | 0,00                      | 3,686 % éch. 11/08/2026 (e)(f)    | 200                                 | 199                              | 0,00                      | Total des Instruments à court terme              |                                     | 197 006                          | 1,21                      |
| 7,305 % éch. 18/11/2026 (e)(f)     | 15 700                              | 934                              | 0,01                      | 3,687 % éch. 28/07/2026 (e)(f)    | 1 800                               | 1 795                            | 0,01                      | Total des Valeurs mobilières                     |                                     | \$16 406 576                     | 100,61                    |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,688 % éch. 08/09/2026 (e)(f)    | 4 300                               | 4 270                            | 0,03                      | <b>ACTIONS</b>                                   |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,693 % éch. 08/09/2026 (e)(f)    | 7 200                               | 7 149                            | 0,05                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                    |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,697 % éch. 15/09/2026 (e)(f)    | 200                                 | 198                              | 0,00                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>         |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,702 % éch. 11/08/2026 (e)(f)    | 100                                 | 100                              | 0,00                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds                   |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,702 % éch. 01/09/2026 (b)(e)(f) | 200                                 | 199                              | 0,00                      | PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i) |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,704 % éch. 28/07/2026 (e)(f)    | 500                                 | 499                              | 0,00                      |                                                  | 124 029 806                         | 1 236 860                        | 7,59                      |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,705 % éch. 25/08/2026 (e)(f)    | 1 300                               | 1 293                            | 0,01                      | Total des Fonds d'investissement                 |                                     | \$1 236 860                      | 7,59                      |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,706 % éch. 10/09/2026 (e)(f)    | 1 300                               | 1 291                            | 0,01                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,707 % éch. 08/09/2026 (e)(f)    | 400                                 | 397                              | 0,00                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 3,709 % éch. 22/09/2026 (e)(f)    | 1 100                               | 1 091                            | 0,01                      |                                                  |                                     |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                           | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif<br>net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|
| BPS                                   | 3,690 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 88 200               | Titres du Trésor américain protégés contre<br>l'inflation 1,875 % échéance 15/07/2035 | \$ (89 569)         | \$ 88 200                                      | \$ 88 209                                                                      | 0,54                      |
|                                       | 3,700           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 90 100                  | Ginnie Mae 5,500 % échéance 20/11/2052                                                | (93 202)            | 90 100                                         | 90 109                                                                         | 0,55                      |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                                       | \$ (182 771)        | \$ 178 300                                     | \$ 178 318                                                                     | 1,09                      |

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 432                   | \$ 464                                  | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 375                   | (407)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index juillet                              | Court | 07/2026              | 193                   | 79                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre                    | Court | 09/2026              | 9                     | (15)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Euro STOXX 50 Index septembre                     | Court | 09/2026              | 254                   | (152)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index septembre                          | Court | 09/2026              | 33                    | 13                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index juillet                      | Long  | 07/2026              | 6                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index septembre                          | Court | 09/2026              | 30                    | (1)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index septembre                          | Court | 09/2026              | 29                    | 79                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice IBEX 35 Index juillet                             | Court | 07/2026              | 50                    | (242)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice KOSPI2 Index septembre                            | Court | 09/2026              | 31                    | (683)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Mini MSCI Emerging Markets Index septembre        | Court | 09/2026              | 72                    | 111                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index juillet                      | Court | 07/2026              | 315                   | 61                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index juillet                              | Court | 07/2026              | 35                    | (23)                                    | 0,00                   |



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

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P CNX Nifty Index juillet                          | Court | 07/2026           | 105                | \$ 28                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P/Toronto Stock Exchange 60 Index septembre        | Long  | 09/2026           | 65                 | 11                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index septembre                              | Court | 09/2026           | 225                | 435                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index septembre                                | Court | 09/2026           | 75                 | (532)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 2 397              | (292)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 3 826              | 1 021                             | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 7 427              | 3 356                             | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 956                | 1 231                             | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 95                 | (260)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 3 539              | 9 877                             | 0,06                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 2 726              | 7 739                             | 0,05                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index septembre                                | Court | 09/2026           | 3                  | 2                                 | 0,00                |
|                                                                                               |       |                   |                    | <b>\$ 21 901</b>                  | <b>0,14</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | <b>\$ 21 901</b>                  | <b>0,14</b>         |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Boeing Co.          | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 2 500                         | \$ 3                              | 0,00                |
| Deutsche Bank AG    | 1,000                | 20/12/2029      | € 500                            | 8                                 | 0,00                |
|                     |                      |                 |                                  | <b>\$ 11</b>                      | <b>0,00</b>         |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-43 Index à 5 ans             | (5,000) %           | 20/12/2029      | \$ 3 616                         | \$ (54)                           | 0,00                |
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans             | (5,000)             | 20/06/2030      | 1 558                            | (10)                              | 0,00                |
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans             | (5,000)             | 20/06/2030      | 784                              | 6                                 | 0,00                |
| Indice CDX.IG-43 Index à 5 ans             | (1,000)             | 20/12/2029      | 11 995                           | (4)                               | 0,00                |
| Indice CDX.IG-44 Index à 5 ans             | (1,000)             | 20/06/2030      | 18 400                           | 29                                | 0,01                |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | (1,000)             | 20/12/2030      | 11 230                           | (52)                              | 0,00                |
| Indice iTraxx Crossover 44 Index à 5 ans   | (5,000)             | 20/12/2030      | € 6 180                          | (260)                             | 0,00                |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans   | (5,000)             | 20/06/2031      | 33 440                           | (941)                             | (0,01)              |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | (1,000)             | 20/06/2031      | 194 610                          | (934)                             | (0,01)              |
|                                            |                     |                 |                                  | <b>\$ (2 220)</b>                 | <b>(0,01)</b>       |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | \$ 4 008                         | \$ (113)                          | 0,00                |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 123 108                          | 3 213                             | 0,02                |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                | 20/06/2031      | 795 713                          | 7 680                             | 0,04                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 77 900                           | 16                                | 0,00                |
|                                |                      |                 |                                  | <b>\$ 10 796</b>                  | <b>0,06</b>         |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 81 500          | \$ (923)                          | (0,01)              |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 17/09/2035      | 3 500             | 27                                | 0,00                |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      | 122 500           | 637                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,250     | 18/03/2036      | 20 500            | 547                               | 0,00                |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 1 800             | (142)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050     | 15/12/2031      | ¥ 690 000         | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450     | 15/12/2051      | 300 000           | 55                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,700     | 18/09/2029      | 2 530 000         | 28                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750     | 19/03/2027      | 3 050 000         | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750     | 19/03/2030      | 3 160 000         | 77                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 21/03/2034      | 573 500           | 329                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/09/2034      | 1 531 800         | 284                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 19/03/2035      | 1 416 750         | 717                               | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 17/09/2035      | 211 600           | (91)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/03/2036      | 6 283 950         | 1 431                             | 0,01                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 19/03/2055      | 160 000           | 41                                | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,000 %   | 16/09/2036      | ¥ 10 673 000      | \$ 153                            | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2029      | \$ 800            | (43)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2052      | 3 100             | 74                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,385     | 08/06/2032      | 6 100             | (235)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,750     | 21/06/2053      | 4 000             | 163                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2027      | 101 900           | 796                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2028      | 10 200            | 107                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030      | 42 400            | (356)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 21/06/2033      | 5 100             | (133)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,085     | 13/02/2034      | 23 920            | (403)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2030      | 10 400            | (34)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2032      | 34 000            | (455)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2035      | 21 000            | 222                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2055      | 2 000             | 150                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,300     | 28/02/2029      | 3 690             | 75                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,300     | 30/06/2031      | 4 130             | 138                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,300     | 15/11/2053      | 1 130             | 179                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,308     | 21/02/2029      | 10 400            | 155                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 4 910             | 83                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/12/2027      | 429 625           | (6 172)                           | (0,04)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2030      | 26 600            | (403)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2033      | 27 240            | (382)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2033      | 19 140            | 67                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 1 000             | 135                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2026      | 245 900           | 1 073                             | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/12/2028      | 6 200             | 20                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2029      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 1 100             | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 28 200            | 693                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2031      | 4 600             | 108                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2031      | 7 220             | (40)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 5 792             | 56                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2034      | 19 800            | 200                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/09/2034      | 3 400             | (70)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 6 400             | 99                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035      | 11 500            | (196)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 48 700            | (88)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2036      | 10 100            | (548)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 27 700            | 114                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,760     | 23/08/2033      | 7 135             | 86                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,800     | 10/03/2028      | 4 504             | 54                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,800     | 30/08/2033      | 4 300             | 51                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 15/11/2053      | 400               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 20/06/2027      | 7 600             | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 1 740             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 19/03/2035      | 13 100            | (46)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 34 600            | 937                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,085     | 15/11/2053      | 1 265             | 25                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,250     | 22/11/2033      | 1 700             | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,250     | 20/03/2034      | 7 600             | 163                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,257     | 15/11/2053      | 52 220            | (440)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,259     | 15/11/2053      | 72 740            | (644)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,262     | 15/11/2053      | 52 310            | (487)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 10,203    | 04/01/2027      | BRL 71 600        | (138)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 10,256    | 04/01/2027      | 51 600            | (602)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 11,604    | 04/01/2027      | 27 900            | (374)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 12,841    | 02/01/2031      | 226 870           | (1 050)                           | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,172    | 02/01/2031      | 56 300            | (236)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,180    | 02/01/2031      | 84 000            | (333)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,330    | 02/01/2031      | 356 700           | (1 162)                           | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,354    | 02/01/2029      | 81 900            | (406)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 14,684    | 02/01/2031      | 825 400           | 385                               | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 15/09/2035      | CAD 41 000        | 239                               | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 18/03/2036      | 8 600             | (70)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 16/09/2036      | 31 400            | (87)                              | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 20/03/2034      | 1 700             | 48                                | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 18/09/2034      | 2 600             | (12)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 19/03/2035      | 10 000            | 178                               | 0,00                |
| À payer                          | BBR NZD à 3 mois                  | 4,750     | 19/06/2029      | NZD 2 500         | 38                                | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,500     | 19/03/2027      | AUD 14 200        | (36)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,150     | 19/03/2055      | 800               | (46)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 19/03/2030      | 11 900            | (192)                             | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | 100 360           | (278)                             | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 20/03/2034      | 6 400             | (43)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 19/03/2035      | 3 300             | (75)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/06/2035      | 19 500            | (566)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 16 900          | (175)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 17/09/2035      | 6 000             | (18)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 14 300            | (202)                             | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 19/03/2035      | 1 700             | (18)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 18/03/2036      | 22 880            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 15 800            | (145)                             | 0,00                |

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

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750 %   | 16/09/2036      | € 1 400           | \$ 24                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 39 340            | 212                               | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (7 067)                        | (0,04)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ 1 520                          | 0,01                |

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

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

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

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

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                        | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,000 % éch. 01/09/2056 | \$ 70,000       | 04/09/2026        | 108 000                          | \$ 4  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,500 % éch. 01/07/2056 | 70,000          | 06/07/2026        | 71 000                           | 3     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 70,000          | 04/09/2026        | 216 000                          | 8     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,500 % éch. 01/09/2056 | 70,000          | 04/09/2026        | 230 000                          | 9     | 0            | 0,00                |
| GSC          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,500 % éch. 01/07/2056 | 85,438          | 06/07/2026        | 146 200                          | 3     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,500 % éch. 01/07/2056 | 92,000          | 06/07/2026        | 198 200                          | 4     | 0            | 0,00                |
|              |                                                                                                                    |                 |                   |                                  | \$ 31 | \$ 0         | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description                      | Indice initial | Taux variable                                                 | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM          | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 78,177      | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035        | 8 200                            | \$ (359) | \$ (171)     | 0,00                |

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

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Obligation internationale du gouvernement israélien | 1,000 %              | 20/12/2029      | \$ 100                           | \$ (3)                 | \$ 5                              | \$ 2         | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement israélien | 1,000                | 20/12/2029      | 200                              | (5)                    | 9                                 | 4            | 0,00                |
|              |                                                     |                      |                 |                                  | \$ (8)                 | \$ 14                             | \$ 6         | 0,00                |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 70                             | \$ 16                  | \$ (1)                            | \$ 15        | 0,00                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 140                              | 32                     | (2)                               | 30           | 0,00                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 70                               | 16                     | (1)                               | 15           | 0,00                |
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | \$ 1 765                         | (6)                    | 7                                 | 1            | 0,00                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | € 140                            | 32                     | (2)                               | 30           | 0,00                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | \$ 7 424                         | 0                      | 6                                 | 6            | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 2 200                            | (21)                   | 28                                | 7            | 0,00                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 69                  | \$ 35                             | \$ 104       | 0,00                |

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

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

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES |                    |                                    |                              |               |                   |                 |                        |                                  |              |                     |        |
|--------------------------------------|--------------------|------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|--------|
| Contrepartie                         | À payer/à recevoir | Titre                              | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |        |
| BOA                                  | À payer            | Indice Brazil Stock Exchange Index | 709                          | 0,000 %       | BRL               | 123 206         | 12/08/2026             | \$ 0                             | \$ (143)     | \$ (143)            | 0,00   |
| BRC                                  | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 97 035                       | 4,120         | \$                | 59 878          | 09/06/2027             | 0                                | 235          | 234                 | 0,00   |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 171 708                      | 3,975         |                   | 107 424         | 07/10/2026             | 0                                | (1 206)      | (1 206)             | (0,01) |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 26 740                       | 3,935         |                   | 16 729          | 03/02/2027             | 0                                | (187)        | (187)               | 0,00   |
| MBC                                  | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 360 380                      | 4,170         |                   | 220 404         | 23/06/2027             | 0                                | 3 120        | 3 120               | 0,02   |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 38 081                       | 4,030         |                   | 23 824          | 23/09/2026             | 0                                | (269)        | (269)               | 0,00   |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 64 246                       | 3,985         |                   | 40 193          | 21/10/2026             | 0                                | (452)        | (452)               | 0,00   |
| MEI                                  | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 431 168                      | 3,600         |                   | 269 742         | 01/07/2026             | 0                                | (2 943)      | (2 942)             | (0,02) |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 94 278                       | 4,000         |                   | 58 982          | 11/11/2026             | 0                                | (664)        | (664)               | 0,00   |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 112 568                      | 3,935         |                   | 70 425          | 03/02/2027             | 0                                | (789)        | (789)               | (0,01) |
| MYI                                  | À payer            | Indice SET 50 Index                | 497 800                      | 0,000         | THB               | 503 865         | 29/09/2026             | 0                                | (514)        | (514)               | 0,00   |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 142 986                      | 3,600         | \$                | 89 455          | 01/07/2026             | 0                                | (978)        | (978)               | (0,01) |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 172 325                      | 3,960         |                   | 107 810         | 02/09/2026             | 0                                | (1 209)      | (1 209)             | (0,01) |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 36 343                       | 4,290         |                   | 22 268          | 23/09/2026             | 0                                | 271          | 271                 | 0,00   |
|                                      | À recevoir         | NDUEACWF Index                     | 297 527                      | 4,010         |                   | 186 138         | 18/11/2026             | 0                                | (2 096)      | (2 096)             | (0,01) |
|                                      |                    |                                    |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (7 824)                       | \$ (7 824)   | (0,05)              |        |

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À payer            | Nvidia Corp. | 32 360                       | 5,620 %       | \$ 6 230          | 29/07/2026      | \$ 0                   | \$ (243)                          | \$ (243)     | 0,00                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 47 056            | \$                 | 33 649                | \$ 1 048                                | 0,01                |
|              | 07/2026           | NZD             | 5 567             |                    | 3 288                 | 121                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 13 015            |                    | 10 205                | 143                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 214               | CAD                | 304                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 648             | NZD                | 11 769                | 46                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 303               | \$                 | 214                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 11 769            |                    | 6 656                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 5 300             | IDR                | 94 510 713            | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 12 700            | KRW                | 19 165 781            | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 241 886           | \$                 | 46 560                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 385               |                    | 514                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 74 863            |                    | 49                    | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 13 274            |                    | 1 434                 | 92                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 314               |                    | 245                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 266             | ¥                  | 201 333               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 68                | PLN                | 257                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 15                | SGD                | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 19                | \$                 | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 41 097            | BRL                | 215 193               | 155                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 833               | HKD                | 6 515                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 806               | ILS                | 2 396                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 10 887            | \$                 | 623                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | BRL             | 2 644             |                    | 500                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 23 677 032        |                    | 6 341                 | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ILS             | 2 391             |                    | 800                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 243 672           |                    | 484                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             | 60 019            |                    | 973                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 928             | COP                | 14 477 412            | 199                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 600               | IDR                | 10 845 540            | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 400               | PEN                | 1 370                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 5 463             | BRL                | 28 968                | 13                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR             | 2 323             | \$                 | 142                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 8 358             |                    | 2 427                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$              | 210               | PEN                | 723                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR             | 308               | \$                 | 17                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 939               | CLP                | 852 730               | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | ZAR             | 28 471            | \$                 | 1 732                 | 23                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD             | 127 307           |                    | 88 336                | 433                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 28 536            |                    | 5 480                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 371             |                    | 498                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 305               |                    | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 1 007 796         |                    | 1 172 198             | 20 497                                  | 0,12                |
|              | 07/2026           | £               | 88 650            |                    | 118 674               | 1 016                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | HKD             | 25 176            |                    | 3 211                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 224               |                    | 76                    | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 18 500            |                    | 10 790                | 266                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 10                |                    | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 52 987            |                    | 1 112                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 740             | BRL                | 14 150                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 213            | £                  | 9 930                 | 36                                      | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
|              | 07/2026           | \$              | ¥                 | 1 530 911          | \$ 0                  | \$ (170)                                | \$ (170)            | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | KWD               | 1                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 221                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 10 776             | 0                     | (50)                                    | (50)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | CAD             | \$                | 2 465              | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             |                   | 1 200              | 0                     | (52)                                    | (52)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 1 901              | 29                    | (2)                                     | 27                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 1 900              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 3 336              | 41                    | 0                                       | 41                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | IDR               | 1 028 665          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | NOK               | 227 602            | 0                     | (969)                                   | (969)               | (0,01) |
|              | 09/2026           |                 | SEK               | 176 122            | 0                     | (605)                                   | (605)               | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | THB               | 162 518            | 0                     | (77)                                    | (77)                | 0,00   |
|              | 10/2026           |                 | BRL               | 29 162             | 33                    | 0                                       | 33                  | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | IDR               | 17 206 381         | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 06/2027           |                 | KWD               | 1                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2029           | KWD             | \$                | 30                 | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 05/2030           |                 |                   | 20                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| BRC          | 07/2026           | CNH             |                   | 32                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | COP             |                   | 242                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 84                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 12                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | MYR             |                   | 3 145              | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             |                   | 4 782              | 182                   | 0                                       | 182                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 35 857             | 0                     | (89)                                    | (89)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             |                   | 591                | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | TRY             |                   | 11 828             | 0                     | (155)                                   | (155)               | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | COP               | 831 499            | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | MYR               | 13 634             | 0                     | (15)                                    | (15)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | PEN               | 122 562            | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | SGD               | 5 451              | 0                     | (42)                                    | (42)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | TRY               | 1 802 508          | 630                   | 0                                       | 630                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 3 796              | 38                    | (39)                                    | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | SGD             |                   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | ¥                 | 1 907              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | \$                | 31                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 700                | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | COP               | 831 499            | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
| BSH          | 07/2026           | €               | \$                | 67 907             | 1 229                 | 0                                       | 1 229               | 0,01   |
|              | 07/2026           | \$              | ¥                 | 3 335 000          | 0                     | (455)                                   | (455)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | NZD               | 20 385             | 78                    | 0                                       | 78                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | \$                | 11 531             | 0                     | (78)                                    | (78)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 180 922            | 0                     | (777)                                   | (777)               | (0,01) |
|              | 09/2026           | BRL             | \$                | 2 598              | 62                    | 0                                       | 62                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | CLP               | 371 708            | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | COP               | 6 194 129          | 70                    | 0                                       | 70                  | 0,00   |
|              | 01/2027           | PEN             | \$                | 1 101              | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
| CBK          | 03/2027           | \$              | PEN               | 2 774              | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | \$                | 13 816             | 272                   | 0                                       | 272                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             |                   | 10 949             | 150                   | 0                                       | 150                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             |                   | 8                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | HUF             |                   | 1 700              | 31                    | 0                                       | 31                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 86                 | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 6 175              | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             |                   | 119                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             |                   | 10 190             | 462                   | 0                                       | 462                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 1 626              | 0                     | (23)                                    | (23)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 1 711              | 0                     | (39)                                    | (39)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | £                 | 860                | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | HUF               | 9 074              | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | SEK               | 14 970             | 0                     | (48)                                    | (48)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 1 769              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | \$                | 1 905              | 100                   | 0                                       | 100                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | INR             |                   | 4 603              | 64                    | 0                                       | 64                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | HKD               | 26 321             | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | ILS               | 4 806              | 0                     | (21)                                    | (21)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | CLP             | \$                | 579                | 33                    | 0                                       | 33                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             |                   | 43 343             | 0                     | (2 741)                                 | (2 741)             | (0,02) |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 4 438              | 4                     | (3)                                     | 1                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | KZT             |                   | 1 008              | 0                     | (29)                                    | (29)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 64                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             |                   | 3                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | SEK             |                   | 1 928              | 48                    | 0                                       | 48                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | IDR               | 246 537            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | MXN               | 10 761             | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | NOK               | 15 222             | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | PEN               | 72                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | PLN               | 8 050              | 0                     | (59)                                    | (59)                | 0,00   |
|              | 11/2026           | PEN             | \$                | 2 995              | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 12/2026           | COP             |                   | 1 018              | 0                     | (106)                                   | (106)               | 0,00   |
|              | 12/2026           | PEN             |                   | 24 290             | 0                     | (225)                                   | (225)               | 0,00   |
|              | 12/2026           | \$              | IDR               | 73 700 744         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 12/2026           | \$              | 1 187             | MXN 20 883         | \$ 0                  | \$ (8)                                  | \$ (8) 0,00         |
|              | 12/2026           |                 | 1 045             | PEN 3 653          | 19                    | 0                                       | 19 0,00             |
|              | 07/2026           | CNH             | 58                | \$ 9               | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CZK             | 76 178            | 3 659              | 69                    | 0                                       | 69 0,00             |
|              | 07/2026           | KZT             | 134 358           | 282                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | NOK             | 32 975            | 3 549              | 217                   | 0                                       | 217 0,00            |
|              | 07/2026           | PLN             | 436               | 118                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | SGD             | 194               | 152                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 175               | CNH 1 188          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 264             | PLN 4 690          | 0                     | (16)                                    | (16) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 50                | SGD 65             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 42 226            | \$ 2 574           | 31                    | (29)                                    | 2 0,00              |
|              | 08/2026           | CNH             | 1 185             | 175                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | KZT             | 864 720           | 1 789              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 08/2026           | SGD             | 64                | 50                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 20                | INR 1 864          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | CLP             | 1 647 612         | \$ 1 800           | 12                    | 0                                       | 12 0,00             |
|              | 09/2026           | IDR             | 8 392 485         | 462                | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 09/2026           | ILS             | 2 060             | 700                | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 09/2026           | INR             | 47 738            | 500                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | \$              | 18 373            | CHF 14 456         | 0                     | (301)                                   | (301) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 23 334            | £ 17 400           | 0                     | (240)                                   | (240) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 2 300             | HUF 696 415        | 0                     | (69)                                    | (69) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 5 000             | INR 482 814        | 67                    | 0                                       | 67 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 500               | PEN 1 696          | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 09/2026           |                 | 6 663             | SEK 61 666         | 0                     | (264)                                   | (264) 0,00          |
| FAR          | 11/2026           | KZT             | 530 754           | \$ 1 071           | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 320             | 491                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | £               | 154 399           | 207 465            | 2 540                 | 0                                       | 2 540 0,01          |
|              | 07/2026           | HKD             | 232 849           | 29 743             | 51                    | 0                                       | 51 0,00             |
|              | 07/2026           | ¥               | 16 573 435        | 102 432            | 457                   | 0                                       | 457 0,00            |
|              | 07/2026           | PLN             | 9 928             | 2 719              | 78                    | 0                                       | 78 0,00             |
|              | 07/2026           | SGD             | 10 215            | 8 007              | 109                   | 0                                       | 109 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 2 510             | CNH 17 067         | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 2 100             | ¥ 338 817          | 0                     | (15)                                    | (15) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 1 581             | PLN 5 879          | 0                     | (17)                                    | (17) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 4 870             | SEK 47 253         | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 18                | SGD 24             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 11 874            | \$ 720             | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 08/2026           | CNH             | 17 029            | 2 510              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 08/2026           | ILS             | 5 897             | 2 060              | 79                    | 0                                       | 79 0,00             |
|              | 08/2026           | ¥               | 278 537           | 1 725              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 08/2026           | SEK             | 47 169            | 4 870              | 0                     | (13)                                    | (13) 0,00           |
|              | 08/2026           | SGD             | 24                | 18                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 65                | £ 49               | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 102 432           | ¥ 16 530 065       | 0                     | (460)                                   | (460) 0,00          |
|              | 09/2026           | £               | 1 900             | \$ 2 544           | 23                    | 0                                       | 23 0,00             |
|              | 09/2026           | PEN             | 4 043             | 1 200              | 18                    | 0                                       | 18 0,00             |
|              | 09/2026           | PHP             | 24 660            | 400                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | PLN             | 6 330             | 1 700              | 17                    | (1)                                     | 16 0,00             |
|              | 09/2026           | THB             | 9 956             | 300                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 09/2026           | \$              | 30 713            | € 26 400           | 0                     | (434)                                   | (434) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 8 617             | £ 6 400            | 0                     | (122)                                   | (122) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 5 000             | IDR 89 893 000     | 0                     | (17)                                    | (17) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 1 841             | INR 176 432        | 11                    | 0                                       | 11 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 5 000             | MYR 20 315         | 0                     | (20)                                    | (20) 0,00           |
| GLM          | 09/2026           |                 | 15 992            | PEN 54 894         | 57                    | 0                                       | 57 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 7 000             | SGD 8 921          | 0                     | (66)                                    | (66) 0,00           |
|              | 09/2026           | ZAR             | 16 619            | \$ 1 000           | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 07/2026           | BRL             | 154 817           | 29 765             | 0                     | (146)                                   | (146) 0,00          |
|              | 07/2026           | CNH             | 76                | 11                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 67 559            | BRL 360 927        | 2 173                 | 0                                       | 2 173 0,01          |
|              | 07/2026           |                 | 20 539            | CAD 29 227         | 62                    | 0                                       | 62 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 84                | PLN 314            | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | CAD             | 29 185            | \$ 20 539          | 0                     | (62)                                    | (62) 0,00           |
|              | 08/2026           | NGN             | 61 425            | 39                 | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 3 440             | BRL 17 581         | 0                     | (70)                                    | (70) 0,00           |
|              | 08/2026           | ZAR             | 9 796             | 550                | 0                     | (46)                                    | (46) 0,00           |
|              | 09/2026           | BRL             | 7 949             | 1 500              | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 09/2026           | IDR             | 26 027 124        | 1 446              | 7                     | (4)                                     | 3 0,00              |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 247             | 72                 | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | THB             | 67 134            | 2 084              | 51                    | 0                                       | 51 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 15 678            | BRL 81 938         | 32                    | (118)                                   | (86) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 2 495             | CLP 2 231 256      | 0                     | (74)                                    | (74) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 40                | IDR 710 586        | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 200               | ILS 570            | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 09/2026           |                 | 7 131             | INR 680 380        | 17                    | (8)                                     | 9 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 40 893            | MXN 711 039        | 0                     | (458)                                   | (458) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 5 000             | MYR 19 876         | 0                     | (128)                                   | (128) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 1 631             | THB 53 168         | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
| IND          | 10/2026           |                 | 19 667            | BRL 104 631        | 112                   | 0                                       | 112 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 77                | PLN 291            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |



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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 200 851           | \$ 143 185         | \$ 4 037              | \$ 0                                    | \$ 4 037            | 0,02 |
|              | 07/2026           | BRL             | 14 187            | 2 757              | 16                    | 0                                       | 16                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | CHF             | 110               | 141                | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | CNH             | 110               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | HUF             | 1 568 443         | 5 128              | 92                    | 0                                       | 92                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | ILS             | 659               | 221                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | KZT             | 69 482            | 145                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | PLN             | 24 113            | 6 619              | 204                   | 0                                       | 204                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 255               | CNH 1 723          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | 1 988           | CZK 41 373        | 0                  | (39)                  | (39)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 57              | £ 42              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 207             | HUF 62 835        | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 7 526           | NOK 74 497        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 41              | PLN 155           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 10 184          | SGD 12 984        | 0                  | (146)                 | (146)                                   | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | ILS 12 376      | \$ 4 298          | 140                | 0                     | 140                                     | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | KZT 323 013     | 665               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | NOK 74 530      | 7 526             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | \$ 3 530        | HKD 27 618        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | 2 007           | ILS 5 919         | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | MXN 56 320      | \$ 3 242          | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | NOK 23 742      | 2 496             | 99                 | 0                     | 99                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | THB 32 758      | 1 017             | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | \$ 12 202       | CAD 16 933        | 0                  | (227)                 | (227)                                   | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | 3 310           | IDR 60 631 179    | 51                 | 0                     | 51                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | 1 500           | ILS 4 358         | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | 32 458          | ¥ 5 186 452       | 0                  | (351)                 | (351)                                   | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | 3 624           | MXN 63 477        | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | 5 000           | PHP 309 635       | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | 5 270           | THB 172 392       | 0                  | (48)                  | (48)                                    | 0,00                |      |
|              | 10/2026           | 2 757           | BRL 14 499        | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |      |
|              | 11/2026           | ZAR 15 030      | \$ 858            | 0                  | (49)                  | (49)                                    | 0,00                |      |
|              | 12/2026           | MXN 26 622      | 1 510             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |      |
|              | 12/2026           | \$ 23 517       | MXN 412 285       | 0                  | (239)                 | (239)                                   | 0,00                |      |
|              | MBC               | 07/2026         | AUD 44 052        | \$ 30 399          | 37                    | (157)                                   | (120)               | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CHF 8 714         | 11 127             | 324                   | 0                                       | 324                 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CNH 87            | 13                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | € 119 533         | 138 696            | 2 034                 | 0                                       | 2 034               | 0,01 |
|              |                   | 07/2026         | KRW 1 288 555     | 850                | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | NOK 78 365        | 8 451              | 532                   | 0                                       | 532                 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | SEK 207         | 22                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | SGD 8           | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | \$ 153 039      | AUD 221 520       | 593                | (163)                 | 430                                     | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 4 042           | CHF 3 181         | 0                  | (98)                  | (98)                                    | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 148             | COP 562 465       | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 1 346 186       | € 1 185 184       | 8 865              | (29)                  | 8 836                                   | 0,05                |      |
| 07/2026      |                   | 1 537           | HUF 469 389       | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 20 345          | ¥ 3 232 749       | 0                  | (454)                 | (454)                                   | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 5 068           | NOK 49 275        | 10                 | (99)                  | (89)                                    | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 2 964           | SEK 28 856        | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | 552             | SGD 709           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | AUD 211 517     | \$ 145 855        | 0                  | (598)                 | (598)                                   | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | € 1 181 089     | 1 343 292         | 0                  | (8 858)               | (8 858)                                 | (0,05)              |      |
| 08/2026      |                   | NOK 24 035      | 2 418             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | SEK 28 805      | 2 964             | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | HUF 216 156     | 700               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | \$ 8 535        | € 7 300           | 0                  | (162)                 | (162)                                   | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 600             | INR 57 683        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 3 300           | MXN 57 307        | 0                  | (41)                  | (41)                                    | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 8 473           | NOK 78 741        | 0                  | (524)                 | (524)                                   | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 5 400           | PHP 326 503       | 0                  | (96)                  | (96)                                    | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 1 222           | SEK 11 846        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 5 600           | THB 181 252       | 0                  | (110)                 | (110)                                   | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | 2 200           | ZAR 35 907        | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |      |
| 10/2026      |                   | ZAR 563         | \$ 32             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |      |
| MYI          |                   | 07/2026         | AUD 4 138         | 2 848              | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CHF 551           | 681                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CNH 6 190         | 910                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | € 901           | 1 029             | 1                  | (2)                   | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | £ 467           | 619               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | ¥ 657 123       | 4 073             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | SGD 16 157      | 12 490            | 1                  | (2)                   | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | \$ 361          | AUD 522           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 4               | CHF 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 272             | £ 206             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 14              | ¥ 2 189           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | 6 165           | PEN 21 109        | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | MYR 829         | \$ 200            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | PEN 21 109      | 6 144             | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | \$ 6 200        | SGD 7 873         | 0                  | (81)                  | (81)                                    | 0,00                |      |
|              | NSL               | 09/2026         | IDR 4 175 390     | \$ 235             | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00 |
|              |                   | 09/2026         | \$ 8              | IDR 150 506        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer |            | Devise<br>à recevoir |           | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|------------|----------------------|-----------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| RBC          | 09/2026              | \$                 | 1 615      | AUD                  | 2 300     | \$                    | 0                        | \$ (23)                                       | 0,00                   |
|              | 09/2026              | ZAR                | 11 612     | \$                   | 700       |                       | 0                        | (4)                                           | 0,00                   |
| RYL          | 08/2026              | HKD                | 886        |                      | 113       |                       | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
| SCX          | 07/2026              | CNH                | 99         |                      | 15        |                       | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | £                  | 25 289     |                      | 34 027    | 462                   | 0                        | 462                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | SGD                | 1          |                      | 1         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 0          | ¥                    | 12        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | HKD                | 23         | \$                   | 3         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | ¥                  | 12         |                      | 0         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$                 | 3 733      | HKD                  | 29 193    | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | AUD                | 3 500      | \$                   | 2 419     | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | CHF                | 1 584      |                      | 2 008     | 27                    | 0                        | 27                                            | 0,00                   |
|              | 09/2026              | CZK                | 8 509      |                      | 400       | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | €                  | 2 100      |                      | 2 438     | 29                    | 0                        | 29                                            | 0,00                   |
|              | 09/2026              | IDR                | 12 115 630 |                      | 674       | 4                     | (1)                      | 3                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | KZT                | 79 774     |                      | 158       | 0                     | (4)                      | (4)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | NZD                | 3 500      |                      | 1 990     | 0                     | (6)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | SGD                | 645        |                      | 500       | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | THB                | 31 015     |                      | 961       | 21                    | 0                        | 21                                            | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 15 183     | AUD                  | 21 400    | 0                     | (377)                    | (377)                                         | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 1 792      | CAD                  | 2 490     |                       | (31)                     | (31)                                          | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 7 722      | CHF                  | 6 034     | 4                     | (182)                    | (178)                                         | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 1 200      | CLP                  | 1 064 832 | 0                     | (44)                     | (44)                                          | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 400        | CZK                  | 8 328     | 0                     | (7)                      | (7)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 1 370      | €                    | 1 200     | 6                     | 0                        | 6                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 22         | IDR                  | 387 130   | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 351        | ¥                    | 55 809    | 0                     | (6)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 12 642     | NZD                  | 21 500    | 0                     | (381)                    | (381)                                         | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 700        | SGD                  | 894       | 0                     | (5)                      | (5)                                           | 0,00                   |
| SOG          | 11/2026              | NGN                | 40 438     | \$                   | 25        | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CNH                | 7 322      |                      | 1 082     | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 17 759     |                      | 20 716    | 412                   | 0                        | 412                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | £                  | 52         |                      | 68        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | PEN                | 122 562    |                      | 35 949    | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 118 089    | AUD                  | 171 143   | 479                   | 0                        | 479                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 10         | CHF                  | 8         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 20 659     | €                    | 18 162    | 105                   | 0                        | 105                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 52 495     | ¥                    | 8 339 727 | 0                     | (1 182)                  | (1 182)                                       | (0,01)                 |
|              | 07/2026              |                    | 36 191     | PEN                  | 122 562   | 0                     | (245)                    | (245)                                         | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 4 177      | SGD                  | 5 409     | 6                     | 0                        | 6                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | AUD                | 171 143    | \$                   | 118 013   | 0                     | (486)                    | (486)                                         | 0,00                   |
|              | 08/2026              | CHF                | 8          |                      | 10        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | €                  | 18 162     |                      | 20 687    | 0                     | (105)                    | (105)                                         | 0,00                   |
|              | 08/2026              | ¥                  | 886        |                      | 5         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | KZT                | 82 371     |                      | 168       | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | SGD                | 5 396      |                      | 4 177     | 0                     | (6)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$                 | 68         | £                    | 52        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | PEN                | 122 562    | \$                   | 36 068    | 234                   | 0                        | 234                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 1 450      | £                    | 1 100     | 10                    | 0                        | 10                                            | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 16 190     | ¥                    | 2 565 933 | 0                     | (305)                    | (305)                                         | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 700        | KRW                  | 1 066 552 | 0                     | (10)                     | (10)                                          | 0,00                   |
| SSB          | 09/2026              |                    | 600        | PHP                  | 37 054    | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CAD                | 14 723     | \$                   | 10 677    | 300                   | 0                        | 300                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CHF                | 938        |                      | 1 194     | 30                    | 0                        | 30                                            | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CNH                | 34         |                      | 5         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 1 999      |                      | 2 279     | 0                     | (6)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | SGD                | 39         |                      | 31        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 12 639     | BRL                  | 64 477    | 0                     | (182)                    | (182)                                         | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 189        | CAD                  | 267       | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 340 831    | £                    | 257 842   | 1 390                 | 0                        | 1 390                                         | 0,01                   |
|              | 08/2026              | CAD                | 267        | \$                   | 189       | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | £                  | 257 842    |                      | 340 823   | 0                     | (1 390)                  | (1 390)                                       | (0,01)                 |
|              | 08/2026              | \$                 | 838        | COP                  | 3 197 769 | 79                    | 0                        | 79                                            | 0,00                   |
|              | 08/2026              |                    | 2 282      | €                    | 1 999     | 6                     | 0                        | 6                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | CLP                | 550 406    | \$                   | 600       | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | CZK                | 6 265      |                      | 300       | 5                     | 0                        | 5                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | IDR                | 7 213 787  |                      | 400       | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | KRW                | 612 118    |                      | 400       | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 2 500      | BRL                  | 12 968    | 0                     | (40)                     | (40)                                          | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 1 700      | CLP                  | 1 507 569 | 0                     | (64)                     | (64)                                          | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 100        | HUF                  | 30 608    | 0                     | (2)                      | (2)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 100        | PLN                  | 364       | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
| UAG          | 09/2026              |                    | 100        | ZAR                  | 1 637     | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CNH                | 7          | \$                   | 1         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | HKD                | 49 189     |                      | 6 273     | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 1 287      | PLN                  | 4 702     | 0                     | (36)                     | (36)                                          | 0,00                   |
|              | 08/2026              | HKD                | 22         | \$                   | 3         | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | CLP                | 1 633 184  |                      | 1 835     | 63                    | 0                        | 63                                            | 0,00                   |
|              | 09/2026              | COP                | 84 253 218 |                      | 21 843    | 0                     | (2 172)                  | (2 172)                                       | (0,01)                 |
|              | 09/2026              | HUF                | 313 471    |                      | 1 000     | 0                     | (4)                      | (4)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | PEN                | 685        |                      | 200       | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 33 998     | MXN                  | 596 251   | 0                     | (91)                     | (91)                                          | 0,00                   |



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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |       | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|-------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| WST          | 12/2026           | COP             | 10 804 508 | \$                | 2 769 | \$ 0               | \$ (245)              | \$ (245)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 8 143      | CHF               | 6 575 | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 6 551      | \$                | 8 143 | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |            |                   |       | \$ 55 081          | \$ (32 743)           | \$ 22 338                               | 0,14                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation, Institutions en AUD (couverte) de distribution II et M Détail en AUD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir |           | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|-----------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 64 637    | \$                | 44 567    | \$ 0               | \$ (213)              | \$ (213)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 75 621    | AUD               | 106 180   | 0                  | (2 060)               | (2 060)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 46        | CAD               | 65        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 65        | \$                | 46        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | \$              | 44 539    | AUD               | 64 637    | 215                | 0                     | 215                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP             | 2 347     | \$                | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 183 334   |                   | 1 907     | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 13 125    |                   | 83        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 408 086   |                   | 273       | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 56        |                   | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 241       |                   | 26        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 77 165    |                   | 2 452     | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 728       | AUD               | 1 016     | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3         | CLP               | 2 347     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2         | CNY               | 14        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 111     | INR               | 199 256   | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 381     | KRW               | 6 763 735 | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 2 347     | \$                | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 199 816   |                   | 2 111     | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW             | 6 762 815 |                   | 4 381     | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
| BPS          | 08/2026           | \$              | 3         | MXN               | 56        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 379       | \$                | 56        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 128 893   |                   | 806       | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 622       |                   | 19        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | \$              | 5 132     | AUD               | 7 340     | 11                 | (58)                  | (47)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 73 823    | \$                | 2 348     | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 3 681     |                   | 2 591     | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 4 308     |                   | 245       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| BSH          | 08/2026           | \$              | 245       | MXN               | 4 308     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 68 646    | \$                | 47 681    | 124                | 0                     | 124                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 235 269   |                   | 1 480     | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 57 109    | AUD               | 80 134    | 0                  | (1 592)               | (1 592)                                 | (0,01)              |
| CBK          | 08/2026           |                 | 47 651    |                   | 68 646    | 0                  | (121)                 | (121)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 5 179     | \$                | 3 704     | 116                | 0                     | 116                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 347       |                   | 248       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP             | 2 347     |                   | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 707       |                   | 110       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 997 406   |                   | 56        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 8 987     |                   | 973       | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 4 045     | AUD               | 5 739     | 0                  | (69)                  | (69)                                    | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | CNY             | 2 905     | \$                | 428       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 1 446     |                   | 185       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 16 468    |                   | 174       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 598       |                   | 64        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 4 876     |                   | 154       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 7 761     | AUD               | 10 866    | 0                  | (233)                 | (233)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 693     | HKD               | 28 962    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 783     | TWD               | 88 691    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | HKD             | 28 927    | \$                | 3 693     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 88 819    |                   | 2 783     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 66 802    |                   | 46 388    | 108                | 0                     | 108                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 377       |                   | 56        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 3 284     |                   | 4 416     | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 2 049     |                   | 262       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 64 017    |                   | 403       | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 199 363   |                   | 131       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 37        |                   | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 498       |                   | 390       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 78 524    | AUD               | 110 076   | 0                  | (2 264)               | (2 264)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 3         | CLP               | 2 632     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 202       | CNH               | 1 373     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 850     | ¥                 | 1 270 055 | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 261       | MXN               | 4 584     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 551       | SEK               | 5 349     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 2 632     | \$                | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 1 370     |                   | 202       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 1 266 731 |                   | 7 850     | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 4 584     |                   | 260       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 5 340     |                   | 551       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 46 359    | AUD               | 66 802    | 0                  | (105)                 | (105)                                   | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | CLP             | 2 347             | \$ 3               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 565               | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 4 422             | CAD 6 292          | 13                    | 0                                       | 0,00                |
| IND          | 08/2026           | CAD             | 6 283             | \$ 4 422           | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AED             | 463               | 126                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 1 264             | 197                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 1 594             | 204                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2                 | CLP 2 062          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 274               | HKD 2 148          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 08/2026           | CLP             | 2 062             | \$ 2               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 112 320           | 78 568             | 753                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 3 654             | 723                | 17                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 137               | 185                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 215               | 72                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 3 319             | AUD 4 659          | 0                     | (91)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 712               | BRL 3 663          | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 171               | NOK 1 694          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 128               | PLN 481            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 3 691             | \$ 712             | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK             | 1 694             | 171                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN             | 481               | 128                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$              | 78 517            | AUD 112 320        | 0                     | (748)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD             | 72 517            | \$ 49 968          | 26                    | (298)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 8                 | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 2 449             | 3 124              | 87                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 983               | 1 142              | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 26 016            | 3 324              | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 458               | 163                | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 219 223           | 1 380              | 31                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 421             | 153                | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 482               | 132                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 27 572            | AUD 39 031         | 20                    | (551)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 390               | DKK 2 559          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 125               | € 107              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 55                | IDR 997 406        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 55                | NOK 546            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 336               | SEK 3 267          | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19                | THB 622            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 2 555             | \$ 390             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR             | 997 406           | 55                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK             | 546               | 55                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 3 261             | 336                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | THB             | 622               | 19                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 49 755            | AUD 72 296         | 302                   | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           |                 | 2                 | BRL 8              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 110               | \$ 148             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 38 831            | 243                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 514             | AUD 3 589          | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 576               | ZAR 9 472          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 9 497             | \$ 576             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | \$              | 2 940             | AUD 4 132          | 0                     | (78)                                    | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | CAD             | 192               | \$ 138             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 6 701             | 212                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | INR 17             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | ZAR             | 9 483             | \$ 579             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 495             | 1 722              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 616               | 91                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 1 328             | 207                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 9 179             | 10 707             | 213                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 570 853           | 3 593              | 81                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 16 732            | AUD 23 514         | 0                     | (441)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11 438            | € 10 055           | 58                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 278               | MXN 4 895          | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 385               | SGD 499            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 10 055            | \$ 11 453          | 0                     | (58)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 4 895             | 278                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 497               | 385                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | \$              | 1 721             | AUD 2 495          | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 5 929             | \$ 4 299           | 121                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 775 360         | 1 180              | 34                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 569               | 144                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 41                | CAD 58             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 668             | £ 3 531            | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 139               | MYR 568            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 57                | \$ 41              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 3 531             | 4 668              | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | MYR             | 568               | 139                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 329               | 111                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 4 379 349         | 2 896              | 69                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 5 076             | 292                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$              | 3 031             | CHF 2 447          | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 2 438             | \$ 3 031           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 863           | \$ (9 175)            | \$ (6 312)                              | (0,04)              |

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

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et M Détail en CHF (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | INR             | 70 102            | 729                | \$ 0                  | \$ (11)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 53 474            | 336                | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 188 404           | 121                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 26 612            | 846                | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 956               | 771                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 826               | INR 78 017         | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 816             | KRW 2 804 358      | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12                | MXN 219            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 36                | SGD 47             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 78 236            | \$ 826             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW             | 2 803 977         | 1 816              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 219               | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 46                | 36                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 103               | 74                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 3 836             | 4 466              | 82                    | (1)                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | £               | 56                | 74                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | ¥               | 124 673           | 784                | 17                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 62                | 48                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 165               | 5                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 759               | CHF 597            | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 12 994            | \$ 80              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 24 974            | 794                | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 42                | INR 3 960          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 61                | \$ 43              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 269               | 53                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 719               | 112                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 73                | 85                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 477 437           | 27                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 8 416             | 52                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 3 610             | 391                | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 342               | CHF 272            | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 8                 | \$ 3               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 08/2026           | INR             | 3 911             | 42                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 824               | 121                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 8 122             | 86                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 145               | 16                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 3 430             | 108                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 522             | HKD 11 934         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 28                | SGD 36             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 942               | TWD 30 026         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | 11 920            | \$ 1 522           | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 36                | 28                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 30 069            | 942                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 1 308             | 1 759              | 23                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 26 564            | 167                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 15                | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 184               | 144                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 32 307            | CHF 25 224         | 0                     | (1 036)                                 | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           |                 | 3 124             | ¥ 505 404          | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 107               | MXN 1 889          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 221               | SEK 2 149          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 91                | SGD 118            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 3 608             | \$ 220             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 504 081           | 3 124              | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 1 889             | 107                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 2 145             | 221                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 117               | 91                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 020             | 201                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 251               | BRL 1 294          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 754             | CAD 2 496          | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 1 304             | \$ 251             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 2 492             | 1 754              | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AED             | 166               | 45                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 447               | 70                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | HKD             | 653               | 83                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 215             | 867                | 26                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 5                 | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 89                | 62                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 277               | 355                | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 192               | 222                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 61                | 81                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 11 280            | 1 441              | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 202               | 72                 | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 279 396           | 1 757              | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 344               | 37                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 124               | 34                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 880               | AUD 1 276          | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 42 836            | CHF 33 645         | 12                    | (1 139)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 138               | DKK 904            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 658             | € 4 101            | 31                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 27                | IDR 477 437        | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$              | 48                | NOK 472            | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 135               | SEK 1 312          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | THB 165            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 1 276             | \$ 880             | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 903               | 138                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 4 101             | 4 664              | 0                     | (31)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR             | 477 437           | 26                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK             | 472               | 48                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 1 310             | 135                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | THB             | 165               | 5                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1                 | BRL 5              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 971               | \$ 10              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 170               | 5                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | ¥               | 12 943            | 81                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 148               | 41                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 494               | CHF 385            | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 219               | ZAR 3 604          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 257               | CHF 207            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 3 614             | \$ 219             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | TWD             | 9 993             | 316                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | \$              | 20                | SGD 25             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 25                | \$ 20              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 2 463             | 1 785              | 49                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 732 270           | 486                | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 225               | 57                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 37                | CAD 52             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 33 718            | CHF 26 536         | 4                     | (825)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 883             | £ 1 425            | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 55                | MYR 225            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 52                | \$ 37              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 1 425             | 1 883              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | MYR             | 225               | 55                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | CHF             | 404               | 508                | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 187               | 63                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 883 030         | 1 245              | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 2 093             | 120                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 72                | PLN 271            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN             | 271               | \$ 72              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 479             | \$ (3 129)            | \$ (2 650)                              | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Administrations en EUR (couverte) de distribution II, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, M Détail en EUR (couverte) de capitalisation et M Détail en EUR (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 1 790             | \$ 1 280           | \$ 40                 | \$ 40                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 129 928         | 749                | 20                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 164               | 97                 | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 153               | CAD 218            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 83                | NZD 147            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 218               | \$ 153             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 147               | 83                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | CLP             | 48 141            | 54                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 112 381           | 1 169              | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 324 131           | 2 038              | 43                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 185               | 11                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 165               | 18                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 538 232           | 17 102             | 209                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 52                | CLP 48 141         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8                 | CNY 52             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 743               | € 638              | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 533             | INR 616 802        | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 15 087            | KRW 23 294 240     | 0                     | (47)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 48 141            | 52                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 618 533           | 6 533              | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW             | 23 291 071        | 15 087             | 34                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 11                | MXN 185            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | THB             | 42 454            | \$ 1 309           | 31                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 301 172           | € 258 617          | 22                    | (5 517)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 493               | HUF 153 200        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HUF             | 153 416           | \$ 493             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | CNH             | 5 791             | 855                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 14 271            | 812                | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 238               | 141                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 514               | PHP 31 488         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PHP             | 31 488            | \$ 513             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 810               | MXN 14 271         | 4                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ¥               | 848 424           | \$ 5 336           | 116                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 223 764           | € 191 925          | 0                     | (4 336)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 144               | NZD 255            | 1                     | 0                                       | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| CBK          | 08/2026           | NZD 255         | \$ 144            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP 48 141      | 54                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 2 228       | 348               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 10 718 520  | 603               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SEK 29 299      | 3 171             | 144                | 0                     | 144                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 30 103       | € 25 810          | 0                  | (594)                 | (594)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY 10 549      | \$ 1 555          | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 56 582      | 7 231             | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 409         | 44                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12 304       | HKD 96 500        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 23              | INR 2 212         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16 881          | TWD 537 928       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 96 384      | \$ 12 304         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD 538 705     | 16 881            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 222 341       | 253 579           | 0                  | (623)                 | (623)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 11 933        | 16 047            | 209                | 0                     | 209                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 39 903      | 5 098             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 34 207        | 215               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 124         | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 1 501       | 1 177             | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 59           | CLP 53 987        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 851             | CNH 5 791         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 25 748          | ¥ 4 166 042       | 0                  | (115)                 | (115)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 864             | MXN 15 186        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | 1 797           | SEK 17 439        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP 53 987      | \$ 59             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 5 779       | 851               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 4 155 140     | 25 748            | 115                | 0                     | 115                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 15 186      | 862               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 17 408      | 1 797             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 253 921      | € 222 341         | 622                | 0                     | 622                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | CLP 48 141      | \$ 54             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 21 472      | 449               | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14 743       | CAD 20 979        | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | 17              | INR 1 638         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 20 949      | \$ 14 743         | 0                  | (44)                  | (44)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR 1 638       | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AED 2 106       | 573               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 3 984       | 622               | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 153 228     | 502               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 46           | CLP 42 294        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 168             | CZK 3 574         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP 42 294      | \$ 46             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK 3 574       | 168               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 7 746       | 5 522             | 156                | 0                     | 156                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 10 686      | 2 114             | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 081        | BRL 10 711        | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 117             | NOK 1 159         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 603             | PLN 2 262         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 10 793      | \$ 2 081          | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 1 159       | 117               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN 2 263       | 603               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 32          | 23                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 25          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | CHF 8 242       | 10 525            | 308                | 0                     | 308                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 266 549       | 302 826           | 51                 | (1 970)               | (1 919)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ILS 2 776       | 987               | 55                 | 0                     | 55                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 901 192       | 5 671             | 126                | 0                     | 126                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 45 556      | 30                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 972         | 105               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 2 266       | 623               | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 831        | AUD 4 103         | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 230           | DKK 8 063         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 23 564          | € 20 336          | 0                  | (313)                 | (313)                                   | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 596             | IDR 10 718 520    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 38              | NOK 374           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 094           | SEK 10 650        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 272           | THB 42 454        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 4 103       | \$ 2 829          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 8 049       | 1 230             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR 10 718 520  | 595               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 374         | 38                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 10 631      | 1 094             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | THB 42 454      | 1 273             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | \$ 5            | BRL 25            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 299 253         | € 263 116         | 1 971              | 0                     | 1 971                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | CZK 3 580       | \$ 172            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 426        | ZAR 23 438        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR 23 500      | \$ 1 426          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 1 435       | 1 041             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 508 271     | 5 265             | 0                  | (103)                 | (103)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 23 465      | 1 433             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | DKK 4 182       | \$ 651            | \$ 11              | \$ 0                  | \$ 11                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 261 648       | 297 624           | 0                  | (1 518)               | (1 518)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ¥ 2 058 603     | 12 958            | 292                | 0                     | 292                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 3           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 900        | AUD 2 753         | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | CHF 8             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 296 365         | € 254 055         | 0                  | (5 904)               | (5 904)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           | 0               | HUF 28            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 923             | MXN 16 215        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 161           | SGD 1 504         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 2 753       | \$ 1 899          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 8           | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HUF 28          | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 16 215      | 920               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 1 500       | 1 161             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 298 028      | € 261 648         | 1 515              | 0                     | 1 515                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD 20 131      | \$ 14 599         | 410                | 0                     | 410                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 844           | 962               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 5 669 904   | 3 777             | 116                | 0                     | 116                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 2 672       | 677               | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | \$ 135          | CAD 192           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15 774          | £ 11 933          | 64                 | 0                     | 64                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 652             | MYR 2 668         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 192         | \$ 135            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 11 933        | 15 774            | 0                  | (64)                  | (64)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | MYR 2 668       | 652               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 964          | € 844             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 16 443 420  | \$ 10 875         | 258                | 0                     | 258                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 16 817      | 968               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PHP 31 488      | 512               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 197       | CHF 8 233         | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 8 204       | \$ 10 197         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 7 342           | \$ (21 309)           | \$ (13 967)                             | (0,09)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de distribution et M Détail en GBP (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 314         | \$ 224            | \$ 7               | \$ 0                  | \$ 7                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 26           | CAD 37            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | 39 281          | £ 29 259          | 0                  | (447)                 | (447)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 37          | \$ 26             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP 724         | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 111 578     | 1 160             | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 38 854        | 244               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 35          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 81 268      | 2 582             | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1            | CLP 724           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 625           | £ 1 214           | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 179           | INR 111 272       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 552           | KRW 3 939 847     | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP 724         | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 08/2026           | INR 111 585     | 1 179             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW 3 939 311   | 2 552             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2            | MXN 35            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 103         | \$ 72             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 201         | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 33 563        | 44 283            | 9                  | (272)                 | (263)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 75 319        | 472               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 204         | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 6 845       | 217               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 52 876       | £ 39 444          | 1                  | (525)                 | (524)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 41 807          | 31 701            | 268                | 0                     | 268                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 495         | \$ 73             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 2 706       | 154               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD 91          | 71                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 769        | £ 1 339           | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 154             | MXN 2 706         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 155 398       | \$ 977            | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | CLP 724         | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 361         | 56                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 1 504 917   | 85                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 286         | 97                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | SEK 5 049       | 546               | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 058        | £ 2 272           | 0                  | (42)                  | (42)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY 1 551       | \$ 229            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 209         | 23                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | \$ 2 141        | HKD 16 794        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 951           | TWD 94 025        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 08/2026           | HKD             | 16 773            | \$ 2 141           | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 94 160            | 2 951              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 200               | 30                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 114               | 151                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 3 605             | 23                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 24                | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 259               | 203                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | CLP 812            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 180               | CNH 1 224          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 993             | £ 2 969            | 0                     | (52)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 501             | ¥ 728 224          | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 164               | MXN 2 879          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 310               | SEK 3 005          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 812               | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 1 222             | 180                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | ¥               | 726 318           | 4 501              | 20                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 2 879             | 163                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 3 000             | 310                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 151               | £ 114              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP             | 724               | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 514             | CAD 3 578          | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 3 573             | \$ 2 514           | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AED             | 297               | 81                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 646               | 101                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 499               | 64                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | CLP 636            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 636               | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 358             | 968                | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 852             | 366                | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 361               | BRL 1 857          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 47 165            | £ 35 149           | 0                     | (513)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 54                | NOK 530            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 60                | PLN 225            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 1 871             | \$ 361             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK             | 530               | 54                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN             | 225               | 60                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 6                 | 4                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 4                 | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 133               | 95                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 323             | 1 688              | 48                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 411               | 477                | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 16 292            | 2 082              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 278               | 99                 | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 128 964           | 812                | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 498               | 54                 | 3                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | PLN             | 225               | 62                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 678               | AUD 983            | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 199               | DKK 1 307          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 026             | € 3 545            | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 665             | £ 1 992            | 3                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 84                | IDR 1 504 917      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17                | NOK 171            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 189               | SEK 1 835          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6                 | THB 204            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 983               | \$ 678             | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 1 305             | 199                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 3 545             | 4 031              | 0                     | (27)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR             | 1 504 917         | 84                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK             | 171               | 17                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 1 832             | 189                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | THB             | 204               | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1                 | BRL 4              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 326             | £ 987              | 0                     | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 342               | ZAR 5 613          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 5 628             | \$ 342             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 7 044             | 9 270              | 0                     | (79)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 9 269             | £ 7 044            | 79                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 217               | \$ 157             | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 37 210            | 49 257             | 5                     | (135)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 2 153             | 68                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 013             | £ 758              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 0                 | INR 10             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 5 619             | \$ 343             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 48 928            | £ 36 967           | 136                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 327               | \$ 48              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | DKK             | 678               | 106                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 5 344             | 6 234              | 124                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 37 190            | 49 128             | 0                     | (232)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 326 174           | 2 053              | 46                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 3 811             | 121                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 550               | AUD 797            | 2                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SSB          | 07/2026           | \$ 2 514        | € 2 210           | \$ 13              | \$ 0                  | \$ 13                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 175             | MXN 3 074         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 270             | SGD 350           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 797         | \$ 550            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 2 210         | 2 518             | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 3 074       | 174               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 349         | 270               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 49 127       | £ 37 190          | 232                | 0                     | 232                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 3 328       | \$ 2 413          | 68                 | 0                     | 68                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 75            | 100               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 1 413 762   | 939               | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 352         | 89                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23           | CAD 33            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 86              | MYR 351           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 33          | \$ 23             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MYR 351         | 86                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 100          | £ 75              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 78          | \$ 98             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 2 525 166   | 1 670             | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 3 189       | 184               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$ 1 733        | CHF 1 399         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 1 394       | \$ 1 733          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 390           | \$ (2 472)            | \$ (1 082)                              | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en JPY (couverte) de distribution II et M Détail en JPY (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 604         | \$ 432            | \$ 13              | \$ 0                  | \$ 13                                   | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | \$ 51           | CAD 73            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 73          | \$ 51             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP 25 103      | 28                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 209 369     | 2 177             | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 54          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 191         | 21                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 79 958      | 2 541             | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 27           | CLP 25 103        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2               | CNY 14            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 212           | INR 208 795       | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 28 794          | ¥ 4 580 137       | 0                  | (612)                 | (612)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 892           | KRW 7 553 048     | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP 25 103      | \$ 27             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR 209 382     | 2 212             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW 7 552 021   | 4 892             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
| BPS          | 08/2026           | \$ 3            | MXN 54            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 410         | \$ 289            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 562         | 83                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 321           | 364               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 248 113       | 1 552             | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 29          | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 52 996       | ¥ 8 449 016       | 0                  | (1 010)               | (1 010)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | TWD 91 343      | \$ 2 905          | 43                 | 0                     | 43                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 938        | ¥ 312 990         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 14 174 007    | \$ 87 683         | 472                | 0                     | 472                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | MXN 4 180       | 238               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 87 683       | ¥ 14 136 847      | 0                  | (474)                 | (474)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | 237             | MXN 4 180         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 64 408          | ¥ 10 240 643      | 0                  | (1 399)               | (1 399)                                 | (0,01)              |
| CBK          | 07/2026           | CLP 25 103      | \$ 28             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | DKK 760         | 119               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 1 428 933   | 80                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 9 983       | 1 080             | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 170          | ¥ 27 426          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY 2 737       | \$ 403            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 32 968      | 4 213             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 475         | 51                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 204        | HKD 32 973        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 812           | TWD 89 619        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 32 934      | \$ 4 204          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | TWD 89 748      | 2 812             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 559         | 83                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 3 864         | 5 197             | 68                 | 0                     | 68                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 16 439 613    | 101 604           | 452                | 0                     | 452                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 36          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 545         | 427               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 31           | CLP 28 151        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 299             | CNH 2 034         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 366             | € 321             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 378           | ¥ 1 331 326       | 0                  | (187)                 | (187)                                   | 0,00                |



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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | \$              | 253               | MXN 4 448          | \$ 1                  | \$ 0                                    | \$ 1 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 612               | SEK 5 942          | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 08/2026           | CLP             | 28 151            | \$ 31              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | CNH             | 2 029             | 299                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | €               | 321               | 367                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | MXN             | 4 448             | 252                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | SEK             | 5 932             | 612                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 101 604           | ¥ 16 396 597       | 0                     | (455)                                   | (455) 0,00          |
|              | 07/2026           | CLP             | 25 103            | \$ 28              | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | TRY             | 763               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| IND          | 07/2026           | \$              | 4 917             | CAD 6 997          | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|              | 08/2026           | CAD             | 6 987             | \$ 4 917           | 0                     | (15)                                    | (15) 0,00           |
|              | 07/2026           | AED             | 749               | 204                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | DKK             | 1 359             | 212                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 24                | CLP 22 054         | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | CLP             | 22 054            | \$ 24              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 615             | 1 864              | 53                    | 0                                       | 53 0,00             |
|              | 07/2026           | BRL             | 4 103             | 811                | 19                    | 0                                       | 19 0,00             |
| MBC          | 07/2026           | ILS             | 178               | 60                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 799               | BRL 4 112          | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 136               | NOK 1 347          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 166               | PLN 624            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | BRL             | 4 144             | \$ 799             | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 08/2026           | NOK             | 1 348             | 136                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | PLN             | 624               | 166                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | AUD             | 11                | 8                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | BRL             | 9                 | 2                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CHF             | 2 755             | 3 507              | 94                    | (2)                                     | 92 0,00             |
|              | 07/2026           | €               | 418               | 484                | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 07/2026           | ILS             | 735               | 261                | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|              | 07/2026           | ¥               | 112 124           | 700                | 10                    | 0                                       | 10 0,00             |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 130             | 122                | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 07/2026           | PLN             | 625               | 172                | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 1 230             | AUD 1 783          | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 420               | DKK 2 750          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 79                | IDR 1 428 933      | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 84 886            | ¥ 13 500 103       | 0                     | (1 822)                                 | (1 822) (0,01)      |
|              | 07/2026           |                 | 44                | NOK 434            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| MYI          | 07/2026           |                 | 373               | SEK 3 629          | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1                 | THB 29             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | AUD             | 2 096             | \$ 1 445           | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 08/2026           | DKK             | 2 745             | 420                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | IDR             | 1 428 933         | 79                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | NOK             | 435               | 44                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | SEK             | 3 622             | 373                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | THB             | 29                | 1                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 2                 | BRL 9              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 202 274           | \$ 1 268           | 23                    | 0                                       | 23 0,00             |
|              | 07/2026           | KRW             | 531 601           | 351                | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 687               | ¥ 109 848          | 0                     | (11)                                    | (11) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 673               | ZAR 11 059         | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 08/2026           | ZAR             | 11 088            | \$ 673             | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 07/2026           | ¥               | 16 285 178        | 100 774            | 572                   | 0                                       | 572 0,01            |
| SCX          | 07/2026           | TWD             | 9 711             | 307                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | INR 19             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 2 389             | ¥ 382 932          | 0                     | (32)                                    | (32) 0,00           |
|              | 07/2026           | ZAR             | 11 072            | \$ 676             | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
| SOG          | 08/2026           | \$              | 99 372            | ¥ 16 020 491       | 0                     | (543)                                   | (543) 0,00          |
|              | 07/2026           | CNH             | 913               | \$ 135             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | DKK             | 1 426             | 222                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           | €               | 10 484            | 12 230             | 244                   | 0                                       | 244 0,00            |
| SSB          | 07/2026           | ¥               | 255 831           | 1 581              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 07/2026           | MXN             | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 998               | AUD 1 447          | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 12 400            | € 10 901           | 63                    | 0                                       | 63 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 49 928            | ¥ 7 932 006        | 0                     | (1 124)                                 | (1 124) (0,01)      |
|              | 07/2026           |                 | 270               | MXN 4 750          | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 421               | SGD 546            | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 08/2026           | AUD             | 1 447             | \$ 998             | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 08/2026           | €               | 10 901            | 12 417             | 0                     | (63)                                    | (63) 0,00           |
|              | 08/2026           | MXN             | 4 750             | 270                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | SGD             | 544               | 421                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 1 581             | ¥ 255 164          | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
|              | 07/2026           | CAD             | 6 782             | \$ 4 919           | 138                   | 0                                       | 138 0,00            |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 601 113         | 1 067              | 33                    | 0                                       | 33 0,00             |
|              | 07/2026           | MYR             | 512               | 130                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 45                | CAD 64             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 5 108             | £ 3 864            | 21                    | 0                                       | 21 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 7 278             | ¥ 1 169 361        | 0                     | (83)                                    | (83) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 125               | MYR 511            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | CAD             | 64                | \$ 45              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | £               | 3 864             | 5 108              | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
|              | 08/2026           | MYR             | 511               | 125                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| UAG          | 07/2026           | KRW             | 5 418 573         | \$ 3 584           | \$ 85                 | \$ 0                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 4 926             | 284                | 2                     | 0                                      | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$              | 3 409             | CHF 2 752          | 3                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 2 742             | \$ 3 409           | 0                     | (3)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 667           | \$ (7 961)            | \$ (5 294)                             | (0,03)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en RMB (couverte) de capitalisation, Institutions en RMB (couverte) de distribution et M Détail en RMB (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 392               | \$ 280             | \$ 9                  | \$ 0                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 34                | CAD 48             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 60 885            | CNH 411 189        | 0                     | (310)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 48                | \$ 34              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | CLP             | 1 467             | 2                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 138 311           | 1 438              | 0                     | (22)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 39 331            | 247                | 5                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 292 543           | 188                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 37                | 2                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 117               | 13                 | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 48 791            | 1 550              | 19                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2                 | CLP 1 467          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 501             | CNH 16 972         | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 461             | INR 137 932        | 0                     | (4)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 223             | KRW 4 975 731      | 0                     | (10)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 1 467             | \$ 2               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 138 319           | 1 461              | 4                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW             | 4 975 054         | 3 223              | 7                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 595               | CNH 4 033          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2                 | MXN 37             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CNY             | 92                | \$ 14              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 88                | 100                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 55 838            | 350                | 7                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 621               | 19                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 23 669            | CNH 160 174        | 0                     | (72)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 56 571            | \$ 1 799           | 26                    | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | CNH             | 1 559             | 230                | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 2 872             | 164                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 621             | CNH 10 980         | 0                     | (3)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 163               | MXN 2 872          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ¥               | 176 358           | \$ 1 109           | 24                    | 0                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 120               | 84                 | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP             | 1 467             | 2                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 519               | 81                 | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 90                | 121                | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 701 668           | 39                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 20 371            | 126                | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 6 193             | 670                | 30                    | 0                                      | 0,00                |
| CIB          | 07/2026           | \$              | 649               | CNH 4 397          | 0                     | (2)                                    | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | CNH             | 437 761           | \$ 64 369          | 12                    | (134)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 291               | 31                 | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 739             | CNY 18 586         | 0                     | (7)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 637             | HKD 20 684         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 969             | TWD 62 733         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | 20 660            | \$ 2 637           | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 62 823            | 1 969              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 62 031            | CNH 421 037        | 128                   | 0                                      | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 484 060           | \$ 71 169          | 0                     | (142)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 2 399             | 3 226              | 42                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 4 091             | 26                 | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 25                | 1                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 348               | 273                | 4                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2                 | CLP 1 645          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 16 620            | CNH 112 439        | 0                     | (55)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 101               | € 88               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 588             | ¥ 904 060          | 0                     | (25)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 174               | MXN 3 056          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 434               | SEK 4 215          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 1 645             | \$ 2               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 88                | 101                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 901 695           | 5 588              | 25                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 3 056             | 173                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 4 208             | 434                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 71 169            | CNH 482 995        | 136                   | 0                                      | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CLP             | 1 467             | \$ 2               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 3 234             | CAD 4 602          | 10                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 4 595             | \$ 3 234           | 0                     | (10)                                   | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | AED             | 361               | 98                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 927               | 145                | 3                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | CLP 1 289          | 0                     | 0                                      | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | \$              | 2 299             | CNH                | 15 571                | \$ 1                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CLP             | 1 289             | \$                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 696             |                    | 1 209                 | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 2 126             |                    | 420                   | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 169               |                    | 57                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 414               | BRL                | 2 130                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 482               | CNH                | 3 281                 | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 83                | NOK                | 825                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 139               | PLN                | 521                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 2 147             | \$                 | 414                   | 2                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | NOK             | 826               |                    | 83                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN             | 521               |                    | 139                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 7                 |                    | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 5                 |                    | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 678             |                    | 2 140                 | 61                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 7 004             |                    | 1 035                 | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 558               |                    | 648                   | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD             | 20 681            |                    | 2 642                 | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 361               |                    | 128                   | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 180 272           |                    | 1 134                 | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 692               |                    | 75                    | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 197               |                    | 54                    | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 889               |                    | 91                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 844               | AUD                | 1 223                 | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 897             | CNH                | 33 094                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 286               | DKK                | 1 877                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 39                | IDR                | 701 668               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 27                | NOK                | 266                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 264               | SEK                | 2 574                 | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19                | THB                | 621                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 1 223             | \$                 | 843                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 1 873             |                    | 286                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR             | 701 668           |                    | 39                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK             | 266               |                    | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 2 569             |                    | 264                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | THB             | 621               |                    | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1                 | BRL                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 5 596             | \$                 | 823                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 142               | CNH                | 967                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 453               | ZAR                | 7 439                 | 1                                       | 0,00                |
| RYL          | 08/2026           | ZAR             | 7 459             | \$                 | 453                   | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | \$              | 28 809            | CNH                | 194 522               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 206               | \$                 | 145                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 4 780             |                    | 151                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | INR                | 13                    | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | ZAR             | 7 448             | \$                 | 455                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 973               |                    | 152                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 641             |                    | 7 747                 | 154                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 427 912           |                    | 2 694                 | 61                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 1                 |                    | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 4 085             |                    | 130                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 685               | AUD                | 992                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 51 131            | CNH                | 345 891               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 190             | €                  | 7 200                 | 42                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 186               | MXN                | 3 264                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 269               | SGD                | 349                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 992               | \$                 | 684                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 7 200             |                    | 8 201                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN             | 3 264             |                    | 185                   | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | SGD             | 348               |                    | 269                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 4 524             |                    | 3 279                 | 90                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 267 966         |                    | 841                   | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 472               |                    | 120                   | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 5 113             |                    | 161                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 30                | CAD                | 42                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 289             | £                  | 2 489                 | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 115               | MYR                | 472                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 42                | \$                 | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 2 489             |                    | 3 289                 | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | MYR             | 472               |                    | 115                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 111               |                    | 140                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 741             |                    | 258                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 3 414 063         |                    | 2 258                 | 54                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 3 385             |                    | 195                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 325               |                    | 89                    | 2                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$              | 2 214             | CHF                | 1 787                 | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 1 781             | \$                 | 2 214                 | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 141           | \$ (1 231)            | \$ (90)                                 | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, Institutions en SGD (couverte) de distribution, Institutions en SGD (couverte) de distribution II, Administrations en SGD (couverte) de capitalisation, Administrations en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution II, M Détail en SGD (couverte) de capitalisation, M Détail en SGD (couverte) de distribution, M Détail en SGD (couverte) de distribution II, UA en SGD (couverte) de capitalisation, UA en SGD (couverte) de distribution II et UM Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | \$ 3 595          | \$ 2 571           | \$ 80                 | \$ 0                                    | \$ 80               | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 341               | CAD 485            | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 341 375           | SGD 435 301        | 0                     | (4 834)                                 | (4 834)             | (0,03) |
| BOA          | 08/2026           | CAD             | 484               | \$ 341             | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 815               | 1 010              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CLP             | 28 373            | 32                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | HKD             | 126 045           | 16 102             | 29                    | 0                                       | 29                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 93 818            | 590                | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 5 335 137         | 3 505              | 64                    | (4)                                     | 60                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 207             | 130                | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 371 928           | 287 359            | 0                     | (189)                                   | (189)               | 0,00   |
|              | 07/2026           | TWD             | 532 140           | 16 908             | 207                   | 0                                       | 207                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 31                | CLP 28 373         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 15 147            | INR 1 429 979      | 0                     | (45)                                    | (45)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 33 521            | KRW 51 757 068     | 0                     | (105)                                   | (105)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3                 | MXN 52             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 556 070           | SGD 710 092        | 0                     | (7 080)                                 | (7 080)             | (0,04) |
|              | 08/2026           | CLP             | 28 373            | \$ 31              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | INR             | 1 433 993         | 15 147             | 45                    | 0                                       | 45                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | KRW             | 51 750 029        | 33 521             | 75                    | 0                                       | 75                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | MXN             | 52                | 3                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | BPS               | 08/2026         | \$                | 287 359            | SGD 371 072           | 188                                     | 0                   | 188    |
| 07/2026      |                   | CNH             | 3 657             | \$ 540             | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   | €               | 1 442             | 1 636              | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
| 07/2026      |                   | £               | 4 129             | 5 519              | 42                    | (4)                                     | 38                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | ¥               | 695 966           | 4 348              | 66                    | 0                                       | 66                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | THB             | 7 256             | 224                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   | TWD             | 80 615            | 2 544              | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | \$              | 13                | CNY 86             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 12 457            | SGD 16 099         | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 1 312             | TWD 41 791         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
| 08/2026      |                   | CAD             | 1 566             | \$ 1 105           | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| 08/2026      |                   | HKD             | 92 504            | 11 809             | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
| 08/2026      |                   | TWD             | 538 531           | 17 126             | 251                   | 0                                       | 251                 | 0,00   |
| 07/2026      |                   | CAD             | 1 950             | 1 413              | 38                    | 0                                       | 38                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | KRW             | 1 541 583         | 1 020              | 24                    | 0                                       | 24                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | \$              | 1 146             | ¥ 185 266          | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 226               | MXN 3 975          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 88                | PHP 5 379          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| BRC          |                   | 07/2026         |                   | 78 334             | SGD 100 671           | 16                                      | (519)               | (503)  |
|              | 08/2026           | ¥               | 184 780           | \$ 1 146           | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | MXN             | 3 975             | 226                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | PHP             | 5 379             | 88                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 681 702         | 10 577             | 230                   | 0                                       | 230                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 285             | 908                | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | CLP             | 28 373            | 32                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | DKK             | 4 266             | 666                | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 9 872 194         | 555                | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 549             | 1 199              | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 64 236            | 6 952              | 315                   | 0                                       | 315                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 14 262            | 877                | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNY             | 17 294            | 2 549              | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 968 606           | 10 151             | 0                     | (78)                                    | (78)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 998             | 323                | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 494 674           | 382 401            | 0                     | (44)                                    | (44)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 346 362           | SGD 441 812        | 0                     | (4 786)                                 | (4 786)             | (0,03) |
|              | 07/2026           |                 | 20 776            | TWD 662 017        | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | DUB               | 08/2026         | TWD               | 662 973            | \$ 20 776             | 0                                       | (4)                 | (4)    |
| 08/2026      |                   | \$              | 382 401           | SGD 493 538        | 46                    | 0                                       | 46                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | CNH             | 3 638             | \$ 538             | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   | £               | 20 626            | 27 737             | 361                   | 0                                       | 361                 | 0,00   |
| 07/2026      |                   | HKD             | 88 315            | 11 283             | 22                    | 0                                       | 22                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | MXN             | 284               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   | SGD             | 461 654           | 355 968            | 0                     | (949)                                   | (949)               | (0,01) |
| 07/2026      |                   | \$              | 35                | CLP 31 819         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 1 946             | CNH 13 238         | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 1 644             | € 1 442            | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 57 190            | ¥ 9 253 367        | 0                     | (255)                                   | (255)               | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 1 978             | MXN 34 766         | 12                    | 0                                       | 12                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 3 949             | SEK 38 318         | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 589 618           | SGD 752 218        | 0                     | (8 060)                                 | (8 060)             | (0,05) |
| 07/2026      |                   | ZAR             | 47 937            | \$ 2 917           | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
| 08/2026      |                   | CLP             | 31 819            | 35                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| 08/2026      |                   | CNH             | 13 209            | 1 946              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
| 08/2026      |                   | €               | 1 442             | 1 647              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
| FAR          |                   | 08/2026         | ¥                 | 9 229 152          | 57 190                | 256                                     | 0                   | 256    |
|              | 08/2026           | MXN             | 34 766            | 1 972              | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | SEK             | 38 250            | 3 949              | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|--------|
| GLM          | 08/2026           | \$              | 355 968           | SGD                | 460 595               | \$ 951                                  | \$ 0                | \$ 951 | 0,01   |
|              | 07/2026           | CLP             | 28 373            | \$                 | 32                    | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              | 07/2026           | TRY             | 7 209             |                    | 152                   | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 32 811            | CAD                | 46 690                | 98                                      | 0                   | 98     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 40                | INR                | 3 797                 | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
| IND          | 08/2026           | CAD             | 46 624            | \$                 | 32 811                | 0                                       | (98)                | (98)   | 0,00   |
|              | 08/2026           | INR             | 3 797             |                    | 40                    | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | AED             | 3 605             |                    | 982                   | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | DKK             | 7 626             |                    | 1 191                 | 24                                      | 0                   | 24     | 0,00   |
|              | 07/2026           | TWD             | 43 915            |                    | 1 391                 | 12                                      | 0                   | 12     | 0,00   |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 27                | CLP                | 24 927                | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 08/2026           | CLP             | 24 927            | \$                 | 27                    | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 15 562            |                    | 11 094                | 313                                     | 0                   | 313    | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 24 300            |                    | 4 806                 | 112                                     | 0                   | 112    | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 1 009             |                    | 1 354                 | 15                                      | 0                   | 15     | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 126             |                    | 376                   | 0                                       | (2)                 | (2)    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 4 733             | BRL                | 24 356                | 0                                       | (27)                | (27)   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 858               | NOK                | 8 495                 | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 426             | PLN                | 5 356                 | 0                                       | (1)                 | (1)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | BRL             | 24 543            | \$                 | 4 733                 | 28                                      | 0                   | 28     | 0,00   |
| MBC          | 08/2026           | NOK             | 8 499             |                    | 858                   | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 08/2026           | PLN             | 5 356             |                    | 1 426                 | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 65                |                    | 46                    | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 56                |                    | 11                    | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 601             |                    | 1 146                 | 18                                      | 0                   | 18     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 16 622            |                    | 21 215                | 609                                     | 0                   | 609    | 0,01   |
|              | 07/2026           | €               | 7 991             |                    | 9 266                 | 130                                     | 0                   | 130    | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 2 401             |                    | 854                   | 48                                      | 0                   | 48     | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 567 005         |                    | 9 862                 | 220                                     | 0                   | 220    | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 88 672            |                    | 59                    | 2                                       | 0                   | 2      | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 7 125             |                    | 768                   | 48                                      | 0                   | 48     | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             | 2 106             |                    | 579                   | 19                                      | 0                   | 19     | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 141               |                    | 15                    | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 15 631            | AUD                | 22 653                | 63                                      | 0                   | 63     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 067             | DKK                | 20 101                | 8                                       | 0                   | 8      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 83 713            | €                  | 73 704                | 553                                     | 0                   | 553    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 549               | IDR                | 9 872 194             | 2                                       | 0                   | 2      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 276               | NOK                | 2 740                 | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 404             | SEK                | 23 400                | 14                                      | 0                   | 14     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 41 299            | SGD                | 52 935                | 0                                       | (374)               | (374)  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 217               | THB                | 7 256                 | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 22 653            | \$                 | 15 621                | 0                                       | (64)                | (64)   | 0,00   |
|              | 08/2026           | DKK             | 20 066            |                    | 3 067                 | 0                                       | (8)                 | (8)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 74 943            |                    | 85 240                | 0                                       | (556)               | (556)  | 0,00   |
|              | 08/2026           | IDR             | 9 872 194         |                    | 548                   | 0                                       | (1)                 | (1)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | NOK             | 2 741             |                    | 276                   | 0                                       | (1)                 | (1)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | SEK             | 23 358            |                    | 2 404                 | 0                                       | (14)                | (14)   | 0,00   |
|              | 08/2026           | THB             | 7 256             |                    | 218                   | 0                                       | (1)                 | (1)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 11                | BRL                | 56                    | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | DKK             | 6 012             | \$                 | 934                   | 14                                      | 0                   | 14     | 0,00   |
| MYI          | 07/2026           | ¥               | 227 305           |                    | 1 421                 | 23                                      | 0                   | 23     | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 8 582             | SGD                | 11 134                | 26                                      | 0                   | 26     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 781             | ZAR                | 62 128                | 10                                      | 0                   | 10     | 0,00   |
|              | 08/2026           | ZAR             | 62 291            | \$                 | 3 781                 | 0                                       | (10)                | (10)   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 92 400            |                    | 71 363                | 0                                       | (74)                | (74)   | 0,00   |
| NSL          | 08/2026           | \$              | 71 363            | SGD                | 92 186                | 73                                      | 0                   | 73     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 14 422            |                    | 18 659                | 4                                       | 0                   | 4      | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 147             | \$                 | 1 527                 | 40                                      | 0                   | 40     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 818             |                    | 1 286                 | 5                                       | 0                   | 5      | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 465 170           |                    | 4 823                 | 0                                       | (90)                | (90)   | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           | ¥               | 590 138           |                    | 3 714                 | 83                                      | 0                   | 83     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 5 941             |                    | 878                   | 3                                       | 0                   | 3      | 0,00   |
|              | 07/2026           | DKK             | 8 007             |                    | 1 247                 | 22                                      | 0                   | 22     | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 65 713            |                    | 76 657                | 1 528                                   | 0                   | 1 528  | 0,01   |
|              | 07/2026           | ¥               | 4 080 456         |                    | 25 685                | 578                                     | 0                   | 578    | 0,01   |
|              | 07/2026           | MXN             | 7                 |                    | 0                     | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 888 388           |                    | 686 012               | 0                                       | (823)               | (823)  | (0,01) |
|              | 07/2026           | TWD             | 47 533            |                    | 1 503                 | 11                                      | 0                   | 11     | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 13                | CAD                | 19                    | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 29 587            | SGD                | 38 035                | 0                                       | (181)               | (181)  | 0,00   |
| SSB          | 08/2026           |                 | 686 012           |                    | 886 391               | 861                                     | 0                   | 861    | 0,01   |
|              | 07/2026           | CAD             | 42 644            | \$                 | 30 926                | 869                                     | 0                   | 869    | 0,01   |
|              | 07/2026           | ¥               | 502 230           |                    | 3 144                 | 54                                      | 0                   | 54     | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 12 773 652        |                    | 8 475                 | 228                                     | 0                   | 228    | 0,00   |
|              | 07/2026           | MYR             | 3 928             |                    | 995                   | 33                                      | 0                   | 33     | 0,00   |
|              | 07/2026           | TWD             | 41 432            |                    | 1 300                 | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 301               | CAD                | 427                   | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 34 057            | £                  | 25 765                | 139                                     | 0                   | 139    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 959               | MYR                | 3 923                 | 2                                       | 0                   | 2      | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 427               | \$                 | 301                   | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 08/2026           | £               | 25 765            |                    | 34 057                | 0                                       | (139)               | (139)  | 0,00   |
|              | 08/2026           | MYR             | 3 922             |                    | 959                   | 0                                       | (2)                 | (2)    | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 869               |                    | 1 094                 | 17                                      | 0                   | 17     | 0,00   |
|              | UAG               |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |        |        |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| WST          | 07/2026           | KRW             | 32 005 956        | \$ 21 167          | \$ 502                | \$ 0                                    | \$ 502              | 0,00   |
|              | 07/2026           | MXN             | 38 502            | 2 216              | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | PHP             | 5 379             | 87                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             | 3 258             | 890                | 24                    | 0                                       | 24                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 12 803            | SGD 16 605         | 34                    | 0                                       | 34                  | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 14 310            | 18 470             | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 22 651            | CHF 18 288         | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | CHF             | 18 222            | \$ 22 651          | 0                     | (21)                                    | (21)                | 0,00   |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 11 029             | \$ (29 513)                             | \$ (18 484)         | (0,11) |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (33 669) (0,21)

## TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 5,500 % éch. 01/07/2056 (k)                                    | \$ 99 000                     | \$ (99 332)                | (0,61)              |
| 6,000 % éch. 01/07/2056 (k)                                    | 42 250                        | (43 197)                   | (0,26)              |
| 6,500 % éch. 01/08/2056 (k)                                    | 5 900                         | (6 096)                    | (0,04)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | \$ (148 625)               | (0,91)              |
| Total des Investissements                                      |                               | \$ 17 662 863              | 108,32              |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | \$ (1 356 574)             | (8,32)              |
| Actif net                                                      |                               | \$ 16 306 289              | 100,00              |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à rémunération en nature.
- (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (e) Titre à coupon zéro.
- (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (i) Affilié au Fonds.
- (j) Titre convertible conditionnel.
- (k) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.
- (l) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,29 %) :

| Description de l'émetteur                                      | Date d'achat            | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| Agnico Eagle Mines Ltd.                                        | 16/12/2025 - 09/06/2026 | \$ 23 300 | \$ 19 752    | 0,12                |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,520 % éch. 20/03/2028 | 20/02/2025              | 1 000     | 999          | 0,01                |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,740 % éch. 20/03/2030 | 20/02/2025              | 1 000     | 996          | 0,01                |
| Project Dorchester 4,610 % éch. 04/01/2027                     | 10/12/2025              | 1 048     | 1 029        | 0,01                |
| ZTO Express Cayman, Inc.                                       | 21/04/2026 - 12/05/2026 | 8 218     | 7 131        | 0,04                |
|                                                                |                         | \$ 34 566 | \$ 29 907    | 0,19                |

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 5 122 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 171 728 \$ (31 décembre 2025 : 33 530 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 62 570 \$ (31 décembre 2025 : 5 150 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

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

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur         |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 9 238 263                                                                      | \$ 7 026 393                                         | \$ 141 920                                        | \$ 16 406 576        |
| Fonds d'investissement                        | 1 236 860                                                                         | 0                                                    | 0                                                 | 1 236 860            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 178 300                                              | 0                                                 | 178 300              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 6 968                                                                             | (17 216)                                             | 0                                                 | (10 248)             |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (148 625)                                            | 0                                                 | (148 625)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 10 482 091</b>                                                              | <b>\$ 7 038 852</b>                                  | <b>\$ 141 920</b>                                 | <b>\$ 17 662 863</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 2 115 753                                                                      | \$ 3 771 091                                         | \$ 27 568                                         | \$ 5 914 412        |
| Fonds d'investissement                        | 445 044                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 445 044             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 64 000                                               | 0                                                 | 64 000              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 022                                                                             | 3 648                                                | 31                                                | 4 701               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 2 561 819</b>                                                               | <b>\$ 3 838 739</b>                                  | <b>\$ 27 599</b>                                  | <b>\$ 6 428 157</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (6 528)                                                 | \$ 6 830                | \$ 302                            | \$ 1 022                                                   | \$ (1 060)              | \$ (38)                           |
| BOA          | (7 300)                                                    | 7 750                   | 450                               | 401                                                        | (380)                   | 21                                |
| BPS          | 13 012                                                     | (14 710)                | (1 698)                           | (446)                                                      | 320                     | (126)                             |
| BRC          | 1 885                                                      | 660                     | 2 545                             | 3 374                                                      | (3 900)                 | (526)                             |
| BSH          | (6 773)                                                    | 7 170                   | 397                               | 934                                                        | (1 070)                 | (136)                             |
| CBK          | (2 022)                                                    | 1 950                   | (72)                              | (83)                                                       | 120                     | 37                                |
| CIB          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | S/O                                                        | 0                       | S/O                               |
| DUB          | (5 533)                                                    | 5 610                   | 77                                | (125)                                                      | 0                       | (125)                             |
| FAR          | (8 775)                                                    | 8 100                   | (675)                             | (2 911)                                                    | 2 860                   | (51)                              |
| GLM          | 1 127                                                      | (1 680)                 | (553)                             | (326)                                                      | 140                     | (186)                             |
| GST          | 3                                                          | (10)                    | (7)                               | 41                                                         | (60)                    | (19)                              |
| IND          | 68                                                         | 0                       | 68                                | (20)                                                       | 0                       | (20)                              |
| JPM          | 3 801                                                      | (4 450)                 | (649)                             | 53                                                         | 0                       | 53                                |
| MBC          | (1 655)                                                    | 1 760                   | 105                               | 2 250                                                      | (4 420)                 | (2 170)                           |
| MEI          | (4 395)                                                    | 7 370                   | 2 975                             | (307)                                                      | (970)                   | (1 277)                           |
| MYC          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 40                                                         | 0                       | 40                                |
| MYI          | (4 567)                                                    | 7 440                   | 2 873                             | 776                                                        | (5 180)                 | (4 404)                           |
| NSL          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 79                                                         | 0                       | 79                                |
| RBC          | (23)                                                       | 0                       | (23)                              | (18)                                                       | 0                       | (18)                              |
| RYL          | (191)                                                      | 300                     | 109                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SAL          | 7                                                          | 0                       | 7                                 | 14                                                         | 0                       | 14                                |
| SCX          | (565)                                                      | 670                     | 105                               | 74                                                         | (310)                   | (236)                             |
| SOG          | (5 492)                                                    | 5 380                   | (112)                             | (1 635)                                                    | 1 430                   | (205)                             |
| SSB          | 1 572                                                      | (1 390)                 | 182                               | 60                                                         | (170)                   | (110)                             |
| UAG          | (1 328)                                                    | 1 580                   | 252                               | (302)                                                      | 280                     | (22)                              |
| WST          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 618                                                        | 0                       | 618                               |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 53,58            | 48,74                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 26,79            | 27,15                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,45             | 0,73                 |
| Fonds d'investissement                                           | 6,09             | 5,77                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,88             | 0,83                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,12             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,11             | 0,12                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,42             | 0,29                 |
| Autres actifs                                                    | 11,56            | 16,35                |
| <b>Actif net</b>                                                 | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,42             | 0,26                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 5,64             | 4,34                 |
| Obligations et billets convertibles                                                                      | 0,00             | 0,00                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 15,62            | 20,06                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 3,35             | 3,18                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 4,41             | 4,20                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 10,09            | 10,59                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 3,22             | 2,70                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 55,77            | 55,26                |
| Droits                                                                                                   | 0,00             | S/O                  |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,67             | 0,36                 |
| Sociétés d'investissement immobilier                                                                     | 0,21             | 0,48                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 1,21             | 1,26                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 7,59             | 7,73                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 1,09             | 1,11                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,14             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,01)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,06             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,04)           | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options sur titres                                                                                       | 0,00             | S/O                  |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options plafonnées sur l'inflation                                                                       | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | (0,05)           | (0,03)               |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,14             | (0,18)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,30)           | 0,27                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (0,91)           | S/O                  |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (8,32)           | (11,61)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                   |                                     |                                  |                           | FINLANDE                                                |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 30/10/2029 (d)(f)(h) € 5 300 \$ 6 545 0,11 |                                     |                                  |                           |
| AUSTRALIE                                            |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                           |                                     |                                  |                           | Bank of Ireland Group PLC                               |                                     |                                  |                           |
| Commonwealth Bank of Australia                       |                                     |                                  |                           | Nordea Bank Abp                                         |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 10/03/2030 (d)(f) 19 000 22 967 0,40       |                                     |                                  |                           |
| 4,454 % éch. 21/05/2037 (f) € 5 600 \$ 6 561 0,11    |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/03/2029 (d)(f) \$ 16 200 \$ 15 277 0,27 |                                     |                                  |                           | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.          |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 6,300 % éch. 25/09/2031 (d)(f)(h) 10 100 10 193 0,18    |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 24/06/2033 \$ 5 000 5 013 0,09             |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Total Finlande 25 470 0,45                              |                                     |                                  |                           | Total Irlande 55 429 0,97                               |                                     |                                  |                           |
| AUTRICHE                                             |                                     |                                  |                           | FRANCE                                                  |                                     |                                  |                           | ITALIE                                                  |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                           |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                           |                                     |                                  |                           |
| Erste Group Bank AG                                  |                                     |                                  |                           | AXA S.A.                                                |                                     |                                  |                           | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                     |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/10/2027 (d)(f) 37 600 43 272 0,75    |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 02/06/2030 (d)(f) € 15 800 18 704 0,33     |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 02/10/2035 (h) € 6 000 7 047 0,12          |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/04/2033 (d)(f) 21 800 25 036 0,44    |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 7,708 % éch. 18/01/2028 7 208 8 749 0,15                |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 15/04/2031 (d)(f)(h) 21 600 26 856 0,47 |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 10,500 % éch. 23/07/2029 12 250 16 694 0,29             |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/10/2028 (d)(f) 30 200 37 703 0,66    |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Intesa Sanpaolo SpA                                     |                                     |                                  |                           |
| Total Autriche 132 867 2,32                          |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 4,198 % éch. 01/06/2032 \$ 3 930 3 711 0,07             |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/03/2028 (d)(f)(h) € 13 100 15 294 0,27  |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 01/09/2031 (d)(f) 13 550 16 242 0,28       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 20/05/2032 (d)(f) 7 825 9 806 0,17         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 11/01/2027 (d)(f) 32 200 37 684 0,66       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 8,248 % éch. 21/11/2033 \$ 9 700 11 215 0,20            |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 9,125 % éch. 07/09/2029 (d)(f) € 56 000 73 053 1,28     |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | UniCredit SpA                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 5,459 % éch. 30/06/2035 \$ 12 400 12 470 0,22           |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Total Italie 211 965 3,71                               |                                     |                                  |                           |
| BELGIQUE                                             |                                     |                                  |                           | JAPON                                                   |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                           |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| KBC Group NV                                         |                                     |                                  |                           | Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd.                        |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 17/09/2031 (d)(f) 37 200 44 776 0,78    |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 6,200 % éch. 16/01/2035 (d) 23 900 24 364 0,43          |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 05/09/2028 (d)(f) 43 000 53 105 0,93    |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| Total Belgique 97 881 1,71                           |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 5,188 % éch. 12/09/2036 1 800 1 788 0,03                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 8,200 % éch. 15/01/2029 (d)(f)(h) 21 550 23 292 0,41    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Nippon Life Insurance Co.                               |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 4,114 % éch. 23/01/2055 € 20 400 23 099 0,40            |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 30/04/2055 (h) \$ 47 200 49 531 0,87       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Nomura Holdings, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/07/2030 (d)(f) 12 400 12 758 0,22       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Norinchukin Bank                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 4,674 % éch. 09/09/2030 600 594 0,01                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 5,359 % éch. 09/09/2035 (h) 600 596 0,01                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 2,130 % éch. 08/07/2030 12 000 10 831 0,19              |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 15/01/2030 11 500 10 727 0,19              |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           | Total Japon 157 580 2,76                                |                                     |                                  |                           |
| BERMUDES                                             |                                     |                                  |                           | LUXEMBOURG                                              |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                           |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| Athora Holding Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | HLD Europe S.C.A.                                       |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 16/12/2037 12 300 14 269 0,25           |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 02/04/2030 € 6 971 8 048 0,14              |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| RLGH Finance Bermuda Ltd.                            |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 19/05/2032 (d)(f) \$ 17 200 17 218 0,30 |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
| Total Bermudes 31 487 0,55                           |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |

[illegible]

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045  | \$ 26 100                           | \$ 26 028                        | 0,46                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>     |                                     |                                  |                           | 3,717 % éch. 17/09/2026 (b)(c)                                                           | \$ 11 200                           | \$ 11 112                        | 0,19                      |
| Sempra<br>6,375 % éch. 01/04/2056                          | 10 750                              | 10 864                           | 0,19                      | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>      |                                     |                                  |                           | 3,722 % éch. 18/08/2026 (b)(c)                                                           | 35 400                              | 35 228                           | 0,62                      |
| Venture Global LNG, Inc.<br>9,000 % éch. 30/09/2029 (d)    | 17 500                              | 17 064                           | 0,30                      | 3,658 % éch. 20/08/2026 (b)(c)(i)    | \$ 1 400                            | \$ 1 393                         | 0,02                      | 3,722 % éch. 10/09/2026 (b)(c)                                                           | 8 400                               | 8 340                            | 0,15                      |
| Wells Fargo & Co.<br>2,879 % éch. 30/10/2030 (h)           | 17 200                              | 16 193                           | 0,28                      | 3,670 % éch. 15/09/2026 (b)(c)       | 6 600                               | 6 549                            | 0,11                      | 3,723 % éch. 10/09/2026 (b)(c)                                                           | 15 700                              | 15 587                           | 0,27                      |
| 3,900 % éch. 22/07/2032                                    | € 29 600                            | 34 505                           | 0,60                      | 3,671 % éch. 27/08/2026 (b)(c)       | 11 200                              | 11 135                           | 0,19                      | 3,728 % éch. 18/08/2026 (b)(c)                                                           | 123 300                             | 122 700                          | 2,15                      |
| 5,198 % éch. 23/01/2030                                    | \$ 22 900                           | 23 160                           | 0,41                      | 3,673 % éch. 04/08/2026 (a)(b)(c)(i) | 6 300                               | 6 278                            | 0,11                      | 3,730 % éch. 25/08/2026 (b)(c)(i)                                                        | 33 200                              | 33 015                           | 0,58                      |
| 5,211 % éch. 03/12/2035 (h)                                | 24 000                              | 23 967                           | 0,42                      | 3,676 % éch. 30/07/2026 (b)(c)(i)    | 1 200                               | 1 196                            | 0,02                      | 3,767 % éch. 24/09/2026 (b)(c)(i)                                                        | 7 200                               | 7 138                            | 0,13                      |
| 5,389 % éch. 24/04/2034                                    | 10 300                              | 10 460                           | 0,18                      | 3,677 % éch. 11/08/2026 (b)(c)       | 8 900                               | 8 863                            | 0,16                      | 3,779 % éch. 24/09/2026 (b)(c)(i)                                                        | 10 230                              | 10 142                           | 0,18                      |
| 6,303 % éch. 23/10/2029                                    | 9 900                               | 10 242                           | 0,18                      | 3,679 % éch. 11/08/2026 (b)(c)       | 45 200                              | 45 013                           | 0,79                      | 3,837 % éch. 20/10/2026 (b)(c)                                                           | 9 800                               | 9 686                            | 0,17                      |
|                                                            |                                     | 663 229                          | 11,60                     | 3,680 % éch. 21/07/2026 (b)(c)(i)    | 260                                 | 259                              | 0,00                      | <b>Total des Instruments à court terme</b>                                               |                                     | 473 537                          | 8,28                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                     |                                     |                                  |                           | 3,686 % éch. 28/07/2026 (b)(c)       | 4 900                               | 4 887                            | 0,09                      | <b>Total des Valeurs mobilières</b>                                                      | \$ 5 653 945                        | 98,89                            |                           |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>6,885 % éch. 26/04/2032      | € 15 500                            | 14 548                           | 0,25                      | 3,686 % éch. 06/08/2026 (b)(c)(i)    | 400                                 | 399                              | 0,01                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Virgin Media Bristol LLC<br>6,990 % éch. 31/01/2029        | \$ 375                              | 360                              | 0,01                      | 3,687 % éch. 28/07/2026 (b)(c)       | 27 600                              | 27 525                           | 0,48                      | <b>ACTIONS</b>                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     | 14 908                           | 0,26                      | 3,688 % éch. 08/09/2026 (b)(c)       | 7 000                               | 6 951                            | 0,12                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                     |                                     |                                  |                           | 3,693 % éch. 08/09/2026 (b)(c)       | 3 300                               | 3 277                            | 0,06                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligations du Trésor américain<br>4,875 % éch. 15/08/2045 | 1 088                               | 1 080                            | 0,02                      | 3,694 % éch. 28/07/2026 (b)(c)       | 6 170                               | 6 153                            | 0,11                      | PIMCO Select Funds plc -<br>Fonds PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating<br>NAV Fund (e) | 5 551                               | 55                               | 0,00                      |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035     | 1 720                               | 1 698                            | 0,03                      | 3,694 % éch. 25/08/2026 (b)(c)(i)    | 4 700                               | 4 674                            | 0,08                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     | 2 778                            | 0,05                      | 3,695 % éch. 13/08/2026 (a)(b)(c)(i) | 2 927                               | 2 914                            | 0,05                      | <b>Total des Fonds d'investissement</b>                                                  | \$ 55                               | 0,00                             |                           |
| Total États-Unis                                           |                                     | 680 915                          | 11,91                     | 3,695 % éch. 01/09/2026 (a)(b)(c)    | 3 700                               | 3 677                            | 0,06                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,696 % éch. 08/10/2026 (b)(c)       | 11 000                              | 10 888                           | 0,19                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,697 % éch. 11/08/2026 (b)(c)       | 7 600                               | 7 569                            | 0,13                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,697 % éch. 15/09/2026 (b)(c)       | 4 300                               | 4 267                            | 0,07                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,699 % éch. 01/10/2026 (a)(b)(c)    | 5 900                               | 5 844                            | 0,10                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,701 % éch. 24/09/2026 (b)(c)(i)    | 1 800                               | 1 784                            | 0,03                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,702 % éch. 11/08/2026 (b)(c)       | 6 000                               | 5 975                            | 0,10                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,704 % éch. 28/07/2026 (b)(c)       | 5 700                               | 5 685                            | 0,10                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,707 % éch. 08/09/2026 (b)(c)       | 8 400                               | 8 341                            | 0,15                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,709 % éch. 22/09/2026 (b)(c)       | 3 700                               | 3 669                            | 0,06                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 3,710 % éch. 08/09/2026 (b)(c)       | 22 300                              | 22 143                           | 0,39                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Long  | 09/2026              | 211                   | \$ 173                                  | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Long  | 09/2026              | 1 003                 | 439                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre       | Long  | 09/2026              | 5 536                 | 1 423                                   | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 793                   | (1 213)                                 | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 403                   | (1 075)                                 | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026              | 1 765                 | (305)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 3 075                 | (455)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 298                   | (36)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 10 821                | 9 026                                   | 0,16                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 169                   | 90                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 533                   | 589                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 301                   | 812                                     | 0,02                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 9 468                                | 0,17                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 9 468                                | 0,17                   |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Barclays PLC        | (1,000) %              | 20/06/2036         | € 60 000                            | \$ (182)                                | 0,00                   |
| HSBC Holdings PLC   | (1,000)                | 20/06/2030         | 43 500                              | (536)                                   | (0,01)                 |
|                     |                        |                    |                                     | \$ (718)                                | (0,01)                 |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Entité de référence      | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Deutsche Bank AG         | 1,000 %                 | 20/12/2031         | € 61 400                            | \$ 1 770                                | 0,03                   |
| Deutsche Bank AG         | 1,000                   | 20/12/2032         | 10 000                              | 118                                     | 0,00                   |
| Lloyds Banking Group PLC | 1,000                   | 20/06/2036         | 30 000                              | 71                                      | 0,00                   |
| NatWest Group PLC        | 1,000                   | 20/06/2036         | 30 000                              | 157                                     | 0,00                   |

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| UniCredit SpA       | 1,000 %              | 20/06/2033      | € 42 700                         | \$ (86)                           | 0,00                |
| Worldline S.A.      | 5,000                | 20/12/2030      | 24 000                           | (44)                              | 0,00                |
|                     |                      |                 |                                  | \$ 1 986                          | 0,03                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                 | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 10 ans | (1,000) %           | 20/12/2035      | \$ 39 300                        | \$ (2)                            | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans | (1,000)             | 20/06/2036      | 414 200                          | (1 770)                           | (0,03)              |
|                                 |                     |                 |                                  | \$ (1 772)                        | (0,03)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 206 220                       | \$ (98)                           | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                | 20/06/2031      | 1 033 050                        | 2 174                             | 0,04                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | € 314 200                        | 719                               | 0,01                |
|                                            |                      |                 |                                  | \$ 2 795                          | 0,05                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,750 %   | 15/09/2051      | £ 3 800           | \$ 1 949                          | 0,03                |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2028      | 529 600           | (727)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 16/09/2028      | 117 800           | 1 122                             | 0,02                |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      | 26 820            | (100)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 16/09/2031      | 73 400            | 106                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 171 600           | 3 913                             | 0,07                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500     | 18/03/2056      | 33 460            | 1 184                             | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 19/03/2035      | \$ 137 800        | (1 980)                           | (0,04)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2029      | 102 400           | 4 126                             | 0,07                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2034      | 17 300            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/06/2036      | 258 000           | 365                               | 0,01                |
|                                   |                                |           |                 |                   | \$ 9 959                          | 0,17                |
|                                   |                                |           |                 |                   | \$ 12 250                         | 0,21                |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

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

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

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

<sup>(4)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 2 455             | \$ 1 755           | \$ 55                 | \$ 55                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 321             | 492                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 22 332            | 13 189             | 485                   | 485                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 378               | CAD 537            | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 419            | NZD 18 444         | 73                    | 73                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 73                | SGD 93             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 537               | \$ 378             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 18 444            | 10 431             | 0                     | (73)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 417               | 80                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 286 305           | 188                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | NOK             | 8 560             | 865                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 36                | 29                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------|--------|
| BPS          | 07/2026           | \$              | 2 784             | CNH                | 18 826                | \$ 0                                    | \$ (11)             | 0,00    |        |
|              | 07/2026           |                 | 7 205             | £                  | 5 382                 | 0                                       | (62)                | 0,00    |        |
|              | 07/2026           |                 | 288               | ¥                  | 45 793                | 0                                       | (6)                 | 0,00    |        |
|              | 07/2026           |                 | 1 939             | NOK                | 18 013                | 0                                       | (119)               | 0,00    |        |
|              | 07/2026           |                 | 297               | PLN                | 1 120                 | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 5 876             | \$                 | 1 976                 | 2                                       | 0                   | 2       | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 6 489             |                    | 366                   | 0                                       | (3)                 | (3)     | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 257               | INR                | 24 464                | 0                                       | (1)                 | (1)     | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 8 690             | \$                 | 1 679                 | 5                                       | (5)                 | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 2 377             |                    | 3 022                 | 75                                      | 0                   | 75      | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 2 984             |                    | 441                   | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 1 716 670         |                    | 1 998 889             | 36 401                                  | (181)               | 36 220  | 0,63   |
|              | 07/2026           | £               | 7 016             |                    | 9 341                 | 51                                      | (22)                | 29      | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 321 656 349       |                    | 17 949                | 15                                      | (11)                | 4       | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 9 665             |                    | 3 279                 | 34                                      | 0                   | 34      | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 595 486           |                    | 6 200                 | 0                                       | (91)                | (91)    | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 427 608         |                    | 936                   | 14                                      | 0                   | 14      | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 975             |                    | 201                   | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 345             |                    | 1 814                 | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 83 774            |                    | 2 554                 | 34                                      | (4)                 | 30      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 848             | AUD                | 2 682                 | 10                                      | 0                   | 10      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 398               | BRL                | 2 009                 | 0                                       | (10)                | (10)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 42                | CNY                | 290                   | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 11 373            | £                  | 8 595                 | 35                                      | 0                   | 35      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 17 696            | INR                | 1 678 433             | 41                                      | (32)                | 9       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 189             | ¥                  | 192 200               | 0                                       | (6)                 | (6)     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 244             | KRW                | 6 509 765             | 0                                       | (38)                | (38)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 102             | \$                 | 370                   | 0                                       | (1)                 | (1)     | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 36 079 638        |                    | 1 987                 | 0                                       | (13)                | (13)    | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 3 261             |                    | 100                   | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 7 432             | IDR                | 129 978 737           | 0                                       | (227)               | (227)   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 395             | INR                | 132 547               | 0                                       | (4)                 | (4)     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 459               | THB                | 15 041                | 0                                       | (3)                 | (3)     | 0,00   |
| 12/2026      |                   | 1 267           | IDR               | 23 072 897         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00    |        |
| BRC          | 07/2026           | ILS             | 11 824            | \$                 | 3 995                 | 24                                      | 0                   | 24      | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 32 438            |                    | 19 183                | 731                                     | 0                   | 731     | 0,01   |
|              | 07/2026           | \$              | 19                | ZAR                | 302                   | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
| BSH          | 08/2026           | €               | 23                | CAD                | 38                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 388 794           | \$                 | 453 253               | 8 745                                   | 0                   | 8 745   | 0,15   |
|              | 07/2026           | \$              | 2 970             | ¥                  | 472 229               | 0                                       | (64)                | (64)    | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           |                 | 18 050            | NZD                | 31 947                | 123                                     | 0                   | 123     | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 31 947            | \$                 | 18 070                | 0                                       | (123)               | (123)   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 6 066             | BRL                | 31 114                | 0                                       | (144)               | (144)   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 51 855            | \$                 | 59 844                | 558                                     | 0                   | 558     | 0,01   |
| DUB          | 07/2026           | ILS             | 10 777            |                    | 3 710                 | 91                                      | 0                   | 91      | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 402 009           |                    | 4 261                 | 14                                      | 0                   | 14      | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 10 130            |                    | 1 092                 | 68                                      | 0                   | 68      | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 5 586             |                    | 605                   | 27                                      | 0                   | 27      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 57 969            | €                  | 49 736                | 0                                       | (1 107)             | (1 107) | (0,02) |
|              | 07/2026           |                 | 4 015             | £                  | 2 993                 | 0                                       | (43)                | (43)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 441             | IDR                | 61 734 760            | 5                                       | 0                   | 5       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 149             | INR                | 402 009               | 98                                      | 0                   | 98      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 464               | KRW                | 701 951               | 0                                       | (11)                | (11)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 513               | PLN                | 1 873                 | 0                                       | (14)                | (14)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 561               | TWD                | 17 745                | 0                                       | (4)                 | (4)     | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 13 171            | \$                 | 4 536                 | 111                                     | 0                   | 111     | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 910               | ILS                | 2 702                 | 0                                       | (2)                 | (2)     | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 132 109 417       | \$                 | 7 318                 | 0                                       | (5)                 | (5)     | 0,00   |
|              | 09/2026           | INR             | 40 562            |                    | 422                   | 0                                       | (4)                 | (4)     | 0,00   |
| 09/2026      | THB               | 90 139          |                   | 2 722              | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00    |        |
| 09/2026      | \$                | 2 387           | IDR               | 42 577 765         | 0                     | (27)                                    | (27)                | 0,00    |        |
| 09/2026      |                   | 1 249           | MXN               | 22 347             | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00    |        |
| 12/2026      |                   | 3 877           | IDR               | 70 487 554         | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00    |        |
| 07/2026      | IDR               | 8 276 069       | \$                | 463                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00    |        |
| 07/2026      | INR               | 160 939         |                   | 1 704              | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00    |        |
| 07/2026      | SGD               | 11              |                   | 8                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
| 07/2026      | \$                | 1 137           | INR               | 109 703            | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 543             | NOK               | 5 050              | 0                     | (33)                                    | (33)                | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 512             | PLN               | 1 900              | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 9               | ZAR               | 141                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
| 08/2026      |                   | 8               | SGD               | 11                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
| 09/2026      | IDR               | 80 957 550      | \$                | 4 493              | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00    |        |
| 09/2026      | \$                | 2 877           | IDR               | 52 248 755         | 19                    | 0                                       | 19                  | 0,00    |        |
| 09/2026      |                   | 1 704           | INR               | 162 030            | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00    |        |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 16 737            | \$                 | 2 474                 | 8                                       | 0                   | 8       | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 157 849           |                    | 1 673                 | 5                                       | 0                   | 5       | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 3 123 749         |                    | 19 306                | 86                                      | 0                   | 86      | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 64 914            |                    | 50 882                | 695                                     | 0                   | 695     | 0,01   |
|              | 07/2026           | \$              | 6 827             | CNH                | 46 437                | 14                                      | 0                   | 14      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 959 744         | €                  | 1 718 323             | 4 816                                   | 0                   | 4 816   | 0,09   |
|              | 07/2026           |                 | 9 447             | £                  | 7 141                 | 31                                      | 0                   | 31      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 654             | INR                | 157 849               | 13                                      | 0                   | 13      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 759             | ¥                  | 597 332               | 0                                       | (84)                | (84)    | 0,00   |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |             | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|-------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | \$              | 7 883      | PLN               | 28 826      | \$ 0               | \$ (214)              | \$ (214)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 343        | SEK               | 3 325       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 16         | ZAR               | 261         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 46 335     | \$                | 6 827       | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 1 718 323  |                   | 1 962 387   | 0                  | (4 805)               | (4 805)                                 | (0,08)              |
|              | 08/2026           | £               | 7 141      |                   | 9 447       | 0                  | (31)                  | (31)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 4 129      |                   | 1 442       | 55                 | 0                     | 55                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 3 319      |                   | 343         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 19 306     | ¥                 | 3 115 576   | 0                  | (86)                  | (86)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 808        | INR               | 77 450      | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 014      | MXN               | 17 904      | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 231 521    | \$                | 44 665      | 0                  | (65)                  | (65)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 322 811  |                   | 857         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 43 638     | BRL               | 234 423     | 1 683              | (30)                  | 1 653                                   | 0,03                |
|              | 07/2026           |                 | 36 347     | CAD               | 51 722      | 109                | 0                     | 109                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 316      | IDR               | 59 450 931  | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 857        | KRW               | 1 322 622   | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 51 648     | \$                | 36 347      | 0                  | (109)                 | (109)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 107      | INR               | 106 125     | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 59 799 082 | \$                | 3 316       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 8 048      |                   | 460         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 313 982    |                   | 9 716       | 206                | 0                     | 206                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 9 003      | IDR               | 162 036 354 | 27                 | (48)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 4 494      | INR               | 432 108     | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 355      | MXN               | 23 617      | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 44 665     | BRL               | 236 609     | 63                 | 0                     | 63                                      | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 10 626     | \$                | 7 575       | 214                | 0                     | 214                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 30 306     |                   | 10 150      | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 30 838     |                   | 327         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 408 756    |                   | 264         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 10 795     |                   | 1 091       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 565        |                   | 334         | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 422      | €                 | 5 538       | 0                  | (90)                  | (90)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 503        | IDR               | 9 035 365   | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 360      | ILS               | 6 635       | 0                  | (132)                 | (132)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 327        | INR               | 30 838      | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 396        | KRW               | 607 924     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 173      | NZD               | 2 080       | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 16 661     | PLN               | 60 730      | 1                  | (506)                 | (505)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 838      | THB               | 61 428      | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 20 243     | \$                | 6 936       | 135                | 0                     | 135                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 091      | NOK               | 10 799      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 9 393 978  | \$                | 520         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 15 939     |                   | 167         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 15 944     |                   | 904         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 186 623    |                   | 5 720       | 86                 | (19)                  | 67                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 473      | INR               | 235 784     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3 771      | MXN               | 65 849      | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
| MBC          | 12/2026           |                 | 44 132     |                   | 774 377     | 0                  | (410)                 | (410)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD             | 44         | \$                | 32          | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 23 866     |                   | 30 308      | 744                | (23)                  | 721                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 18 526     |                   | 21 295      | 114                | 0                     | 114                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 3 000      |                   | 4 040       | 58                 | 0                     | 58                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 817 850    |                   | 46          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 161 575    |                   | 1 711       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 4 928 010  |                   | 3 251       | 68                 | 0                     | 68                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 3 558      |                   | 359         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 477      | AUD               | 7 834       | 17                 | (66)                  | (49)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 38 820     | €                 | 33 476      | 0                  | (548)                 | (548)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 4 568      | £                 | 3 456       | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 638      | INR               | 254 277     | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 156      | ¥                 | 501 600     | 0                  | (70)                  | (70)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 294      | NOK               | 12 000      | 0                  | (81)                  | (81)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 616      | NZD               | 2 864       | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 209        | SEK               | 2 031       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 3 216      | \$                | 2 217       | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 447        |                   | 149         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 2 027      |                   | 209         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 130        | NOK               | 1 289       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 52 875     | \$                | 1 584       | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
| MYI          | 09/2026           | \$              | 7 102      | INR               | 679 402     | 33                 | (9)                   | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 100        | \$                | 123         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 56         |                   | 65          | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 126      |                   | 871         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 381        | €                 | 334         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 858        | £                 | 648         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 12         | SGD               | 15          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 086      | IDR               | 55 029 016  | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 668      | INR               | 256 640     | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 55 337 630 | \$                | 3 086       | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
| RYL          | 09/2026           | \$              | 1 461      | IDR               | 25 994 650  | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 12 361     | \$                | 14 405      | 273                | 0                     | 273                                     | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           |                 | 69         | CAD               | 111         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | £               | 618 030           | \$ 827 715         | \$ 7 436              | \$ 0                                    | 0,13                |
|              | 07/2026           | ¥               | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 99                | CNY 679            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 099             | £ 1 565            | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 168             | IDR 20 957 068     | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 511             | INR 336 521        | 41                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 751             | 263 597            | 22                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 0                 | ¥ 7                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 63 289 748        | \$ 3 506           | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 86 064            | 2 665              | 58                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4 198             | IDR 75 427 922     | 7                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 52                | € 32               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 42 218            | \$ 6 241           | 21                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 538               | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 800             | AUD 2 609          | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17                | CAD 23             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 725               | CHF 587            | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 418 084           | € 366 093          | 476                   | (5)                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 229 516           | £ 173 534          | 807                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 7 212             | ¥ 1 145 810        | 0                     | (162)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 51 894            | SGD 67 204         | 64                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 2 609             | \$ 1 799           | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 585               | 725                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 32                | CAD 52             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 365 881           | \$ 418 399         | 0                     | (473)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | £               | 173 534           | 229 509            | 0                     | (809)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 67 053            | 51 894             | 0                     | (66)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 3                 | ¥ 537              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 53 190            | \$ 38 573          | 1 082                 | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | CHF             | 816               | 1 038              | 26                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 334               | CAD 473            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 048             | ¥ 169 300          | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | CAD             | 473               | \$ 334             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 7 753             | 8 851              | 0                     | (25)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 8 754             | 7 535              | 0                     | (140)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 521               | PLN 1 905          | 0                     | (15)                                    | 0,00                |
| WST          | 09/2026           | MXN             | 6 777             | \$ 386             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 10 007            | 305                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 32 788            | CHF 26 473         | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 26 378            | \$ 32 788          | 0                     | (31)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 67 916          | \$ (11 889)           | \$ 56 027                               | 0,98                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation, Institutions en AUD (couverte) de distribution, Investisseurs en AUD (couverte) de distribution et Z en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 7 319             | \$ 5 047           | \$ 0                  | \$ (24)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 8 897             | AUD 12 494         | 0                     | (242)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 5 038             | 7 311              | 24                    | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 182               | 263                | 1                     | (1)                                     | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | AUD             | 7 575             | \$ 5 262           | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 7 028             | AUD 9 861          | 0                     | (196)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 5 259             | 7 575              | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 115               | \$ 81              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 141               | AUD 200            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 968               | 1 355              | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | AUD             | 7 383             | \$ 5 127           | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 9 220             | AUD 12 925         | 0                     | (266)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 5 123             | 7 383              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 12 477            | \$ 8 728           | 84                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 8 711             | AUD 12 461         | 0                     | (83)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 10 067            | \$ 6 937           | 1                     | (38)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | \$              | 1 818             | AUD 2 588          | 2                     | (27)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 6 789             | 9 861              | 39                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 442             | 3 544              | 13                    | 0                                       | 0,00                |
| MY1          | 07/2026           |                 | 256               | 360                | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | AUD             | 1 679             | \$ 1 159           | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 154             | AUD 3 027          | 0                     | (57)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 158             | 1 679              | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 197             | \$ (1 002)            | \$ (805)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en BRL (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 08/2026           | \$ 271          | BRL 1 421         | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL 701         | \$ 137            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 747        | BRL 13 953        | 1                  | (52)                  | (51)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 44              | 230               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | 12 388          | 62 595            | 0                  | (295)                 | (295)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | BRL 61 253      | \$ 11 819         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 11 819       | BRL 61 726        | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | BRL 65 124      | \$ 12 639         | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 176       | BRL 51 620        | 1                  | (204)                 | (203)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | 12 625          | 65 551            | 0                  | (59)                  | (59)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | BRL 68 030      | \$ 13 230         | 87                 | 0                     | 87                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 13 232       | BRL 66 939        | 0                  | (299)                 | (299)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 12 625          | 65 468            | 0                  | (75)                  | (75)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 0               | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 2           | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 162             | \$ (999)              | \$ (837)                                | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en CAD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD 669         | \$ 470            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 470          | CAD 668           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 827             | 1 143             | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 1               | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CAD 1 173       | \$ 824            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 824          | CAD 1 171         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | CAD 13          | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 12              | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 873          | CAD 1 205         | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 395         | \$ 279            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 871          | CAD 1 201         | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 279             | 395               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3               | \$ (72)               | \$ (69)                                 | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF 33          | \$ 41             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 24              | 30                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 45              | 56                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 35              | 44                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 50 873       | CHF 39 764        | 0                  | (1 577)               | (1 577)                                 | (0,03)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF 943         | \$ 1 185          | 17                 | (1)                   | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 55 786       | CHF 43 689        | 0                  | (1 626)               | (1 626)                                 | (0,03)              |
| MYI          | 08/2026           | CHF 168         | \$ 209            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | 42 820          | 52 928            | 0                  | (155)                 | (155)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 52 928       | CHF 42 666        | 156                | 0                     | 156                                     | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF 67          | \$ 82             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 54 803       | CHF 43 079        | 0                  | (1 398)               | (1 398)                                 | (0,02)              |
| UAG          | 07/2026           | CHF 117         | \$ 147            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 42 723          | 52 915            | 0                  | (48)                  | (48)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 52 915       | CHF 42 570        | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 227             | \$ (4 806)            | \$ (4 579)                              | (0,08)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution et T en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 669           | \$ 779            | \$ 14              | \$ 0                  | \$ 14                                   | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 973             | 1 105             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 706 907      | € 606 803         | 5                  | (13 154)              | (13 149)                                | (0,23)              |
| BSH          | 07/2026           | € 3 282         | \$ 3 817          | 65                 | 0                     | 65                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 661 756      | € 567 576         | 0                  | (12 847)              | (12 847)                                | (0,23)              |
| CBK          | 07/2026           | 10 710          | 9 183             | 0                  | (211)                 | (211)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 568 205       | \$ 648 036        | 0                  | (1 592)               | (1 592)                                 | (0,03)              |
|              | 08/2026           | \$ 648 910      | € 568 205         | 1 588              | 0                     | 1 588                                   | 0,03                |
| MBC          | 07/2026           | € 704 914       | \$ 802 856        | 1 465              | (4 537)               | (3 072)                                 | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 107 851      | € 93 656          | 0                  | (774)                 | (774)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 1 766         | \$ 2 017          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 688 213      | € 605 111         | 4 538              | 0                     | 4 538                                   | 0,08                |



## Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MYI          | 07/2026           | € 78            | \$ 90             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | 605 289         | 688 517           | 0                  | (3 511)               | (3 511)                                 | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$ 706 654      | € 605 770         | 0                  | (14 077)              | (14 077)                                | (0,25)              |
|              | 08/2026           | 689 451         | 605 289           | 3 503              | 0                     | 3 503                                   | 0,06                |
| SSB          | 07/2026           | 223             | 195               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 195           | \$ 223            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 11 179          | \$ (50 716)           | \$ (39 537)                             | (0,69)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution, M Détail en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 79 296       | £ 59 065          | \$ 0               | \$ (902)              | \$ (902)                                | (0,02)              |
| BOA          | 07/2026           | £ 61            | \$ 81             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 54 001          | 71 222            | 1                  | (452)                 | (451)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 88 250       | £ 65 861          | 4                  | (840)                 | (836)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 70 482          | 53 445            | 452                | 0                     | 452                                     | 0,01                |
| BRC          | 07/2026           | 106             | 80                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 325             | 242               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 359           | \$ 475            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 245        | £ 3 157           | 0                  | (55)                  | (55)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 475             | 359               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | £ 646           | \$ 867            | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 85 785       | £ 63 930          | 0                  | (934)                 | (934)                                   | (0,02)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 839           | \$ 1 127          | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 823        | £ 1 378           | 7                  | (1)                   | 6                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 54              | 40                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 12 306        | \$ 16 195         | 0                  | (138)                 | (138)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 16 194       | £ 12 306          | 138                | 0                     | 138                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 62 030        | \$ 82 104         | 1                  | (226)                 | (225)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 100          | £ 74              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 81 988          | 61 946            | 228                | 0                     | 228                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 62 086        | \$ 82 017         | 0                  | (387)                 | (387)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 82 014       | £ 62 086          | 388                | 0                     | 388                                     | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £ 911           | \$ 1 204          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 204        | £ 911             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 248           | \$ (3 948)            | \$ (2 700)                              | (0,05)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 64 706       | SGD 82 507        | \$ 0               | \$ (918)              | \$ (918)                                | (0,02)              |
| BOA          | 07/2026           | SGD 73 014      | \$ 56 412         | 0                  | (37)                  | (37)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 113 287      | SGD 144 670       | 0                  | (1 438)               | (1 438)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 56 412          | 72 846            | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD 843         | \$ 652            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 4 786           | 3 729             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 87 031          | 67 278            | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 76 930       | SGD 98 127        | 0                  | (1 065)               | (1 065)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 67 278          | 86 831            | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 88 815      | \$ 68 483         | 0                  | (183)                 | (183)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 137 396      | SGD 175 286       | 0                  | (1 878)               | (1 878)                                 | (0,03)              |
|              | 08/2026           | 68 483          | 88 612            | 183                | 0                     | 183                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SGD 4 413       | \$ 3 440          | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 221             | 170               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 17 761          | 13 717            | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 13 717       | SGD 17 720        | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
| RBC          | 07/2026           | 184             | 237               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 172 599     | \$ 133 281        | 0                  | (159)                 | (159)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 143          | SGD 184           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 133 281         | 172 211           | 167                | 0                     | 167                                     | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | SGD 1 471       | \$ 1 134          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 350          | SGD 452           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 467             | \$ (5 705)            | \$ (5 238)                              | (0,09)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 2 262 0,04

| DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC       |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 15/04/2030 <sup>(f)</sup>        | \$ 16 800                           | \$ 1 008                         | 0,02                      |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                    | 254 548                             | 89 728                           | 1,57                      |
| <b>Total des Autres actifs financiers</b>     |                                     | <b>\$ 90 736</b>                 | <b>1,59</b>               |
| <b>Total des Investissements</b>              |                                     | <b>\$ 5 768 716</b>              | <b>100,90</b>             |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b> |                                     | <b>\$ (51 434)</b>               | <b>(0,90)</b>             |
| <b>Actif net</b>                              |                                     | <b>\$ 5 717 282</b>              | <b>100,00</b>             |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.  
<sup>A</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.  
(a) Titre vendu avant l'émission.  
(b) Titre à coupon zéro.  
(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.  
(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.  
(e) Affilié au Fonds.  
(f) Titre convertible conditionnel.  
(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,08 %) :

| Description de l'émetteur     | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût             | Juste<br>valeur  | En % de<br>l'actif net |
|-------------------------------|---------|--------------------|-----------------|------------------|------------------|------------------------|
| Banco Nacional de Mexico S.A. | 6,697 % | 07/08/2036         | 30/04/2026      | \$ 20 500        | \$ 20 216        | 0,35                   |
| RBC International             | 4,660   | 16/12/2028         | 18/11/2025      | 5 000            | 4 918            | 0,09                   |
|                               |         |                    |                 | <b>\$ 25 500</b> | <b>\$ 25 134</b> | <b>0,44</b>            |

- (h) Des titres d'une juste valeur globale de 249 446 \$ (31 décembre 2025 : 274 132 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.  
(i) Des titres d'une juste valeur globale de 5 528 \$ (31 décembre 2025 : 35 184 \$) et un montant en numéraire de 26 484 \$ (31 décembre 2025 : 590 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 341 \$ (31 décembre 2025 : 365 \$) et un montant en numéraire de 340 \$ (31 décembre 2025 : 737 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 158 479 \$ (31 décembre 2025 : 108 374 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 5 649 027                                               | \$ 4 918                                                | \$ 5 653 945        |
| Fonds d'investissement                        | 55                                                                                         | 0                                                          | 0                                                       | 55                  |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 253                                                                                        | 23 727                                                     | 0                                                       | 23 980              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 90 736                                                     | 0                                                       | 90 736              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 308</b>                                                                              | <b>\$ 5 763 490</b>                                        | <b>\$ 4 918</b>                                         | <b>\$ 5 768 716</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 73 485                                                                                  | \$ 5 901 189                                               | \$ 4 996                                                | \$ 5 979 670        |
| Fonds d'investissement                        | 54                                                                                         | 0                                                          | 0                                                       | 54                  |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 269                                                                                      | (10 885)                                                   | 0                                                       | (9 616)             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 75 092                                                     | 1 008                                                   | 76 100              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 74 808</b>                                                                           | <b>\$ 5 965 396</b>                                        | <b>\$ 6 004</b>                                         | <b>\$ 6 046 208</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                    | 3,250 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (3 934)       | \$ (3 937)                               | (0,07)              |
|                                        | 4,010          | 11/06/2026        | 10/09/2026         | (6 741)          | (6 756)                                  | (0,12 )             |
|                                        | 4,060          | 11/06/2026        | 10/09/2026         | (30 831)         | (30 899)                                 | (0,54 )             |
| BRC                                    | 1,250          | 08/01/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 160)          | (4 186)                                  | (0,07 )             |
|                                        | 1,850          | 16/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (2 925)        | (3 344)                                  | (0,06 )             |
|                                        | 2,500          | 13/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | £ (1 440)        | (1 926)                                  | (0,03 )             |
|                                        | 2,650          | 01/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (6 119)          | (8 139)                                  | (0,14 )             |
|                                        | 3,150          | 04/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (23 217)      | (23 515)                                 | (0,41 )             |
|                                        | 3,150          | 22/06/2026        | 31/07/2026         | (1 395)          | (1 396)                                  | (0,02 )             |
|                                        | 3,350          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (21 624)         | (22 028)                                 | (0,39 )             |
| BYR                                    | 3,960          | 01/06/2026        | 01/09/2026         | (21 680)         | (21 751)                                 | (0,38 )             |
| CDC                                    | 4,060          | 13/05/2026        | 09/09/2026         | (30 432)         | (30 598)                                 | (0,54 )             |
|                                        | 4,060          | 22/06/2026        | 20/10/2026         | (10 021)         | (10 031)                                 | (0,18 )             |
| IND                                    | 3,930          | 15/06/2026        | 15/09/2026         | (577)            | (578)                                    | (0,01 )             |
|                                        | 4,030          | 04/06/2026        | 04/09/2026         | (2 272)          | (2 279)                                  | (0,04 )             |
|                                        | 4,090          | 08/04/2026        | 08/07/2026         | (33 185)         | (33 502)                                 | (0,59 )             |
| JML                                    | 1,050          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (2 946)        | (3 369)                                  | (0,06 )             |
|                                        | 1,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (437)            | (500)                                    | (0,01 )             |
|                                        | 3,300          | 06/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (4 634)       | (4 684)                                  | (0,08 )             |
| MBC                                    | 2,370          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (7 542)        | (8 630)                                  | (0,15 )             |
| MYI                                    | 1,050          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 367)          | (3 851)                                  | (0,07 )             |
|                                        | 1,400          | 01/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (4 563)       | (4 579)                                  | (0,08 )             |
| RCE                                    | 1,950          | 26/01/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (602)            | (607)                                    | (0,01 )             |
| SOG                                    | 4,110          | 08/04/2026        | 08/07/2026         | (6 483)          | (6 545)                                  | (0,11 )             |
|                                        | 4,110          | 16/04/2026        | 16/07/2026         | (744)            | (750)                                    | (0,01 )             |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                    |                  | \$ (238 380)                             | (4,17 )             |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (1 521)                                                 | \$ 1 803                | \$ 282                            | \$ 2 345                                                   | \$ (2 599)              | \$ (254)                          |
| BOA          | (1 619)                                                    | 1 812                   | 193                               | (16 722)                                                   | 17 936                  | 1 214                             |
| BPS          | 22 015                                                     | (23 280)                | (1 265)                           | 145                                                        | 0                       | 145                               |
| BRC          | 784                                                        | (959)                   | (175)                             | 5 989                                                      | (6 560)                 | (571)                             |
| BSH          | (4 735)                                                    | 5 010                   | 275                               | 430                                                        | (240)                   | 190                               |
| CBK          | (442)                                                      | 381                     | (61)                              | (598)                                                      | 900                     | 302                               |
| DUB          | (1 089)                                                    | 1 300                   | 211                               | 92                                                         | 0                       | 92                                |
| FAR          | (1 706)                                                    | 1 940                   | 234                               | 628                                                        | (580)                   | 48                                |
| GLM          | 1 684                                                      | (1 850)                 | (166)                             | 958                                                        | (960)                   | (2)                               |
| JPM          | (3 530)                                                    | 3 570                   | 40                                | (234)                                                      | 590                     | 356                               |
| MBC          | (608)                                                      | 697                     | 89                                | (15 122)                                                   | 16 348                  | 1 226                             |
| MYI          | 14                                                         | 13                      | 27                                | 868                                                        | (1 210)                 | (342)                             |
| NSL          | 32                                                         | 0                       | 32                                | 69                                                         | 0                       | 69                                |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| RYL          | 266                                                        | (330)                   | (64)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 7 519                                                      | (9 270)                 | (1 751)                           | 55                                                         | 0                       | 55                                |
| SOG          | (14 304)                                                   | 14 660                  | 356                               | 13 994                                                     | (14 760)                | (766)                             |
| SSB          | (345)                                                      | 544                     | 199                               | 171                                                        | 0                       | 171                               |
| UAG          | (153)                                                      | 282                     | 129                               | (20)                                                       | 0                       | (20)                              |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 140                                                        | 0                       | 140                               |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 79,10            | 83,43                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 12,55            | 9,60                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,20             | 0,05                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,29             | 0,11                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,32             | 0,70                 |
| Autres actifs financiers                                         | 1,47             | 1,18                 |
| Autres actifs                                                    | 5,07             | 4,93                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                                | 0,11             | S/O                  |
| Autriche                                                                                                 | 2,32             | 1,70                 |
| Belgique                                                                                                 | 1,71             | 1,70                 |
| Bermudes                                                                                                 | 0,55             | 0,29                 |
| Canada                                                                                                   | 4,02             | 4,44                 |
| Îles Caïmans                                                                                             | 0,00             | S/O                  |
| Danemark                                                                                                 | 0,40             | 0,22                 |
| Finlande                                                                                                 | 0,45             | 0,48                 |
| France                                                                                                   | 11,56            | 10,72                |
| Allemagne                                                                                                | 5,11             | 5,04                 |
| Irlande                                                                                                  | 0,97             | 0,56                 |
| Italie                                                                                                   | 3,71             | 5,69                 |
| Japon                                                                                                    | 2,76             | 2,92                 |
| Luxembourg                                                                                               | 0,14             | S/O                  |
| Mexique                                                                                                  | 0,76             | 0,40                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 9,71             | 9,87                 |
| Norvège                                                                                                  | 0,50             | 0,51                 |
| Pologne                                                                                                  | 0,21             | 0,21                 |
| Portugal                                                                                                 | 0,27             | 0,27                 |
| Slovénie                                                                                                 | 0,52             | 0,54                 |
| Espagne                                                                                                  | 7,66             | 7,77                 |
| Supranationales                                                                                          | 0,48             | 0,47                 |
| Suède                                                                                                    | 0,86             | 0,95                 |
| Suisse                                                                                                   | 4,25             | 3,59                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 19,67            | 19,77                |
| États-Unis                                                                                               | 11,91            | 10,11                |
| Instruments à court terme                                                                                | 8,28             | 12,46                |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,17             | (0,04)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03             | 0,05                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,03)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,05             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,17             | (0,05)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,98             | (0,81)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,94)           | 0,70                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 1,59             | 1,28                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (0,90)           | (1,80)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                 | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------|------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                   |                                     |                                  |                           | BRESIL                                 |                                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES         |                                                                        |                                  |                           |      |
| AUSTRALIE                                            |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                                     |                                  |                           | Kuntarahoitus Oyj             |                                                                        |                                  |                           |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                           |                                     |                                  |                           | Banco do Brasil S.A.                   |                                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 14/06/2032       |                                                                        |                                  |                           |      |
| Plenti PL & Green ABS Trust                          |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 23/10/2031                | \$ 500                                              | \$ 496                           | 0,12                      | Total Finlande                | € 700                                                                  | \$ 787                           | 0,20                      |      |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                              | AUD                                 | 372                              | \$ 258                    | 0,07                                   | Sabesp Lux SARL                                     |                                  |                           |                               |                                                                        | 3 676                            | 0,91                      |      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 20/08/2030                | 400                                                 | 394                              | 0,10                      |                               |                                                                        |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           |                                        |                                                     | 890                              | 0,22                      | FRANCE                        |                                                                        |                                  |                           |      |
| Commonwealth Bank of Australia                       |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                  |                                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                                                        |                                  |                           |      |
| 4,266 % éch. 04/06/2034                              | €                                   | 700                              | 818                       | 0,20                                   | ARGAN S.A.                                          |                                  |                           |                               | 3,779 % éch. 30/10/2029                                                |                                  |                           |      |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 0,46                                   | Obligation internationale du gouvernement brésilien |                                  |                           |                               | Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.                                |                                  |                           |      |
| 4,250 % éch. 03/05/2030                              |                                     | 1 590                            | 1 869                     | 0,46                                   | 5,500 % éch. 04/02/2033                             | 400                              | 395                       | 0,10                          | 0,250 % éch. 29/06/2028                                                | 100                              | 109                       | 0,03 |
| GPT Wholesale Office Fund                            |                                     |                                  |                           | 0,08                                   | Total Brésil                                        |                                  | 1 285                     | 0,32                          | 3,500 % éch. 07/07/2033 (a)                                            | 900                              | 1 023                     | 0,25 |
| 3,222 % éch. 05/11/2031                              | AUD                                 | 500                              | 309                       | 0,08                                   | CANADA                                              |                                  |                           |                               | BNP Paribas S.A.                                                       |                                  |                           |      |
| ICPF Finance Pty. Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 0,09                                   | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                  |                           |                               | 3,494 % éch. 17/09/2033                                                |                                  |                           |      |
| 6,573 % éch. 07/11/2033                              |                                     | 500                              | 357                       | 0,09                                   | Royal Bank of Canada                                |                                  |                           |                               | 3,739 % éch. 20/04/2034                                                |                                  |                           |      |
| Lendlease Finance Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 0,15                                   | 3,375 % éch. 15/06/2030                             | € 2 300                          | 2 641                     | 0,65                          | 4,250 % éch. 13/04/2031                                                | 1 600                            | 1 886                     | 0,46 |
| 3,400 % éch. 27/10/2027                              |                                     | 930                              | 626                       | 0,03                                   | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                  |                           |                               | 5,786 % éch. 13/01/2033                                                |                                  |                           |      |
| 3,700 % éch. 31/03/2031                              |                                     | 200                              | 123                       | 0,03                                   | Obligation internationale du gouvernement canadien  |                                  |                           |                               | 7,375 % éch. 10/09/2034 (b)(c)                                         |                                  |                           |      |
| Mirvac Group Finance Ltd.                            |                                     |                                  |                           | 0,08                                   | 2,250 % éch. 01/12/2029                             | CAD 9 100                        | 6 281                     | 1,55                          | BPCE Assurances S.A.                                                   |                                  |                           |      |
| 5,150 % éch. 18/03/2031                              |                                     | 500                              | 340                       | 0,08                                   | 3,500 % éch. 01/03/2034                             | 1 600                            | 1 150                     | 0,28                          | 4,125 % éch. 22/10/2035                                                | € 1 100                          | 1 263                     | 0,31 |
| Mwof Finance Co. Pty. Ltd.                           |                                     |                                  |                           | 0,18                                   | Ontario Teachers' Finance Trust                     | € 1 450                          | 1 647                     | 0,41                          | Carmila S.A.                                                           |                                  |                           |      |
| 6,317 % éch. 06/05/2033                              |                                     | 1 000                            | 713                       | 0,18                                   | 2,850 % éch. 04/12/2031                             | € 1 450                          | 1 647                     | 0,41                          | 3,750 % éch. 13/01/2033                                                | 100                              | 113                       | 0,03 |
| NBN Co. Ltd.                                         |                                     |                                  |                           | 0,08                                   | Province de l'Ontario                               |                                  |                           |                               | CNP Assurances S.A.                                                    |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 22/03/2030                              | €                                   | 300                              | 347                       | 0,08                                   | 4,100 % éch. 04/03/2033                             | CAD 800                          | 588                       | 0,14                          | 4,875 % éch. 07/10/2030 (b)(c)                                         | \$ 800                           | 753                       | 0,19 |
| 4,250 % éch. 01/10/2029                              | \$                                  | 600                              | 594                       | 0,15                                   |                                                     |                                  |                           |                               | Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                                     |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 28/08/2031                              | AUD                                 | 2 200                            | 1 511                     | 0,37                                   |                                                     |                                  | 9 666                     | 2,38                          | 2,875 % éch. 12/01/2034                                                | € 300                            | 336                       | 0,08 |
|                                                      |                                     |                                  | 7 607                     | 1,87                                   |                                                     |                                  | 12 307                    | 3,03                          | Crédit Agricole S.A.                                                   |                                  |                           |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                     |                                  |                           | Total Canada                           |                                                     |                                  |                           |                               | 3,250 % éch. 25/08/2032                                                | 1 100                            | 1 242                     | 0,31 |
| Obligation internationale du gouvernement australien |                                     |                                  |                           | CHILI                                  |                                                     |                                  |                           |                               | 3,500 % éch. 26/09/2034                                                | 1 700                            | 1 917                     | 0,47 |
| 4,250 % éch. 21/06/2034                              | 8 100                               | 5 475                            | 1,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                                     |                                  |                           |                               | 3,750 % éch. 23/01/2031                                                | 800                              | 927                       | 0,23 |
| 5,000 % éch. 21/06/2036                              | 1 600                               | 1 131                            | 0,28                      | Sociedad Transmisora Metropolitana SpA |                                                     |                                  |                           |                               | 3,875 % éch. 16/02/2038                                                | 400                              | 453                       | 0,11 |
| New South Wales Treasury Corp.                       |                                     |                                  |                           | 0,08                                   | 6,385 % éch. 15/12/2055                             | \$ 600                           | 613                       | 0,15                          | 5,875 % éch. 23/03/2035 (b)(c)                                         | 800                              | 940                       | 0,23 |
| 4,750 % éch. 20/09/2035                              |                                     | 500                              | 334                       | 0,08                                   | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                  |                           |                               | Électricité de France S.A.                                             |                                  |                           |      |
| Treasury Corp. of Victoria                           |                                     |                                  |                           | 0,36                                   | Obligation internationale du gouvernement chilien   |                                  |                           |                               | 7,375 % éch. 17/06/2035 (b)                                            |                                  |                           |      |
| 2,000 % éch. 17/09/2035                              | 2 800                               | 1 474                            | 0,36                      |                                        | 0,830 % éch. 02/07/2031                             | € 2 100                          | 2 118                     | 0,52                          | Engie S.A.                                                             |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  | 8 414                     | 2,07                                   | 3,875 % éch. 14/04/2036                             | 1 000                            | 1 145                     | 0,28                          | 6,125 % éch. 16/01/2032 (b)                                            | 500                              | 670                       | 0,16 |
| Total Australie                                      |                                     |                                  | 16 279                    | 4,01                                   |                                                     |                                  | 3 263                     | 0,80                          | iliad S.A.                                                             |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                        |                                                     |                                  | 3 876                     | 0,95                          | 4,250 % éch. 15/12/2029                                                | € 1 400                          | 1 627                     | 0,40 |
| AUTRICHE                                             |                                     |                                  |                           | Total Chili                            |                                                     |                                  |                           |                               | Kering S.A.                                                            |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE                     |                                                     |                                  |                           |                               | 5,125 % éch. 23/11/2026                                                | £ 1 200                          | 1 597                     | 0,39 |
| CA Immobilien Anlagen AG                             |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                                     |                                  |                           |                               | Nexans S.A.                                                            |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 07/07/2029 (a)                          | €                                   | 600                              | 683                       | 0,17                                   | UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S        |                                  |                           |                               | 4,250 % éch. 11/03/2030                                                | € 400                            | 467                       | 0,12 |
| Erste Group Bank AG                                  |                                     |                                  |                           | 0,42                                   | 3,750 % éch. 20/06/2028                             | 600                              | 697                       | 0,17                          | Orange S.A.                                                            |                                  |                           |      |
| 3,250 % éch. 14/01/2033                              | 1 500                               | 1 702                            | 0,42                      | DANEMARK                               |                                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 13/01/2033       | \$ 300                                                                 | 294                              | 0,07                      |      |
| Oesterreichische Kontrollbank AG                     |                                     |                                  |                           | 0,28                                   | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                  |                           |                               | SPiE S.A.                                                              |                                  |                           |      |
| 2,875 % éch. 29/04/2031                              | 1 000                               | 1 148                            | 0,28                      | Danske Bank A/S                        |                                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 18/05/2031       | € 1 000                                                                | 1 140                            | 0,28                      |      |
| UniCredit Bank Austria AG                            |                                     |                                  |                           | 0,09                                   | 3,500 % éch. 26/05/2033                             |                                  |                           |                               |                                                                        |                                  | 21 055                    | 5,18 |
| 2,875 % éch. 10/11/2028                              | 300                                 | 344                              | 0,09                      |                                        | 3,750 % éch. 03/03/2038                             |                                  |                           |                               | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                  |                                  |                           |      |
| 3,125 % éch. 21/09/2029                              | 600                                 | 692                              | 0,17                      |                                        | DSB                                                 |                                  |                           |                               | Île-de-France Mobilités                                                |                                  |                           |      |
| Verbund AG                                           |                                     |                                  |                           | 0,17                                   | 3,125 % éch. 04/09/2034                             |                                  |                           |                               | 3,450 % éch. 25/06/2049                                                |                                  |                           |      |
| 3,375 % éch. 22/04/2033                              | 600                                 | 686                              | 0,17                      |                                        | Novonesis Novozymes                                 |                                  |                           |                               | 4,200 % éch. 03/02/2046                                                |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  | 5 255                     | 1,30                                   | 3,625 % éch. 19/03/2033                             |                                  |                           |                               | Régie Autonome des Transports Parisiens                                |                                  |                           |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                     |                                  |                           |                                        | 4,000 % éch. 19/03/2037                             |                                  |                           |                               | 3,250 % éch. 11/04/2033                                                |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement autrichien |                                     |                                  |                           |                                        | Orsted A/S                                          |                                  |                           |                               | Société Nationale SNCF S.A.                                            |                                  |                           |      |
| 1,850 % éch. 23/05/2049                              | 750                                 | 624                              | 0,15                      |                                        | 5,125 % éch. 13/09/2034                             |                                  |                           |                               | 3,375 % éch. 25/05/2033                                                |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  | 5 879                     | 1,45                                   | TDC Net A/S                                         |                                  |                           |                               |                                                                        |                                  | 3 608                     | 0,89 |
| Total Autriche                                       |                                     |                                  |                           |                                        | 5,000 % éch. 09/08/2032                             |                                  |                           |                               | Total France                                                           |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                        | 5,618 % éch. 06/02/2030                             |                                  |                           |                               | 24 663                                                                 |                                  |                           |      |
| BELGIQUE                                             |                                     |                                  |                           | Total Danemark                         |                                                     |                                  |                           |                               | ALLEMAGNE                                                              |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | FINLANDE                               |                                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                                                        |                                  |                           |      |
| FLUVIUS System Operator C.V.                         |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                                     |                                  |                           | Amprion GmbH                  |                                                                        |                                  |                           |      |
| 3,750 % éch. 16/02/2036                              |                                     | 700                              | 800                       | 0,20                                   | Nordea Bank Abp                                     |                                  |                           |                               | 3,125 % éch. 27/08/2030                                                |                                  |                           |      |
| KBC Group NV                                         |                                     |                                  |                           | 0,20                                   | 3,500 % éch. 17/09/2035                             |                                  |                           |                               | 3,162 % éch. 15/01/2031                                                |                                  |                           |      |
| 3,750 % éch. 27/03/2032                              | 700                                 | 815                              | 0,20                      |                                        | Teollisuudten Voima Oyj                             |                                  |                           |                               | 3,625 % éch. 21/05/2031                                                |                                  |                           |      |
| 3,875 % éch. 28/05/2034                              | 700                                 | 811                              | 0,20                      |                                        | 3,625 % éch. 18/03/2033                             |                                  |                           |                               | 4,000 % éch. 21/05/2044                                                |                                  |                           |      |
| UCB S.A.                                             |                                     |                                  |                           | 0,09                                   | UPM-Kymmene Oyj                                     |                                  |                           |                               | 4,750 % éch. 28/04/2056                                                |                                  |                           |      |
| 4,250 % éch. 20/03/2030                              | 300                                 | 351                              | 0,09                      |                                        | 3,375 % éch. 29/08/2034                             |                                  |                           |                               | Commerzbank AG                                                         |                                  |                           |      |
| Warehouses De Pauw CVA                               |                                     |                                  |                           | 0,19                                   |                                                     |                                  | 837                       | 0,21                          | 4,000 % éch. 21/01/2038                                                | 400                              | 456                       | 0,11 |
| 3,125 % éch. 15/01/2031                              | 700                                 | 786                              | 0,19                      |                                        |                                                     |                                  | 2 889                     | 0,71                          | 4,125 % éch. 20/02/2037                                                | 1 500                            | 1 736                     | 0,43 |
| Total Belgique                                       |                                     |                                  | 3 563                     | 0,88                                   |                                                     |                                  |                           |                               | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt-sur-le-Main |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                        |                                                     |                                  |                           |                               | 3,129 % éch. 27/11/2031                                                | 1 700                            | 1 922                     | 0,47 |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                        |                                                     |                                  |                           |                               | E.ON SE                                                                |                                  |                           |      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                        |                                                     |                                  |                           |                               | 5,461 % éch. 21/10/2035                                                | AUD 400                          | 267                       | 0,07 |

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG                        |                                     |                                  |                           | 7,594 % éch. 06/12/2032                                     | £ 600                               | \$ 819                           | 0,20                      | Segro Capital SARL                        |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 28/07/2055                                   | € 700                               | \$ 803                           | 0,20                      | Kingspan Securities Ireland DAC                             |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 22/09/2031                   | € 1 000                             | \$ 992                           | 0,24                      |
| 4,500 % éch. 10/02/2056                                   | 300                                 | 341                              | 0,08                      | 3,500 % éch. 31/10/2031                                     | € 1 700                             | 1 943                            | 0,48                      | Total Luxembourg                          |                                     | 11 069                           | 2,73                      |
| Eurogrid GmbH                                             |                                     |                                  |                           | Smurfit Kappa Treasury ULC                                  |                                     |                                  |                           | <b>ÎLE MAURICE</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 3,075 % éch. 18/10/2027                                   | 400                                 | 459                              | 0,11                      | 5,438 % éch. 03/04/2034                                     | \$ 1 400                            | 1 424                            | 0,35                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>      |                                     |                                  |                           |
| 3,732 % éch. 18/10/2035                                   | 900                                 | 1 023                            | 0,25                      | Smurfit Westrock Financing DAC                              |                                     |                                  |                           | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. |                                     |                                  |                           |
| VE AG                                                     |                                     |                                  |                           | 5,185 % éch. 15/01/2036                                     | 700                                 | 693                              | 0,17                      | 4,250 % éch. 25/03/2027                   | \$ 1 073                            | 1 060                            | 0,26                      |
| 3,875 % éch. 28/05/2034                                   | 800                                 | 929                              | 0,23                      | Trane Technologies Financing Ltd.                           |                                     |                                  |                           | India Green Power Holdings                |                                     |                                  |                           |
| IHO Verwaltungs GmbH                                      |                                     |                                  |                           | 5,100 % éch. 13/06/2034                                     | 1 100                               | 1 112                            | 0,28                      | 4,000 % éch. 22/02/2027                   | 320                                 | 316                              | 0,08                      |
| 5,625 % éch. 15/05/2031                                   | 1 000                               | 1 191                            | 0,29                      | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.              |                                     |                                  |                           | Total Île Maurice                         |                                     | 1 376                            | 0,34                      |
| 7,375 % éch. 15/05/2033                                   | \$ 200                              | 208                              | 0,05                      | 5,000 % éch. 24/06/2033                                     | 1 100                               | 1 103                            | 0,27                      | <b>MEXIQUE</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                           |                                     |                                  |                           | Total Irlande                                               |                                     | 8 892                            | 2,19                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>      |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 15/11/2029                                   | € 2 000                             | 2 238                            | 0,55                      | <b>ITALIE</b>                                               |                                     |                                  |                           | Trust 2401                                |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 01/04/2033                                   | 400                                 | 454                              | 0,11                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 13/02/2034                   | 700                                 | 744                              | 0,18                      |
| 2,875 % éch. 31/03/2032                                   | 4 200                               | 4 816                            | 1,19                      | Intesa Sanpaolo SpA                                         |                                     |                                  |                           | <b>PAYS-BAS</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/02/2030                                   | £ 300                               | 397                              | 0,10                      | 3,625 % éch. 16/10/2030                                     | € 700                               | 815                              | 0,20                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>      |                                     |                                  |                           |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 08/03/2033                                     | 600                                 | 768                              | 0,19                      | ABN AMRO Bank NV                          |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 26/05/2042                                   | € 700                               | 692                              | 0,17                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 04/06/2029                   | € 1 400                             | 1 592                            | 0,39                      |
| Robert Bosch GmbH                                         |                                     |                                  |                           | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                           |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 25/02/2031                   | 300                                 | 342                              | 0,09                      |
| 4,000 % éch. 21/05/2036                                   | 700                                 | 804                              | 0,20                      | 1,500 % éch. 30/04/2045                                     | 1 050                               | 789                              | 0,20                      | 3,000 % éch. 22/09/2032                   | 1 100                               | 1 238                            | 0,31                      |
| Volkswagen Bank GmbH                                      |                                     |                                  |                           | 4,050 % éch. 30/10/2037                                     | 900                                 | 1 063                            | 0,26                      | 4,625 % éch. 08/11/2030                   | £ 1 500                             | 1 961                            | 0,48                      |
| 3,001 % éch. 10/12/2027                                   | 500                                 | 573                              | 0,14                      | 4,100 % éch. 30/04/2046                                     | 800                                 | 905                              | 0,22                      | Alliander NV                              |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 26/11/2033                                   | 200                                 | 232                              | 0,06                      | <b>JAPON</b>                                                |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 06/05/2037                   | € 1 200                             | 1 350                            | 0,33                      |
| Vonovia SE                                                |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 30/04/2036                   | 400                                 | 463                              | 0,11                      |
| 4,000 % éch. 06/01/2035 (a)                               | 500                                 | 569                              | 0,14                      | Total Italie                                                |                                     | 4 340                            | 1,07                      | ASR Nederland NV                          |                                     |                                  |                           |
| ZF Finance GmbH                                           |                                     |                                  |                           | East Japan Railway Co.                                      |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 12/12/2028                   | 400                                 | 463                              | 0,11                      |
| 2,250 % éch. 03/05/2028                                   | 600                                 | 665                              | 0,16                      | 3,533 % éch. 04/09/2036                                     | 350                                 | 394                              | 0,10                      | Ayvens Bank NV                            |                                     |                                  |                           |
|                                                           |                                     | 23 275                           | 5,73                      | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 07/09/2026                   | 1 400                               | 1 594                            | 0,39                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                                     |                                  |                           | 3,556 % éch. 05/09/2032                                     | 2 000                               | 2 300                            | 0,57                      | CTP NV                                    |                                     |                                  |                           |
| Land Baden-Wuerttemberg                                   |                                     |                                  |                           | Mizuho Financial Group, Inc.                                |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 19/07/2030                   | 100                                 | 114                              | 0,03                      |
| 2,625 % éch. 30/12/2034                                   | 600                                 | 666                              | 0,16                      | 3,460 % éch. 27/08/2030                                     | 2 100                               | 2 419                            | 0,60                      | 3,625 % éch. 10/03/2031                   | 300                                 | 342                              | 0,09                      |
| République d'Allemagne                                    |                                     |                                  |                           | Norinchukin Bank                                            |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 13/04/2032                   | 500                                 | 565                              | 0,14                      |
| 2,500 % éch. 15/02/2035                                   | 3 000                               | 3 351                            | 0,83                      | 2,080 % éch. 22/09/2031                                     | \$ 1 000                            | 864                              | 0,21                      | Digital Dutch Finco BV                    |                                     |                                  |                           |
|                                                           |                                     | 4 017                            | 0,99                      | 4,867 % éch. 14/09/2027                                     | 600                                 | 601                              | 0,15                      | 3,875 % éch. 13/09/2033                   | 200                                 | 227                              | 0,06                      |
| Total Allemagne                                           |                                     | 27 292                           | 6,72                      | 5,094 % éch. 16/10/2029                                     | 700                                 | 705                              | 0,17                      | Digital Intrepid Holding BV               |                                     |                                  |                           |
| <b>HONG KONG</b>                                          |                                     |                                  |                           | NTT Finance Corp.                                           |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch. 18/07/2032                   | 700                                 | 698                              | 0,17                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                                     |                                  |                           | 0,399 % éch. 13/12/2028                                     | € 1 000                             | 1 073                            | 0,26                      | DSV Finance BV                            |                                     |                                  |                           |
| MTR Corp. Ltd.                                            |                                     |                                  |                           | 3,325 % éch. 01/11/2029 (a)                                 | 1 600                               | 1 833                            | 0,45                      | 0,500 % éch. 03/03/2031                   | 500                                 | 506                              | 0,13                      |
| 5,582 % éch. 29/01/2038                                   | AUD 1 000                           | 693                              | 0,17                      | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           | E.ON International Finance BV             |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                                     |                                  |                           | 3,318 % éch. 07/10/2031                                     | 600                                 | 688                              | 0,17                      | 4,053 % éch. 27/05/2036                   | 1 000                               | 1 168                            | 0,29                      |
| Obligation internationale du gouvernement hongkongais     |                                     |                                  |                           | Total Japon                                                 |                                     | 10 877                           | 2,68                      | ENEL Finance International NV             |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 14/05/2034                                   | € 400                               | 455                              | 0,11                      | <b>LETTONIE</b>                                             |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 12/07/2028                   | \$ 600                              | 571                              | 0,14                      |
| Total Hong Kong                                           |                                     | 1 148                            | 0,28                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 12/07/2031                   | 700                                 | 624                              | 0,15                      |
| <b>HONGRIE</b>                                            |                                     |                                  |                           | Latvenergo A/S                                              |                                     |                                  |                           | Enxsis Holding NV                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                                     |                                  |                           | 3,612 % éch. 13/11/2030                                     | 800                                 | 910                              | 0,23                      | 3,375 % éch. 13/11/2035                   | € 1 700                             | 1 909                            | 0,47                      |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois        |                                     |                                  |                           | 4,162 % éch. 25/06/2033                                     | 400                                 | 460                              | 0,11                      | Flora Food Management BV                  |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 22/03/2040 (d)                               | 1 000                               | 1 199                            | 0,30                      | Total Lettonie                                              |                                     | 1 370                            | 0,34                      | 6,875 % éch. 02/07/2029                   | 400                                 | 447                              | 0,11                      |
| <b>ISLANDE</b>                                            |                                     |                                  |                           | <b>LUXEMBOURG</b>                                           |                                     |                                  |                           | Givaudan Finance Europe BV                |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 09/09/2029                   | 1 000                               | 1 133                            | 0,28                      |
| Obligation internationale du gouvernement islandais       |                                     |                                  |                           | Acef Holding S.C.A.                                         |                                     |                                  |                           | ING Bank NV                               |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 21/03/2034                                   | 900                                 | 1 050                            | 0,26                      | 1,250 % éch. 26/04/2030                                     | 900                                 | 949                              | 0,23                      | 3,625 % éch. 12/05/2033                   | 1 100                               | 1 274                            | 0,31                      |
| <b>INDE</b>                                               |                                     |                                  |                           | AXA Logistics Europe Master S.C.A.                          |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                              |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 13/05/2031                                     | 1 800                               | 2 042                            | 0,50                      | 4,000 % éch. 12/02/2035                   | 900                                 | 1 054                            | 0,26                      |
| ReNew Wind Energy AP2                                     |                                     |                                  |                           | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF             |                                     |                                  |                           | 6,114 % éch. 11/09/2034                   | \$ 200                              | 212                              | 0,05                      |
| 4,500 % éch. 14/07/2028                                   | \$ 1 000                            | 968                              | 0,24                      | 3,500 % éch. 22/09/2032                                     | 900                                 | 1 007                            | 0,25                      | 7,000 % éch. 16/11/2032 (b)(c)            | 900                                 | 926                              | 0,23                      |
| SAEL Ltd.                                                 |                                     |                                  |                           | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 16/11/2034 (b)(c)            | 900                                 | 946                              | 0,23                      |
| 7,800 % éch. 31/07/2031                                   | 544                                 | 552                              | 0,13                      | European Core Fund                                          |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 16/05/2030 (b)(c)            | 1 000                               | 1 066                            | 0,26                      |
| Total Inde                                                |                                     | 1 520                            | 0,37                      | 0,500 % éch. 27/01/2028                                     | 1 200                               | 1 318                            | 0,33                      | JAB Holdings BV                           |                                     |                                  |                           |
| <b>IRLANDE</b>                                            |                                     |                                  |                           | 0,900 % éch. 12/10/2029                                     | 1 000                               | 1 056                            | 0,26                      | 2,200 % éch. 23/11/2030                   | 600                                 | 538                              | 0,13                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                                     |                                  |                           | CPI Property Group S.A.                                     |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 25/04/2034                   | € 1 100                             | 1 299                            | 0,32                      |
| AIB Group PLC                                             |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 05/02/2033                                     | £ 650                               | 805                              | 0,20                      | JDE Peet's NV                             |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 02/12/2036                                   | € 400                               | 453                              | 0,11                      | Nova Securitisation SARL                                    |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 24/09/2031                   | \$ 2 400                            | 2 080                            | 0,51                      |
| 7,125 % éch. 30/10/2029 (b)(c)                            | 500                                 | 617                              | 0,15                      | 6,500 % éch. 03/02/2036                                     | \$ 800                              | 753                              | 0,19                      | Lseg Netherlands BV                       |                                     |                                  |                           |
| Bank of Ireland Group PLC                                 |                                     |                                  |                           | Prologis International Funding S.A.                         |                                     |                                  |                           | 4,231 % éch. 29/09/2030                   | € 500                               | 594                              | 0,15                      |
| 5,000 % éch. 04/07/2031                                   | 400                                 | 486                              | 0,12                      | 0,750 % éch. 23/03/2033                                     | € 475                               | 451                              | 0,11                      | Nationale-Nederlanden Bank NV             |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 10/03/2030 (b)(c)                            | 200                                 | 242                              | 0,06                      | 1,625 % éch. 17/06/2032                                     | 1 425                               | 1 465                            | 0,36                      | 0,500 % éch. 21/09/2028                   | 1 100                               | 1 191                            | 0,29                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 07/03/2030                                     | 200                                 | 231                              | 0,06                      | 1,875 % éch. 17/05/2032                   | 200                                 | 215                              | 0,05                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 21/03/2031                   | 400                                 | 459                              | 0,11                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | NE Property BV                            |                                     |                                  |                           |
|                                                           |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 20/01/2030                   | 1 400                               | 1 515                            | 0,37                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 30/09/2033                   | 1 100                               | 1 247                            | 0,31                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | SGS Finance BV                            |                                     |                                  |                           |
|                                                           |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 10/09/2030                   | 800                                 | 910                              | 0,22                      |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE EN % DE<br>VALEUR L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------------|
| Stedin Holding NV<br>4,250 % éch. 21/10/2035 (b)                             | € 1 400                             | \$ 1 574                         | 0,39                      | <b>ESPAGNE</b>                                                                |                                     |                                  |                           | Svensk Exportkredit AB<br>2,000 % éch. 30/06/2027                   | € 1 100                             | \$ 1 249 0,30                          |
| Swisscom Finance BV<br>3,250 % éch. 05/09/2034                               | 800                                 | 903                              | 0,22                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                          |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     | 3 387 0,83                             |
| 3,500 % éch. 29/11/2031                                                      | 700                                 | 809                              | 0,20                      | Banco Santander S.A.                                                          | € 700                               | \$ 763                           | 0,19                      | Total Suède                                                         |                                     | 13 774 3,39                            |
| 3,625 % éch. 17/11/2037                                                      | 200                                 | 226                              | 0,06                      | 0,625 % éch. 24/06/2029                                                       |                                     |                                  |                           | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                          |                                     |                                        |
| Tennet Netherlands BV<br>3,250 % éch. 01/04/2036                             | 800                                 | 923                              | 0,23                      | Caja Rural de Navarra SCC<br>3,000 % éch. 26/04/2027                          | 2 100                               | 2 407                            | 0,59                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                        |
| Vesteda Finance BV<br>4,000 % éch. 07/05/2032                                | 800                                 | 927                              | 0,23                      | Cellnex Finance Co. S.A.<br>3,875 % éch. 19/01/2036                           | 700                                 | 792                              | 0,20                      | Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC<br>5,794 % éch. 30/06/2053               | \$ 1 700                            | 1 685 0,42                             |
| VIA Outlets BV<br>1,750 % éch. 15/11/2028                                    | 508                                 | 561                              | 0,14                      | EDP Servicios Financieros Espana S.A.<br>3,125 % éch. 03/12/2031              | 600                                 | 678                              | 0,17                      | Emirates NBD Bank PJSC<br>4,195 % éch. 13/01/2029                   | 1 300                               | 1 282 0,32                             |
| Volkswagen Financial Services NV<br>5,125 % éch. 04/04/2029                  | £ 400                               | 532                              | 0,13                      | 4,375 % éch. 04/04/2032                                                       | 1 300                               | 1 556                            | 0,38                      | First Abu Dhabi Bank PJSC<br>3,120 % éch. 20/02/2031                | € 1 100                             | 1 231 0,30                             |
| Volkswagen International Finance NV<br>5,994 % éch. 15/11/2033 (b)           | € 300                               | 353                              | 0,09                      | 3,750 % éch. 05/08/2031 (b)                                                   | 300                                 | 339                              | 0,08                      | 3,530 % éch. 24/12/2029                                             | 1 000                               | 1 149 0,28                             |
|                                                                              |                                     | 39 641                           | 9,76                      | Telefonica Emisiones S.A.<br>4,183 % éch. 21/11/2033                          | 500                                 | 585                              | 0,14                      | Total Émirats arabes unis                                           |                                     | 5 347 1,32                             |
|                                                                              |                                     |                                  |                           | 4,881 % éch. 19/01/2034 (b)                                                   | 700                                 | 795                              | 0,20                      |                                                                     |                                     |                                        |
|                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                               |                                     | 7 915                            | 1,95                      | <b>ROYAUME-UNI</b>                                                  |                                     |                                        |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                        |
| Nederlandse Waterschapsbank NV                                               |                                     |                                  |                           | Adif Alta Velocidad                                                           |                                     |                                  |                           | Assura Financing PLC<br>1,625 % éch. 30/06/2033                     | £ 1 100                             | 1 135 0,28                             |
| 2,750 % éch. 24/09/2032                                                      | 1 650                               | 1 865                            | 0,46                      | 3,125 % éch. 31/10/2032                                                       | 400                                 | 456                              | 0,11                      | Aviva PLC<br>4,750 % éch. 28/11/2057                                | € 200                               | 234 0,06                               |
| 3,000 % éch. 20/04/2033                                                      | 900                                 | 1 030                            | 0,25                      | 3,500 % éch. 30/04/2032                                                       | 1 300                               | 1 512                            | 0,37                      | 6,125 % éch. 12/09/2054                                             | £ 800                               | 1 079 0,27                             |
|                                                                              |                                     | 2 895                            | 0,71                      | Comunidad Autonoma de Canarias<br>3,500 % éch. 30/04/2036                     | 2 000                               | 2 304                            | 0,57                      | 7,750 % éch. 30/09/2032 (b)(c)                                      | 200                                 | 279 0,07                               |
| Total Pays-Bas                                                               |                                     | 42 536                           | 10,47                     | Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>1,000 % éch. 30/07/2042 |                                     | 1 923                            | 0,47                      | BCP Modular Services Finance PLC<br>6,500 % éch. 10/07/2031         | € 1 000                             | 995 0,25                               |
|                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                               | 2 500                               | 6 195                            | 1,52                      | Berkeley Group PLC<br>2,500 % éch. 11/08/2031                       | £ 1 300                             | 1 481 0,36                             |
| <b>NORVÈGE</b>                                                               |                                     |                                  |                           | Total Espagne                                                                 |                                     | 14 110                           | 3,47                      | British Land Co. PLC<br>2,375 % éch. 14/09/2029                     |                                     | 1 400 1 726 0,43                       |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>SUPRANATIONALES</b>                                                        |                                     |                                  |                           | BT Finance PLC<br>3,375 % éch. 17/11/2032                           | € 1 400                             | 1 583 0,39                             |
| DNB Bank ASA                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                          |                                     |                                  |                           | Burberry Group PLC<br>5,750 % éch. 20/06/2030                       | € 1 100                             | 1 474 0,36                             |
| 3,000 % éch. 15/01/2031                                                      | 400                                 | 455                              | 0,11                      | Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von                  |                                     |                                  |                           | Chanel Ceres PLC<br>1,000 % éch. 31/07/2031                         | € 2 200                             | 2 224 0,55                             |
| 3,125 % éch. 20/05/2031                                                      | 800                                 | 910                              | 0,22                      | Eisenbahnmaterial                                                             | 800                                 | 923                              | 0,23                      | DS Smith PLC<br>4,375 % éch. 27/07/2027                             |                                     | 400 463 0,11                           |
| 4,625 % éch. 01/11/2029                                                      | 300                                 | 355                              | 0,09                      | 3,125 % éch. 09/11/2031                                                       |                                     |                                  |                           | Grainger PLC<br>3,375 % éch. 24/04/2028                             | £ 450                               | 580 0,14                               |
| Eika Boligkredit A/S<br>3,125 % éch. 24/04/2034                              | 400                                 | 458                              | 0,11                      | Banque européenne d'investissement<br>2,875 % éch. 18/06/2035                 | 2 900                               | 3 274                            | 0,80                      | IHG Finance LLC<br>3,375 % éch. 10/09/2030                          | € 800                               | 910 0,22                               |
| Norsk Hydro ASA                                                              |                                     |                                  |                           | Société financière internationale<br>4,900 % éch. 05/12/2034                  | AUD 2 000                           | 1 370                            | 0,34                      | Informa PLC<br>3,375 % éch. 09/06/2031                              |                                     | 1 550 1 758 0,43                       |
| 3,625 % éch. 23/01/2032                                                      | 600                                 | 691                              | 0,17                      |                                                                               |                                     | 5 567                            | 1,37                      | Land Securities Capital Markets PLC<br>4,875 % éch. 15/09/2034      | £ 500                               | 659 0,16                               |
| 3,750 % éch. 17/06/2033                                                      | 300                                 | 347                              | 0,09                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                  |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC<br>2,864 % éch. 12/02/2030                 | € 1 500                             | 1 719 0,42                             |
| SR-Boligkredit A/S<br>2,750 % éch. 27/02/2033                                | 1 900                               | 2 139                            | 0,53                      | Union européenne<br>1,250 % éch. 04/02/2043                                   | € 1 000                             | 799                              | 0,20                      | 3,625 % éch. 13/05/2033                                             | 200                                 | 229 0,06                               |
| Statnett SF<br>3,500 % éch. 10/06/2037                                       | 1 100                               | 1 250                            | 0,31                      | 2,625 % éch. 04/02/2048                                                       | 500                                 | 467                              | 0,11                      | LSEGA Financing PLC<br>2,500 % éch. 06/04/2031                      | \$ 662                              | 597 0,15                               |
|                                                                              |                                     | 6 605                            | 1,63                      | Total Supranationales                                                         |                                     | 1 266                            | 0,31                      | Marks & Spencer PLC<br>5,125 % éch. 18/08/2032                      | £ 300                               | 393 0,10                               |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | <b>SUÈDE</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | Motability Operations Group PLC<br>4,250 % éch. 17/06/2035          | € 800                               | 932 0,23                               |
| Kommunalbanken A/S                                                           |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                          |                                     |                                  |                           | NatWest Group PLC<br>2,057 % éch. 09/11/2028                        | £ 3 200                             | 4 102 1,01                             |
| 2,625 % éch. 05/11/2031                                                      | 600                                 | 677                              | 0,17                      | Castellum AB<br>3,125 % éch. 02/12/2026 (b)                                   | 600                                 | 680                              | 0,17                      | 3,673 % éch. 05/08/2031                                             | € 800                               | 926 0,23                               |
| 2,875 % éch. 25/04/2029                                                      | 1 300                               | 1 489                            | 0,36                      | 4,125 % éch. 10/12/2030                                                       | 300                                 | 347                              | 0,09                      | 7,500 % éch. 03/06/2036 (b)(c)                                      | £ 200                               | 268 0,07                               |
|                                                                              |                                     | 2 166                            | 0,53                      | Ellevio AB<br>3,750 % éch. 14/05/2035                                         | 1 400                               | 1 601                            | 0,39                      | 7,625 % éch. 30/09/2035 (b)(c)                                      | 600                                 | 821 0,20                               |
| Total Norvège                                                                |                                     | 8 771                            | 2,16                      | EQT AB<br>0,875 % éch. 14/05/2031                                             |                                     |                                  |                           | Scottish Hydro Electric Transmission PLC<br>3,375 % éch. 04/09/2032 | € 1 100                             | 1 250 0,31                             |
| <b>SLOVÉNIE</b>                                                              |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 06/04/2028                                                       | 800                                 | 903                              | 0,22                      | 3,375 % éch. 02/11/2033                                             | 500                                 | 563 0,14                               |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | Sagax AB<br>4,000 % éch. 13/03/2032                                           | 600                                 | 691                              | 0,17                      | Seyn Trent Utilities Finance PLC<br>2,625 % éch. 22/02/2033         | £ 600                               | 676 0,17                               |
| Obligation internationale du gouvernement slovène<br>3,125 % éch. 02/07/2035 | 800                                 | 913                              | 0,23                      | 4,375 % éch. 29/05/2030                                                       | 1 300                               | 1 525                            | 0,38                      | 3,875 % éch. 04/08/2035                                             | € 1 000                             | 1 139 0,28                             |
| <b>CORÉE DU SUD</b>                                                          |                                     |                                  |                           | Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB<br>1,125 % éch. 26/09/2029          |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 04/08/2037                                             | 900                                 | 1 011 0,25                             |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                         |                                     |                                  |                           | Svenska Handelsbanken AB<br>3,250 % éch. 27/08/2031                           | 2 100                               | 2 402                            | 0,59                      | South Eastern Power Networks PLC<br>1,750 % éch. 30/09/2034         | £ 1 400                             | 1 419 0,35                             |
| KEB Hana Bank<br>3,125 % éch. 20/01/2031                                     | 300                                 | 344                              | 0,08                      | 3,500 % éch. 29/04/2033                                                       | 400                                 | 457                              | 0,11                      | SSE PLC<br>4,000 % éch. 05/09/2031                                  | € 600                               | 706 0,17                               |
| Korea Ocean Business Corp.<br>4,279 % éch. 27/04/2029                        | \$ 1 700                            | 1 704                            | 0,42                      |                                                                               |                                     | 10 387                           | 2,56                      | United Utilities Water Finance PLC<br>3,500 % éch. 27/02/2033       |                                     | 400 453 0,11                           |
| LG Energy Solution Ltd.<br>5,750 % éch. 25/09/2028                           | 300                                 | 305                              | 0,08                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                  |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 23/05/2034                                             | 400                                 | 457 0,11                               |
| Shinhan Bank Co. Ltd.<br>4,000 % éch. 23/04/2029 (c)                         | 900                                 | 880                              | 0,22                      | Kommuninvest Sverige AB<br>2,625 % éch. 01/09/2032                            | 1 800                               | 2 023                            | 0,50                      | 3,750 % éch. 07/08/2035                                             | 200                                 | 227 0,06                               |
|                                                                              |                                     | 3 233                            | 0,80                      | 3,000 % éch. 20/02/2030                                                       | 100                                 | 115                              | 0,03                      |                                                                     |                                     |                                        |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                        |
| Korea Water Resources Corp.<br>4,375 % éch. 21/05/2027                       | 1 100                               | 1 100                            | 0,27                      |                                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                        |
| Total Corée du Sud                                                           |                                     | 4 333                            | 1,07                      |                                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                        |

| DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Vmed O2 UK Financing PLC                  | € 500                               | \$ 504                           | 0,12                      | Digital Euro Finco LLC                      | € 400                               | \$ 451                           | 0,11                      | Southern California Edison Co.                                              | \$ 1 000                            | \$ 893                           | 0,22                      |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                   |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 20/11/2037                     |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/06/2031                                                     | 2 000                               | 1 322                            | 0,33                      |
| 6,750 % éch. 15/01/2033                   | \$ 1 000                            | 848                              | 0,21                      | Edison International                        | \$ 1 000                            | 986                              | 0,24                      | 3,450 % éch. 01/02/2052                                                     |                                     |                                  |                           |
| Vodafone Group PLC                        |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/03/2028                     |                                     |                                  |                           | Southwestern Public Service Co.                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 04/06/2081                   | 950                                 | 743                              | 0,18                      | 5,000 % éch. 05/05/2028                     | 200                                 | 200                              | 0,05                      | 3,150 % éch. 01/05/2050                                                     | 450                                 | 296                              | 0,07                      |
| Workspace Group PLC                       |                                     |                                  |                           | Elevance Health, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/06/2049                                                     | 1 000                               | 738                              | 0,18                      |
| 2,250 % éch. 11/03/2028                   | £ 400                               | 505                              | 0,12                      | 5,150 % éch. 15/06/2029                     | 500                                 | 507                              | 0,13                      | Synopsys, Inc.                                                              |                                     |                                  |                           |
|                                           |                                     | 37 068                           | 9,13                      | Equinix Europe Financing Corp. LLC          | € 300                               | 336                              | 0,08                      | 4,850 % éch. 01/04/2030                                                     | 500                                 | 501                              | 0,12                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>              |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 22/11/2034                     | € 1 250                             | 1 421                            | 0,35                      | 5,000 % éch. 01/04/2032                                                     | 1 500                               | 1 503                            | 0,37                      |
| Bon du Trésor britannique                 |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 03/09/2033                     |                                     |                                  |                           | T-Mobile USA, Inc.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 0,875 % éch. 31/07/2033                   | 1 800                               | 1 865                            | 0,46                      | 4,000 % éch. 19/05/2034                     | 400                                 | 460                              | 0,11                      | 5,750 % éch. 15/01/2034                                                     | 3 000                               | 3 107                            | 0,77                      |
| 4,375 % éch. 31/07/2054                   | 2 400                               | 2 678                            | 0,66                      | Equinix, Inc.                               | \$ 600                              | 571                              | 0,14                      | Topaz Solar Farms LLC                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 07/03/2037                   | 300                                 | 389                              | 0,09                      | 1,550 % éch. 15/03/2028                     |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 30/09/2039                                                     | 656                                 | 646                              | 0,16                      |
|                                           |                                     | 4 932                            | 1,21                      | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           | VF Corp.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Total Royaume-Uni                         |                                     | 42 000                           | 10,34                     | 6,000 % éch. 15/03/2036                     | 200                                 | 197                              | 0,05                      | 2,950 % éch. 23/04/2030                                                     | 100                                 | 91                               | 0,02                      |
| <b>ÉTATS-UNIS</b>                         |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 01/07/2034                     | 600                                 | 612                              | 0,15                      | Welltower OP LLC                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS</b>       |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/07/2035                     | 400                                 | 416                              | 0,10                      | 3,850 % éch. 15/06/2032                                                     | 300                                 | 285                              | 0,07                      |
| GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust |                                     |                                  |                           | Haleon U.S. Capital LLC                     |                                     |                                  |                           | Wisconsin Power & Light Co.                                                 |                                     |                                  |                           |
| 2,100 % éch. 20/05/2048                   | \$ 766                              | 618                              | 0,15                      | 3,625 % éch. 24/03/2032                     | 500                                 | 469                              | 0,12                      | 3,950 % éch. 01/09/2032                                                     | 1 300                               | 1 238                            | 0,31                      |
| 4,000 % éch. 20/04/2049                   | 796                                 | 694                              | 0,17                      | Hanwha Energy USA Holdings Corp.            |                                     |                                  |                           | Wisconsin Public Service Corp.                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 20/07/2049                   | 1 464                               | 1 319                            | 0,33                      | 4,375 % éch. 02/07/2028                     | 1 700                               | 1 695                            | 0,42                      | 2,850 % éch. 01/12/2051                                                     | 450                                 | 279                              | 0,07                      |
| Iskandar Enterprise LLC                   |                                     |                                  |                           | HAT Holdings LLC                            |                                     |                                  |                           | Xylem, Inc.                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,049 % éch. 17/04/2056                   | 500                                 | 498                              | 0,12                      | 3,750 % éch. 15/09/2030                     | 600                                 | 561                              | 0,14                      | 5,450 % éch. 01/06/2036                                                     | 1 400                               | 1 427                            | 0,35                      |
| Loanpal Solar Loan Ltd.                   |                                     |                                  |                           | Host Hotels & Resorts LP                    |                                     |                                  |                           |                                                                             | 72 122                              | 17,76                            |                           |
| 2,220 % éch. 20/03/2048                   | 438                                 | 358                              | 0,09                      | 3,500 % éch. 15/09/2030                     | 2 675                               | 2 531                            | 0,62                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX</b>                                    |                                     |                                  |                           |
|                                           |                                     | 3 487                            | 0,86                      | 5,700 % éch. 01/07/2034                     | 500                                 | 512                              | 0,13                      | Obligations New York City Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds,  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>      |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                        |                                     |                                  |                           | (BABs), Series 2010                                                         |                                     |                                  |                           |
| AES Corp.                                 |                                     |                                  |                           | 6,070 % éch. 22/10/2027                     | 1 800                               | 1 809                            | 0,45                      | 5,724 % éch. 15/06/2042                                                     | 170                                 | 167                              | 0,04                      |
| 2,450 % éch. 15/01/2031                   | 100                                 | 89                               | 0,02                      | Kilroy Realty LP                            |                                     |                                  |                           | Obligations New York City Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds,  |                                     |                                  |                           |
| 5,450 % éch. 01/06/2028                   | 700                                 | 708                              | 0,17                      | 2,500 % éch. 15/11/2032                     | 1 000                               | 830                              | 0,21                      | Series 2010                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc.     |                                     |                                  |                           | 2,650 % éch. 15/11/2033                     | 100                                 | 81                               | 0,02                      | 5,882 % éch. 15/06/2044                                                     | 110                                 | 109                              | 0,03                      |
| 2,000 % éch. 18/05/2032                   | 800                                 | 675                              | 0,17                      | Levi Strauss & Co.                          |                                     |                                  |                           | Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, |                                     |                                  |                           |
| Alphabet, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/03/2031 (d)                 | 600                                 | 556                              | 0,14                      | Series 2020                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 2,050 % éch. 15/08/2050                   | 700                                 | 374                              | 0,09                      | Lseg U.S. Fin Corp.                         |                                     |                                  |                           | 2,154 % éch. 01/07/2030                                                     | 170                                 | 156                              | 0,04                      |
| 3,125 % éch. 06/11/2034                   | € 500                               | 558                              | 0,14                      | 4,250 % éch. 23/03/2029                     | 800                                 | 791                              | 0,20                      |                                                                             | 432                                 | 0,11                             |                           |
| American Homes 4 Rent LP                  |                                     |                                  |                           | Marsh & McLennan Cos., Inc.                 |                                     |                                  |                           | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 01/02/2034                   | \$ 1 100                            | 1 115                            | 0,28                      | 5,150 % éch. 15/03/2034                     | 700                                 | 706                              | 0,17                      | Titre adressé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                  |                                     |                                  |                           |
| Amgen, Inc.                               |                                     |                                  |                           | MidAmerican Energy Co.                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/10/2053 - 01/07/2054                                        | 17 134                              | 16 942                           | 4,17                      |
| 3,000 % éch. 22/02/2029                   | 3 800                               | 3 661                            | 0,90                      | 2,700 % éch. 01/08/2052                     | 950                                 | 585                              | 0,14                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 02/03/2030                   | 500                                 | 510                              | 0,13                      | 3,650 % éch. 01/08/2048                     | 500                                 | 372                              | 0,09                      | Obligations du Trésor américain                                             |                                     |                                  |                           |
| Astrazeneca Finance LLC                   |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/07/2049                     | 400                                 | 326                              | 0,08                      | 4,625 % éch. 15/11/2055                                                     | 368                                 | 350                              | 0,08                      |
| 4,900 % éch. 03/03/2030                   | 1 300                               | 1 317                            | 0,32                      | Moody's Corp.                               |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                                            |                                     | 93 333                           | 22,98                     |
| Autodesk, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 2,550 % éch. 18/08/2060                     | 500                                 | 255                              | 0,06                      | <b>ÎLES VIERGES BRITANNIQUES</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,400 % éch. 15/12/2031                   | 300                                 | 263                              | 0,07                      | MSCI, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| 2,850 % éch. 15/01/2030                   | 1 200                               | 1 127                            | 0,28                      | 3,250 % éch. 15/08/2033                     | 200                                 | 176                              | 0,04                      | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,300 % éch. 15/06/2035                   | 700                                 | 701                              | 0,17                      | 4,000 % éch. 15/11/2029                     | 1 400                               | 1 355                            | 0,33                      | 6,750 % éch. 24/04/2033 (d)                                                 | 603                                 | 610                              | 0,15                      |
| Bank of America Corp.                     |                                     |                                  |                           | National Grid North America, Inc.           |                                     |                                  |                           | <b>Total des Valeurs mobilières</b>                                         | \$ 386 346                          | 95,14                            |                           |
| 4,134 % éch. 12/06/2028                   | € 1 400                             | 1 636                            | 0,40                      | 4,061 % éch. 03/09/2036                     | € 1 500                             | 1 727                            | 0,43                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Becton Dickinson & Co.                    |                                     |                                  |                           | New York State Electric & Gas Corp.         |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,110 % éch. 08/02/2034                   | \$ 300                              | 301                              | 0,07                      | 2,150 % éch. 01/10/2031                     | \$ 1 100                            | 966                              | 0,24                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Boston Properties LP                      |                                     |                                  |                           | 5,650 % éch. 15/08/2028                     | 2 300                               | 2 343                            | 0,58                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 2,450 % éch. 01/10/2033                   | 1 020                               | 839                              | 0,21                      | Niagara Mohawk Power Corp.                  |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Boston Scientific Corp.                   |                                     |                                  |                           | 1,960 % éch. 27/06/2030                     | 600                                 | 541                              | 0,13                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 2,650 % éch. 01/06/2030                   | 600                                 | 557                              | 0,14                      | Northern States Power Co.                   |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| CBRE Services, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 01/04/2031                     | 600                                 | 540                              | 0,13                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/04/2031                   | 1 370                               | 1 231                            | 0,30                      | NSTAR Electric Co.                          |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 15/08/2034                   | 600                                 | 626                              | 0,15                      | 3,100 % éch. 01/06/2051                     | 2 470                               | 1 639                            | 0,40                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| CDW LLC                                   |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/05/2029                     | 900                                 | 870                              | 0,21                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,550 % éch. 22/08/2034                   | 300                                 | 296                              | 0,07                      | Oberlin College                             |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| CenterPoint Energy Houston Electric LLC   |                                     |                                  |                           | 2,874 % éch. 01/10/2051                     | 1 800                               | 1 133                            | 0,28                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,300 % éch. 01/04/2053                   | 600                                 | 571                              | 0,14                      | Oncor Electric Delivery Co. LLC             | € 1 800                             | 2 077                            | 0,51                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Chpe LLC                                  |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/05/2031                     |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 30/06/2036                   | 300                                 | 299                              | 0,07                      | Pacific Life Global Funding                 |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Clearway Energy Operating LLC             |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 18/06/2031                     | 700                                 | 793                              | 0,20                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/01/2034                   | 1 500                               | 1 472                            | 0,36                      | Public Service Co. of Colorado              |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Community Preservation Corp.              |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch. 15/01/2051                     | \$ 75                               | 45                               | 0,01                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 2,867 % éch. 01/02/2030                   | 360                                 | 334                              | 0,08                      | 3,200 % éch. 01/03/2050                     | 425                                 | 286                              | 0,07                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Continental Wind LLC                      |                                     |                                  |                           | Public Service Co. of Oklahoma              |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 28/02/2033                   | 394                                 | 397                              | 0,10                      | 2,200 % éch. 15/08/2031                     | 2 083                               | 1 834                            | 0,45                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| Coty, Inc.                                |                                     |                                  |                           | Public Service Electric & Gas Co.           |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/01/2029                   | 2 400                               | 2 334                            | 0,58                      | 3,100 % éch. 15/03/2032                     | 2 700                               | 2 485                            | 0,61                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                           |                                     |                                  |                           | Solar Star Funding LLC                      |                                     |                                  |                           |                                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                           |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 30/06/2035                     | 762                                 | 759                              | 0,19                      |                                                                             |                                     |                                  |                           |



## Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|------------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                   | 3,690 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 15 100            | Billets du Trésor américain 3,375 %<br>échéance 31/12/2027 | \$ (15 411)      | \$ 15 100                                | \$ 15 102                                                          | 3,72                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                            | \$ (15 411)      | \$ 15 100                                | \$ 15 102                                                          | 3,72                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Court | 09/2026           | 11                 | \$ (12)                           | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Long  | 09/2026           | 211                | 136                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 420                | (646)                             | (0,16)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 32                 | (85)                              | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 736                | 151                               | 0,04                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 158                | 101                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 280                | 386                               | 0,10                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 23                 | 78                                | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Court | 09/2026           | 57                 | (75)                              | (0,02)              |
|                                                                                               |       |                   |                    | \$ 34                             | 0,01                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | \$ 34                             | 0,01                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 6 420           | \$ (182)                          | (0,05)              |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 540               | 28                                | 0,01                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2027      | \$ 6 400          | 232                               | 0,06                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2030      | 3 900             | 40                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055      | 7 100             | 100                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | CAD 2 800         | (8)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 8 300           | 23                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 8 000             | (112)                             | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 1 860             | (1)                               | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 120                            | 0,03                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 120                            | 0,03                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 4 033       | \$ 2 884          | \$ 90              | \$ 0                  | \$ 90                                   | 0,02                |
|              | 07/2026           | SGD 25          | 19                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 85           | CAD 121           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 121         | \$ 85             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | \$ 548          | € 471             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 75              | ¥ 11 942          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 64 323        | \$ 74 846         | 1 329              | (23)                  | 1 306                                   | 0,32                |
|              | 07/2026           | £ 62            | 82                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 822          | £ 618             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 20              | INR 1 934         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 254             | ¥ 40 366          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 21              | INR 1 968         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 1 447         | \$ 1 687          | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,01                |
| DUB          | 07/2026           | INR 3 230       | 34                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23           | INR 2 202         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 34              | 3 252             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | £ 24 043        | \$ 32 332         | \$ 420             | \$ 0                  | \$ 420                                  | 0,10                |
|              | 07/2026           | ¥ 304 500       | 1 882             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 15          | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 225        | € 1 951           | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15              | £ 11              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 31              | ¥ 4 965           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 951         | \$ 2 228          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 11            | 15                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 882        | ¥ 303 703         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 126             | INR 12 099        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | 8 172           | CAD 11 629        | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 11 613      | \$ 8 172          | 0                  | (24)                  | (24)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 16           | INR 1 576         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 149             | 14 386            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 17 455      | \$ 12 444         | 351                | 0                     | 351                                     | 0,09                |
|              | 07/2026           | CHF 37          | 47                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 32           | INR 3 040         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 73          | \$ 52             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 75          | 95                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 2 354         | 2 727             | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 167           | 225               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 3 243       | 34                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14 877       | AUD 21 561        | 60                 | 0                     | 60                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 70 788          | € 62 320          | 466                | (4)                   | 462                                     | 0,11                |
|              | 07/2026           | 53              | INR 5 104         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 551             | ¥ 87 526          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 21 561      | \$ 14 868         | 0                  | (61)                  | (61)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | € 62 063        | 70 586            | 0                  | (466)                 | (466)                                   | (0,11)              |
|              | 09/2026           | \$ 114          | INR 10 937        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £ 117           | \$ 155            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12           | € 10              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 347             | £ 262             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 54              | INR 5 151         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | € 1 571         | \$ 1 828          | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 398           | 536               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 70           | INR 6 755         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 41              | 3 914             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 118 293       | \$ 137 994        | 2 750              | 0                     | 2 750                                   | 0,69                |
|              | 07/2026           | \$ 140 193      | € 123 247         | 715                | 0                     | 715                                     | 0,18                |
|              | 07/2026           | 1 005           | ¥ 159 738         | 0                  | (23)                  | (23)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 30              | SGD 39            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 123 247       | \$ 140 383        | 0                  | (713)                 | (713)                                   | (0,18)              |
|              | 08/2026           | SGD 39          | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 11 954      | 8 669             | 243                | 0                     | 243                                     | 0,06                |
|              | 07/2026           | \$ 75           | CAD 106           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 31 794          | £ 24 052          | 130                | 0                     | 130                                     | 0,03                |
|              | 08/2026           | CAD 106         | \$ 75             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 24 052        | 31 793            | 0                  | (129)                 | (129)                                   | (0,03)              |
| WST          | 07/2026           | \$ 138          | CHF 112           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 111         | \$ 138            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 6 715           | \$ (1 490)            | \$ 5 225                                | 1,29                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 2 157       | \$ 1 487          | \$ 0               | \$ (7)                | \$ (7)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 461        | AUD 2 052         | 0                  | (40)                  | (40)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 1 486           | 2 157             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD 266         | \$ 187            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 1 110           | 771               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 517        | AUD 2 127         | 0                  | (44)                  | (44)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 771             | 1 110             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 2 157       | \$ 1 487          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 36           | AUD 50            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 486           | 2 157             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD 879         | \$ 606            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 371          | AUD 522           | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 606             | 879               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 1 299           | 1 825             | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 23              | \$ (149)              | \$ (126)                                | (0,03)              |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | CHF 42          | \$ 54             | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 4            | CHF 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 7 431           | 5 801             | 0                  | (239)                 | (239)                                   | (0,06)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF 94          | \$ 119            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$ 8 617        | CHF 6 764         | 3                  | (235)                 | (232)                                   | (0,05)              |
| MYI          | 08/2026           | 10              | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 6 392       | \$ 7 901          | 0                  | (23)                  | (23)                                    | (0,01)              |
| SSB          | 08/2026           | \$ 7 901        | CHF 6 369         | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | 7 926           | 6 231             | 0                  | (202)                 | (202)                                   | (0,05)              |
| UAG          | 07/2026           | 4               | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 6 363       | \$ 7 881          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 881        | CHF 6 340         | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 37              | \$ (706)              | \$ (669)                                | (0,16)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 267           | \$ 305            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 62 774       | € 53 887          | 0                  | (1 167)               | (1 167)                                 | (0,29)              |
|              | 08/2026           | € 238           | \$ 271            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 1 355        | € 1 162           | 0                  | (27)                  | (27)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | € 50 785        | \$ 57 920         | 0                  | (142)                 | (142)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | \$ 57 998       | € 50 785          | 142                | 0                     | 142                                     | 0,04                |
| MBC          | 07/2026           | € 54 413        | \$ 61 809         | 5                  | (406)                 | (401)                                   | (0,10)              |
|              | 07/2026           | \$ 612          | € 529             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 61 534          | 54 104            | 407                | 0                     | 407                                     | 0,10                |
| SCX          | 07/2026           | 58 372          | 50 172            | 0                  | (1 010)               | (1 010)                                 | (0,25)              |
| SOG          | 07/2026           | € 54 104        | \$ 61 543         | 0                  | (314)                 | (314)                                   | (0,08)              |
|              | 07/2026           | \$ 62 470       | € 53 552          | 0                  | (1 245)               | (1 245)                                 | (0,31)              |
|              | 08/2026           | 61 627          | 54 104            | 313                | 0                     | 313                                     | 0,08                |
| SSB          | 07/2026           | 305             | 267               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 267           | \$ 305            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 868             | \$ (4 320)            | \$ (3 452)                              | (0,85)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 31 119       | £ 23 179          | \$ 0               | \$ (354)              | \$ (354)                                | (0,10)              |
| BOA          | 07/2026           | 15              | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 21 454        | \$ 28 294         | 1                  | (181)                 | (180)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 35 091       | £ 26 191          | 2                  | (332)                 | (330)                                   | (0,08)              |
|              | 08/2026           | 28 245          | 21 417            | 181                | 0                     | 181                                     | 0,05                |
| BRC          | 07/2026           | 301             | 227               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 60            | \$ 79             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 765          | £ 570             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 1 684           | 1 253             | 0                  | (21)                  | (21)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | £ 30            | \$ 39             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 33 617       | £ 25 053          | 0                  | (366)                 | (366)                                   | (0,09)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 110           | \$ 145            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 101          | £ 76              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £ 96            | \$ 129            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 5 248           | 6 906             | 0                  | (59)                  | (59)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 6 906        | £ 5 248           | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | £ 24 804        | \$ 32 830         | 0                  | (91)                  | (91)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$ 123          | £ 92              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 32 829          | 24 804            | 91                 | 0                     | 91                                      | 0,02                |
| SOG          | 07/2026           | £ 24 657        | \$ 32 572         | 0                  | (154)                 | (154)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 42           | £ 31              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 31            | \$ 42             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 32 571       | £ 24 657          | 154                | 0                     | 154                                     | 0,04                |
| SSB          | 07/2026           | £ 363           | \$ 480            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 480          | £ 363             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 493             | \$ (1 571)            | \$ (1 078)                              | (0,27)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | 1 668           | SEK 15 424        | \$ 0               | \$ (74)               | \$ (74)                                 | (0,02)              |
| BPS          | 07/2026           | 1 049           | 10 000            | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 1 827           | 16 882            | 0                  | (83)                  | (83)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 829             | 8 068             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SEK 11 971      | \$ 1 234          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 234           | SEK 11 950        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 18 083      | \$ 1 857          | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 783           | SEK 16 559        | 0                  | (72)                  | (72)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 2 164           | 21 029            | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           | 2 135           | 20 746            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 34              | \$ (259)              | \$ (225)                                | (0,06)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 1 519        | SGD 1 937         | \$ 0               | \$ (21)               | \$ (21)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 317             | 410               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD 340         | \$ 263            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 303        | SGD 1 664         | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 260             | 336               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD 5           | \$ 4              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 9               | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 20           | SGD 25            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 849         | \$ 655            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 543        | SGD 1 969         | 0                  | (21)                  | (21)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 655             | 847               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SGD 2           | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6            | SGD 7             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 3               | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD 182         | \$ 141            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 141          | SGD 182           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 4 185       | \$ 3 230          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 295          | SGD 376           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3 230           | 4 175             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | SGD 9           | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 7               | \$ (69)               | \$ (62)                                 | (0,02)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (387) (0,10)

Total des Investissements

\$ 401 213 98,80

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 4 879 1,20

Actif net

\$ 406 092 100,00

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

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

(a) Titre vendu avant l'émission.

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

(c) Titre convertible conditionnel.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 2 365 \$ (31 décembre 2025 : 561 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 4 260 \$ (31 décembre 2025 : 4 472 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 2 150 \$ (31 décembre 2025 : 2 070 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 386 346                                           | \$ 0                                              | \$ 386 346   |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 15 100                                               | 0                                                 | 15 100       |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (681)                                                                             | 448                                                  | 0                                                 | (233)        |
| Totaux                                        | \$ (681)                                                                          | \$ 401 894                                           | \$ 0                                              | \$ 401 213   |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 356 007                                           | \$ 0                                              | \$ 356 007        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 4 800                                                | 0                                                 | 4 800             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 873                                                                               | 1 195                                                | 0                                                 | 2 068             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 873</b>                                                                     | <b>\$ 362 002</b>                                    | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 362 875</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,530 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (506)         | \$ (507)                                 | (0,12)              |
| MYI                                           | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 049)        | (1 200)                                  | (0,30)              |
| SCX                                           | 3,400          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (525)         | (527)                                    | (0,13)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (2 234)</b>                        | <b>(0,55)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (325)                                                   | \$ 390                  | \$ 65                             | \$ 941                                                     | \$ (1 030)              | \$ (89)                           |
| BOA          | (102)                                                      | 0                       | (102)                             | 42                                                         | 0                       | 42                                |
| BPS          | (212)                                                      | 280                     | 68                                | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| BRC          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 1 623                                                      | (1 760)                 | (137)                             |
| CBK          | (79)                                                       | 0                       | (79)                              | 55                                                         | 0                       | 55                                |
| DUB          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (2)                                                        | 0                       | (2)                               |
| FAR          | 95                                                         | (260)                   | (165)                             | (790)                                                      | 880                     | 90                                |
| GLM          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 101                                                        | 0                       | 101                               |
| JPM          | (14)                                                       | 0                       | (14)                              | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| MBC          | (274)                                                      | 280                     | 6                                 | (809)                                                      | 790                     | (19)                              |
| MYI          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| NSL          | 13                                                         | 0                       | 13                                | 58                                                         | 0                       | 58                                |
| SCX          | (971)                                                      | 1 200                   | 229                               | 13                                                         | 0                       | 13                                |
| SOG          | 1 470                                                      | (1 510)                 | (40)                              | (150)                                                      | 400                     | 250                               |
| SSB          | 42                                                         | 0                       | 42                                | 77                                                         | 0                       | 77                                |
| UAG          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 21                                                         | 0                       | 21                                |
| WST          | (35)                                                       | 0                       | (35)                              | 48                                                         | 0                       | 48                                |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 77,33            | 80,74                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 12,35            | 11,85                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,86             | 0,69                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 3,54             | 1,26                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,20             | 0,25                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,10             | 0,13                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,92             | 1,52                 |
| Autres actifs                                                    | 3,70             | 3,56                 |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                             | 4,01             | 3,32                 |
| Autriche                                                                                              | 1,45             | 1,22                 |
| Belgique                                                                                              | 0,88             | 0,54                 |
| Brésil                                                                                                | 0,32             | 0,45                 |
| Canada                                                                                                | 3,03             | 2,69                 |
| Chili                                                                                                 | 0,95             | 0,72                 |
| République tchèque                                                                                    | 0,17             | 0,20                 |
| Danemark                                                                                              | 2,63             | 1,72                 |
| Finlande                                                                                              | 0,91             | 1,08                 |
| France                                                                                                | 6,07             | 5,38                 |
| Allemagne                                                                                             | 6,72             | 10,30                |
| Hong Kong                                                                                             | 0,28             | S/O                  |
| Hongrie                                                                                               | 0,30             | 0,31                 |
| Islande                                                                                               | 0,26             | 0,29                 |
| Inde                                                                                                  | 0,37             | 0,41                 |
| Irlande                                                                                               | 2,19             | 2,35                 |
| Italie                                                                                                | 1,07             | 1,48                 |
| Japon                                                                                                 | 2,68             | 2,72                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                          | S/O              | 0,25                 |
| Lettonie                                                                                              | 0,34             | 0,25                 |
| Luxembourg                                                                                            | 2,73             | 2,64                 |
| Île Maurice                                                                                           | 0,34             | 0,50                 |
| Mexique                                                                                               | 0,18             | S/O                  |
| Pays-Bas                                                                                              | 10,47            | 10,99                |
| Norvège                                                                                               | 2,16             | 1,71                 |
| Slovénie                                                                                              | 0,23             | 0,25                 |
| Corée du Sud                                                                                          | 1,07             | 0,38                 |
| Espagne                                                                                               | 3,47             | 2,79                 |
| Supranationales                                                                                       | 1,68             | 2,49                 |
| Suède                                                                                                 | 3,39             | 3,06                 |
| Émirats arabes unis                                                                                   | 1,32             | 0,35                 |
| Royaume-Uni                                                                                           | 10,34            | 11,27                |
| États-Unis                                                                                            | 22,98            | 23,72                |
| Îles Vierges britanniques                                                                             | 0,15             | 0,18                 |
| Contrats de mise en pension                                                                           | 3,72             | 1,29                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | 0,01             | 0,13                 |
| Option vendue                                                                                         |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O              | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                              |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                               | 0,03             | 0,10                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                              |                  |                      |
| Contrats de change à terme                                                                            | 1,29             | (1,15)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                   | (1,39)           | 1,48                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                | 1,20             | 2,14                 |
| Actif net                                                                                             | 100,00           | 100,00               |

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                    |                                     |                                  |                           |
| AUSTRALIE                                             |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement australien  |                                     |                                  |                           |
| 0,250 % éch. 21/11/2032                               | AUD 4 189                           | \$2 574                          | 0,22                      |
| 0,750 % éch. 21/11/2027                               | 4 599                               | 3 161                            | 0,28                      |
| Total Australe                                        |                                     | 5 735                            | 0,50                      |
| BRÉSIL                                                |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien   |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 23/04/2030                               | € 700                               | 803                              | 0,07                      |
| CANADA                                                |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien  |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 01/12/2050 (a)                           | CAD 258                             | 138                              | 0,01                      |
| 4,250 % éch. 01/12/2026 (a)                           | 3 060                               | 2 192                            | 0,19                      |
| Total Canada                                          |                                     | 2 330                            | 0,20                      |
| ÎLES CAIMANS                                          |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                            |                                     |                                  |                           |
| Canyon CLO Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,773 % éch. 15/10/2034                               | \$ 2 100                            | 2 102                            | 0,18                      |
| Sound Point CLO Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,028 % éch. 26/07/2031                               | 108                                 | 108                              | 0,01                      |
| 5,087 % éch. 18/04/2031                               | 409                                 | 410                              | 0,03                      |
| Symphony CLO Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,725 % éch. 19/04/2034                               | 3 100                               | 3 103                            | 0,27                      |
| 4,796 % éch. 23/10/2035                               | 2 300                               | 2 303                            | 0,20                      |
| Voya CLO Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,029 % éch. 14/07/2031                               | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
|                                                       |                                     | 8 026                            | 0,69                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                          |                                     |                                  |                           |
| 2,528 % éch. 18/11/2027                               | 114                                 | 111                              | 0,01                      |
| QNB Finance Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,538 % éch. 19/09/2027                               | 2 700                               | 2 699                            | 0,23                      |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                               | 1 000                               | 1 005                            | 0,09                      |
|                                                       |                                     | 3 815                            | 0,33                      |
| Total Îles Caïmans                                    |                                     | 11 841                           | 1,02                      |
| CÔSTA RICA                                            |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 27/04/2033                               | € 200                               | 244                              | 0,02                      |
| DANEMARK                                              |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           |
| Jyske Realkredit A/S                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                               | DKK 1 919                           | 232                              | 0,02                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                               | 2 752                               | 355                              | 0,03                      |
| 2,500 % éch. 01/10/2047                               | 1                                   | 0                                | 0,00                      |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                  |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 01/10/2043                               | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                               | 1 335                               | 142                              | 0,01                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                               | 998                                 | 129                              | 0,01                      |
| 2,500 % éch. 01/10/2047                               | 2                                   | 0                                | 0,00                      |
| Nykredit Realkredit A/S                               |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2052                               | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                               | 2 885                               | 353                              | 0,03                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                               | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/10/2047                               | 11                                  | 2                                | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 01/04/2053                               | 13 542                              | 2 016                            | 0,18                      |
| Realkredit Danmark A/S                                |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                               | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                               | 10 112                              | 1 257                            | 0,11                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                               | 847                                 | 101                              | 0,01                      |
| 2,500 % éch. 01/04/2047                               | 11                                  | 2                                | 0,00                      |
| Total Danemark                                        |                                     | 4 589                            | 0,40                      |
| FRANCE                                                |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement français    |                                     |                                  |                           |
| 0,100 % éch. 01/03/2029 (a)                           | € 19 517                            | 21 795                           | 1,89                      |
| 0,100 % éch. 25/07/2031 (a)                           | 10 432                              | 11 382                           | 0,98                      |
| 0,100 % éch. 25/07/2036 (a)                           | 6 087                               | 5 992                            | 0,52                      |
| 3,400 % éch. 25/07/2029 (a)                           | 15 796                              | 19 093                           | 1,65                      |
| Total France                                          |                                     | 58 262                           | 5,04                      |

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| IRLANDE                                                                                |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           |
| Ares European CLO DAC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,088 % éch. 20/04/2032                                                                | € 1 221                             | \$1 397                          | 0,12                      |
| Bain Capital Euro CLO DAC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 3,449 % éch. 15/01/2037                                                                | 6 000                               | 6 871                            | 0,59                      |
| Black Diamond CLO DAC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,263 % éch. 15/05/2032                                                                | 200                                 | 229                              | 0,02                      |
| BNPP AM Euro CLO DAC                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,804 % éch. 15/04/2031                                                                | 988                                 | 1 127                            | 0,10                      |
| Carlyle Euro CLO DAC                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,173 % éch. 15/08/2032                                                                | 170                                 | 195                              | 0,02                      |
| Dryden Euro CLO DAC                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,143 % éch. 15/05/2034                                                                | 667                                 | 762                              | 0,07                      |
| Harvest CLO DAC                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,464 % éch. 15/10/2038                                                                | 4 200                               | 4 809                            | 0,41                      |
| ICG Euro CLO DAC                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                                                                | 4 200                               | 4 807                            | 0,41                      |
| Madison Park Euro Funding DAC                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                                                                | 690                                 | 790                              | 0,07                      |
| Sculptor European CLO DAC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 3,365 % éch. 27/04/2038                                                                | 1 100                               | 1 260                            | 0,11                      |
| Toro European CLO DAC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,093 % éch. 15/02/2034                                                                | 2 691                               | 3 080                            | 0,27                      |
| 3,194 % éch. 15/07/2034                                                                | 1 933                               | 2 212                            | 0,19                      |
|                                                                                        |                                     | 27 539                           | 2,38                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |
| GS Mortgage-Backed Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,133 % éch. 24/11/2067                                                                | 3 333                               | 3 821                            | 0,33                      |
| Total Irlande                                                                          |                                     | 31 360                           | 2,71                      |
| ITALIE                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                                      |                                     |                                  |                           |
| 0,100 % éch. 15/05/2033 (a)                                                            | 30 479                              | 31 971                           | 2,76                      |
| 0,400 % éch. 15/05/2030 (a)                                                            | 32 115                              | 35 804                           | 3,09                      |
| 1,800 % éch. 15/05/2036 (a)                                                            | 13 316                              | 15 285                           | 1,32                      |
| 2,250 % éch. 15/02/2046 (a)                                                            | 4 508                               | 5 170                            | 0,45                      |
| 2,550 % éch. 15/09/2041 (a)                                                            | 1 574                               | 1 943                            | 0,17                      |
| 3,237 % éch. 15/10/2028                                                                | 6 700                               | 7 783                            | 0,67                      |
| 3,500 % éch. 15/02/2031                                                                | 25 800                              | 30 157                           | 2,61                      |
| Total Italie                                                                           |                                     | 128 113                          | 11,07                     |
| JAPON                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                                     |                                     |                                  |                           |
| 0,005 % éch. 10/03/2034 (a)                                                            | ¥ 253 459                           | 1 496                            | 0,13                      |
| 0,005 % éch. 10/03/2035 (a)                                                            | 112 778                             | 656                              | 0,05                      |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (a)                                                            | 1 437 068                           | 8 877                            | 0,77                      |
| 0,100 % éch. 10/03/2029 (a)                                                            | 4 452 486                           | 27 382                           | 2,37                      |
| 3,400 % éch. 20/12/2055                                                                | 890 000                             | 4 998                            | 0,43                      |
| Total Japon                                                                            |                                     | 43 409                           | 3,75                      |
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES                                                           |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           |
| GSG Bidco Ltd.                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 15/06/2031                                                                | € 500                               | 567                              | 0,05                      |
| 5,375 % éch. 15/06/2036                                                                | 500                                 | 568                              | 0,05                      |
| 6,375 % éch. 15/06/2051                                                                | 700                                 | 809                              | 0,07                      |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                     |                                     | 1 944                            | 0,17                      |
| KOWEÏT                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (c)                                                            | \$ 1 700                            | 1 697                            | 0,15                      |
| MEXIQUE                                                                                |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           |
| COX Asset Mexico S.A. de C.V.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 08/01/2032                                                                | 600                                 | 609                              | 0,05                      |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,850 % éch. 02/07/2032                                                                | 200                                 | 203                              | 0,02                      |
| 6,625 % éch. 29/01/2038                                                                | 200                                 | 205                              | 0,02                      |
|                                                                                        |                                     | 408                              | 0,04                      |
| Total Mexique                                                                          |                                     | 1 017                            | 0,09                      |

| DESCRIPTION                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais                     |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 20/09/2050                                                     | NZD 2 100                           | \$1 261                          | 0,11                      |
| PÉROU                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.                                |                                     |                                  |                           |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                                                     | PEN 500                             | 157                              | 0,01                      |
| ESPAGNE                                                                     |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol                          |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 30/04/2030                                                     | € 2 500                             | 2 633                            | 0,23                      |
| 0,650 % éch. 30/11/2027 (a)                                                 | 28 873                              | 32 951                           | 2,85                      |
| 0,700 % éch. 30/11/2033 (a)                                                 | 1 422                               | 1 577                            | 0,13                      |
| Total Espagne                                                               |                                     | 37 161                           | 3,21                      |
| SUEDE                                                                       |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement suédois                           |                                     |                                  |                           |
| 0,125 % éch. 01/12/2027                                                     | SEK 16 615                          | 1 695                            | 0,15                      |
| ÉMIRATS ARABES UNIS                                                         |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                               |                                     |                                  |                           |
| Emirates NBD Bank PJSC                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 29/06/2031                                                     | \$ 1 400                            | 1 395                            | 0,12                      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                                                     | 1 500                               | 1 500                            | 0,13                      |
|                                                                             |                                     | 2 895                            | 0,25                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi           |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                                     | 1 800                               | 1 794                            | 0,16                      |
| 4,875 % éch. 30/04/2029                                                     | 600                                 | 605                              | 0,05                      |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                                     | 600                                 | 610                              | 0,05                      |
|                                                                             |                                     | 3 009                            | 0,26                      |
| Total Émirats arabes unis                                                   |                                     | 5 904                            | 0,51                      |
| ACTIONS                                                                     |                                     |                                  |                           |
| ROYAUME-UNI                                                                 |                                     |                                  |                           |
| TITRES PRIVILÉGIÉS                                                          |                                     |                                  |                           |
| Nationwide Building Society                                                 |                                     |                                  |                           |
| 10,250 %                                                                    | 1 606                               | 275                              | 0,03                      |
| VALEUR NOMINALE (en milliers)                                               |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                       |                                     |                                  |                           |
| Bon du Trésor britannique                                                   |                                     |                                  |                           |
| 0,125 % éch. 10/08/2028 (a)                                                 | £ 39 541                            | 52 190                           | 4,51                      |
| 0,125 % éch. 22/03/2029 (a)                                                 | 14 658                              | 19 139                           | 1,65                      |
| 1,125 % éch. 22/11/2037 (a)                                                 | 2 458                               | 3 016                            | 0,26                      |
| 1,250 % éch. 22/11/2027 (a)                                                 | 17 933                              | 24 064                           | 2,08                      |
| 4,000 % éch. 22/10/2031                                                     | 12 800                              | 16 718                           | 1,45                      |
|                                                                             |                                     | 115 127                          | 9,95                      |
| Total Royaume-Uni                                                           |                                     | 115 402                          | 9,98                      |
| ÉTATS-UNIS                                                                  |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                  |                                     |                                  |                           |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/12/2033                                                     | \$ 513                              | 532                              | 0,05                      |
| Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 4,723 % éch. 25/10/2035                                                     | 1 300                               | 1 252                            | 0,11                      |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/10/2036                                                     | 1 618                               | 1 500                            | 0,13                      |
| BrightSpire Capital, Inc.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,089 % éch. 19/08/2043                                                     | 3 500                               | 3 506                            | 0,30                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,053 % éch. 25/09/2036                                                     | 238                                 | 233                              | 0,02                      |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                           |                                     |                                  |                           |
| 4,723 % éch. 25/02/2036                                                     | 570                                 | 561                              | 0,05                      |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,863 % éch. 25/05/2037                                                     | 294                                 | 287                              | 0,02                      |
| First Franklin Mortgage Loan Trust                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,073 % éch. 25/07/2036                                                     | 94                                  | 92                               | 0,01                      |
| Home Equity Asset Trust                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,618 % éch. 25/08/2034                                                     | 46                                  | 46                               | 0,00                      |







## Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                                    | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| DEU                                   | 3,650 %      | 24/06/2026        | 02/07/2026      | \$ 1 016             | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,875 % éch. 15/07/2035 | \$ (1 023)       | \$ 1 016                                 | \$ 1 017                                                           | 0,09                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                                                | \$ (1 023)       | \$ 1 016                                 | \$ 1 017                                                           | 0,09                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                          | Long  | 03/2027           | 486                | \$ (28)                           | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Long  | 09/2026           | 5                  | 2                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026           | 181                | 195                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026           | 136                | (90)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 54                 | 52                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026           | 245                | 358                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 89                 | (237)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 419                | (213)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026           | 829                | 75                                | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026           | 19                 | (42)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 586                | 152                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 16                 | (7)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 112                | 72                                | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 192                | 257                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Court | 09/2026           | 578                | (1 464)                           | (0,13)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 445                | 829                               | 0,07                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                        |       |                   |                    | \$ (89)                           | (0,01)              |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable                 | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour          | 3,500 %   | 18/03/2028      | £ 24 200          | \$ 208                            | 0,02                |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour          | 3,500     | 19/03/2030      | 22 000            | (334)                             | (0,03)              |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour          | 3,500     | 18/03/2031      | 18 730            | 99                                | 0,01                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour       | 0,300     | 20/09/2027      | ¥ 74 880          | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour       | 0,500     | 15/12/2031      | 986 000           | 44                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour       | 0,550     | 14/09/2028      | 2 370 000         | (30)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 15/12/2047      | \$ 1 750          | 92                                | 0,01                |
| À recevoir                        | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,428     | 20/12/2047      | 400               | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                        | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,478     | 20/12/2047      | 1 115             | 64                                | 0,01                |
| À recevoir                        | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,499     | 20/12/2047      | 570               | 33                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 2,237     | 21/11/2053      | 3 030             | 193                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 2,340     | 21/11/2028      | 37 090            | 1 116                             | 0,10                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 2,865     | 13/02/2054      | 18 600            | 1 541                             | 0,13                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 3,085     | 13/02/2034      | 3 200             | (14)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 3,325     | 31/08/2030      | 25 380            | 452                               | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 3,500     | 20/06/2054      | 4 600             | 423                               | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 3,564     | 31/01/2033      | 3 400             | 71                                | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 3,997     | 30/11/2030      | 3 200             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 3,998     | 15/11/2053      | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,000     | 30/11/2030      | 15 460            | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,000     | 15/02/2036      | 55 990            | 259                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,010     | 15/11/2053      | 10 600            | 194                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,015     | 15/11/2053      | 300               | 10                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,020     | 30/11/2030      | 3 660             | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,052     | 15/02/2056      | 2 500             | 52                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,075     | 15/11/2053      | 9 616             | 135                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,082     | 15/11/2053      | 300               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour           | 4,083     | 15/11/2053      | 4 400             | 93                                | 0,01                |
| À recevoir                        | BBR NZD à 3 mois                        | 3,250     | 21/03/2028      | NZD 900           | (27)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | EURIBOR EUR à 6 mois                    | 0,000     | 17/03/2053      | € 1 200           | 129                               | 0,01                |
| À recevoir                        | EURIBOR EUR à 6 mois                    | 0,190     | 04/11/2052      | 900               | 92                                | 0,01                |
| À recevoir                        | EURIBOR EUR à 6 mois                    | 0,195     | 04/11/2052      | 950               | 97                                | 0,01                |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,197 %   | 08/11/2052      | € 1 600           | \$ 165                            | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 35 440            | 294                               | 0,03                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,879     | 15/08/2032      | 13 400            | 166                               | 0,01                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 18/09/2026      | 36 300            | 252                               | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2046      | 5 000             | (156)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 16 240            | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,050     | 13/01/2056      | 3 830             | (170)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 1,636     | 15/06/2027      | 29 100            | 467                               | 0,04                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 1,946     | 15/03/2048      | 60                | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 1,998     | 15/07/2035      | 3 500             | 40                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,000     | 15/02/2027      | 44 800            | 549                               | 0,05                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,049     | 15/08/2034      | 3 800             | 24                                | 0,00                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,280     | 15/04/2046      | 4 400             | 43                                | 0,00                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,400     | 15/02/2044      | 3 400             | 138                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,470     | 15/07/2032      | 11 900            | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,488     | 15/05/2037      | 4 790             | 71                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,570     | 15/06/2032      | 1 450             | 6                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,580     | 15/03/2052      | 500               | 31                                | 0,00                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,590     | 15/03/2052      | 4 270             | 265                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,600     | 15/05/2032      | 6 300             | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,870     | 15/03/2028      | 42 600            | (397)                             | (0,03)              |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 1,798     | 25/08/2027      | \$ 1 000          | 37                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 1,890     | 27/08/2027      | 3 000             | 109                               | 0,01                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 1,954     | 03/06/2029      | 700               | (22)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 1,998     | 25/07/2029      | 3 600             | (108)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,155     | 17/10/2027      | 1 900             | (66)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 2,311     | 24/02/2031      | 5 100             | 116                               | 0,01                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,335     | 05/02/2028      | 2 680             | (85)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,353     | 09/05/2028      | 1 790             | (54)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,360     | 09/05/2028      | 2 690             | (81)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,364     | 10/05/2028      | 2 750             | (83)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 2,573     | 26/08/2028      | 1 100             | 28                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 2,645     | 10/09/2028      | 1 500             | 37                                | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 3,435     | 01/08/2026      | 7 300             | (58)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | FRCPXTOB                | 1,910     | 15/01/2038      | € 390             | 37                                | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,100     | 15/06/2031      | £ 2 300           | (40)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 3,365     | 15/09/2027      | 6 200             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,400     | 15/06/2030      | 1 610             | (26)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,466     | 15/09/2034      | 770               | 15                                | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,500     | 15/08/2034      | 3 500             | 70                                | 0,01                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,530     | 15/10/2031      | 540               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,066     | 15/09/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 4,530     | 15/04/2028      | 23 200            | (496)                             | (0,04)              |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 4,615     | 15/02/2027      | 1 600             | 17                                | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ 6 201                          | 0,54                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ 6 201                          | 0,54                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS VENDUES

| Contrepartie | Description                      | Indice initial | Taux variable                                                 | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM          | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 78,177      | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035        | 1 200                            | \$ (55) | \$ (25)      | 0,00                |

#### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,440 %         | 25/01/2027        | 2 800                            | \$ (25)  | \$ (5)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,440           | 25/01/2027        | 2 800                            | (25)     | (22)         | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,350           | 07/01/2027        | 15 200                           | (138)    | (18)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,350           | 07/01/2027        | 15 200                           | (138)    | (143)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,500           | 14/01/2027        | 20 600                           | (189)    | (41)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500           | 14/01/2027        | 20 600                           | (189)    | (144)        | (0,01)              |
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 27/08/2026        | 12 400                           | (71)     | (58)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 12 400                           | (72)     | (19)         | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   | \$ (847)                         | \$ (450) | (0,04)       |                     |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

## Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches      | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| DUB          | Indice CMBX.NA.AAA.8 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index                | 0,500 %              | 17/10/2057      | \$ 18                            | \$ (1)                 | \$ 1                              | \$ 0         | 0,00                |
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.8 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index                | 0,500                | 17/10/2057      | 22                               | (1)                    | 1                                 | 0            | 0,00                |
|              |                      |                      |                 |                                  | \$ (2)                 | \$ 2                              | \$ 0         | 0,00                |

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

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

### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | À recevoir         | Indice BCOMTR Index    | 137 916                      | 3,740 %       | \$ 45 371         | 15/06/2027      | \$ 0                   | \$ (1 873)                        | \$ (1 873)   | (0,16)              |
|              | À recevoir         | Indice BCOMTR1 Index   | 1 800 998                    | 3,760         | 232 849           | 15/06/2027      | 0                      | (9 615)                           | (9 615)      | (0,83)              |
| CBK          | À recevoir         | Indice BCOMF1TC Index  | 348 889                      | 3,760         | 56 698            | 15/06/2027      | 0                      | (2 225)                           | (2 225)      | (0,19)              |
|              | À recevoir         | Indice BCOMTR Index    | 162 911                      | 3,740         | 53 594            | 15/06/2027      | 0                      | (2 212)                           | (2 212)      | (0,19)              |
|              | À recevoir         | Indice CIXBSTR3 Index  | 693 551                      | 3,770         | 249 072           | 15/06/2027      | 0                      | (10 366)                          | (10 366)     | (0,90)              |
| GST          | À recevoir         | Indice BCOMF1TC Index  | 197 838                      | 3,760         | 104 258           | 15/04/2027      | 0                      | (4 091)                           | (4 091)      | (0,35)              |
|              | À recevoir         | Indice BCOMTR Index    | 133 694                      | 3,750         | 43 982            | 15/04/2027      | 0                      | (1 816)                           | (1 816)      | (0,16)              |
| JPM          | À recevoir         | Indice BCOMTR Index    | 196 063                      | 3,740         | 64 500            | 15/07/2026      | 0                      | (2 663)                           | (2 663)      | (0,23)              |
|              | À recevoir         | Indice JMABDEWU Index  | 494 170                      | 0,053         | 79 580            | 15/07/2026      | 0                      | (679)                             | (679)        | (0,06)              |
|              | À recevoir         | Indice JMABNIU5 Index  | 164 986                      | 0,000         | 39 399            | 15/07/2026      | 0                      | (1 771)                           | (1 771)      | (0,15)              |
|              | À recevoir         | Indice BCOMF1TC Index  | 315 223                      | 3,770         | 86 884            | 15/06/2027      | 0                      | (3 409)                           | (3 409)      | (0,30)              |
| MAC          | À recevoir         | Indice PIMCOBDBU Index | 356 644                      | 0,220         | 78 769            | 15/09/2026      | 0                      | (3 400)                           | (3 400)      | (0,29)              |
|              | À recevoir         | Indice PIMCOBDBV Index | 274 045                      | 0,600         | 24 663            | 15/03/2027      | 0                      | 592                               | 592          | 0,05                |
| MEI          | À recevoir         | Indice BCOMTR Index    | 302 019                      | 3,740         | 99 357            | 15/06/2027      | 0                      | (4 102)                           | (4 102)      | (0,36)              |
| SOG          | À recevoir         | Indice BCOMF1TC Index  | 19 744                       | 3,740         | 2 625             | 15/06/2027      | 0                      | (103)                             | (103)        | (0,01)              |
|              | À recevoir         | Indice BCOMTR Index    | 177 511                      | 3,720         | 58 397            | 15/06/2027      | 0                      | (2 410)                           | (2 410)      | (0,21)              |
|              |                    |                        |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (50 143)                       | \$ (50 143)  | (4,34)              |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 2 352             | \$ 1 682           | \$ 52                 | \$ 0                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 016             | 150                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 7 747             | 4 575              | 168                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | SGD             | 16                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 132               | CAD 188            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 543             | NZD 6 273          | 25                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 187               | \$ 132             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 6 273             | 3 547              | 0                     | (25)                                    | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 104               | 20                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 259 282           | 1 630              | 35                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 48 319            | 32                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 335             | 236                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 12                | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 041             | AUD 1 453          | 0                     | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 850               | CNH 5 748          | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 138               | £ 104              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 34                | INR 3 252          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 998               | NOK 9 270          | 0                     | (61)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 80                | PLN 303            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 196             | \$ 402             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 3 274             | 34                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 16 826            | 959                | 3                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 240               | INR 22 783         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL             | 2 465             | \$ 476             | 1                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 741               | 942                | 23                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 4 587             | 678                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 1 325             | 194                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 969               | 1 099              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 1 503             | 2 009              | 16                    | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 94 902 325        | 5 297              | 5                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 911             | 648                | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 185 740           | 1 934              | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 876 407           | 5 512              | 119                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 450 824           | 296                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 25 045            | 764                | 11                    | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 133               | BRL 673            | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 034             | INR 477 439        | 11                    | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 199             | KRW 1 839 022      | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 210               | TWD 6 613          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 07/2026           | \$              | ZAR               | 4 034              | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | \$                | 100                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 484                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | ILS               | 2 876              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | \$                | 610                | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 743                | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | IDR               | 60 336 904         | 4                     | (65)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 37 377             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | THB               | 4 573              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | IDR               | 7 033 171          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | \$                | 1 570              | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             |                   | 6 655              | 254                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | TRY             |                   | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | TRY               | 138 563            | 22                    | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | ZAR               | 19 924             | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | \$                | 1 504              | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 733                | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 1 233              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             |                   | 316                | 20                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             |                   | 2 061              | 93                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | IDR               | 19 245 537         | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 116 295            | 28                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | KRW               | 209 092            | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | PEN               | 322                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 1 849              | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | TWD               | 2 369              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | \$                | 1 238              | 41                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | ILS               | 764                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| DUB          | 09/2026           | IDR             | \$                | 2 244              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             |                   | 131                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 793                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | COP               | 3 611 348          | 96                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 13 575 669         | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | MXN               | 4 259              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | \$                | 524                | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | IDR               | 21 286 290         | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | \$                | 146                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 478                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | INR               | 30 763             | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | NOK               | 1 640              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 1 875              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 9 265              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
| FAR          | 09/2026           | IDR             | \$                | 1 437              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | IDR               | 8 484 448          | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 45 437             | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | \$                | 1 034              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             |                   | 674                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               |                   | 109 742            | 1 428                 | 0                                       | 0,12                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 665                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 678                | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             |                   | 16 617             | 227                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | CNH               | 12 193             | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 969                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | £                 | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 62 777             | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ¥                 | 6 429 066          | 0                     | (177)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 9 727              | 0                     | (64)                                    | (0,01)              |
| GLM          | 07/2026           |                 | SEK               | 11 333             | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 13 199             | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | \$                | 1 793              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 1 107              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             |                   | 695                | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               |                   | 39 735             | 178                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | SEK             |                   | 1 168              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 30 802             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | MXN               | 3 412              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | \$                | 838                | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             |                   | 269                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | BRL               | 88 107             | 687                   | (36)                                    | 0,06                |
|              | 07/2026           |                 | CAD               | 18 062             | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | IDR               | 18 360 015         | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | KRW               | 414 619            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | \$                | 12 693             | 0                     | (38)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 8 913              | 0                     | (38)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | INR               | 29 926             | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | \$                | 1 024              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 83                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 2 136              | 48                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | BRL               | 1 059              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 39 128 242         | 5                     | (15)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 128 397            | 12                    | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 09/2026           | \$ 425          | MXN 7 412         | \$ 0               | \$ (4)                | \$ (4)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 10 181      | 7 258             | 205                | 0                     | 205                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | BRL 77 709      | 15 101            | 87                 | 0                     | 87                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS 9 981       | 3 342             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 15 819      | 168               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 128 139     | 83                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 7 153       | 723               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 279         | 165               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 245        | £ 928             | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 157             | IDR 2 821 596     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 168             | INR 15 819        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 125             | KRW 191 209       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 177           | PLN 11 581        | 0                  | (96)                  | (96)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 570             | THB 19 042        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 6 330       | \$ 2 181          | 54                 | 0                     | 54                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$ 723          | NOK 7 157         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 2 837 276   | \$157             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 128 328     | 1 352             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 15 387      | 879               | 5                  | (1)                   | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 54 705      | 1 676             | 24                 | (6)                   | 18                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 444        | INR 137 674       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 14 441          | MXN 250 998       | 0                  | (167)                 | (167)                                   | (0,01)              |
|              | 10/2026           | 15 101          | BRL 79 420        | 0                  | (87)                  | (87)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | MXN 906         | \$ 52             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 526          | MXN 9 291         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 42          | \$ 30             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 7 185       | 9 128             | 227                | (6)                   | 221                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | € 6 882         | 8 000             | 132                | 0                     | 132                                     | 0,01                |
| MBC          | 07/2026           | £178            | 240               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 251 979     | 14                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 45 309      | 480               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 900 327     | 11 954            | 262                | 0                     | 262                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | KRW 831 684     | 549               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 2 307       | 232               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 237        | AUD 6 140         | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 799             | CHF 643           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 282           | DKK 21 513        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 691             | € 594             | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 740             | INR 71 305        | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 420             | NOK 3 897         | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 711             | SEK 6 920         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 649           | SGD 2 117         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 6 140       | \$ 4 234          | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 21 475      | 3 282             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 6 908       | 711               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 232          | NOK 2 308         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 14 335      | \$ 429            | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 000        | INR 191 329       | 10                 | (3)                   | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €155            | \$ 178            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £47             | 62                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 40          | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 398          | € 350             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 103             | £ 78              | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 230           | NZD 2 142         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 21              | SGD 27            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 953             | IDR 16 994 405    | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 748             | INR 71 968        | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 372             | TRY 17 488        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SCX          | 09/2026           | IDR 17 089 713  | \$ 953            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 466          | IDR 8 288 233     | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY 3 105       | \$ 455            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 365          | IDR 6 544 524     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 985             | INR 94 368        | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 146           | ¥ 182 100         | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | 776             | INR 74 332        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 20 083 683  | \$ 1 113          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 24 519      | 759               | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 188        | IDR 21 317 421    | 2                  | (8)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 7 774       | \$ 1 149          | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 18 092      | 2 817             | 50                 | 0                     | 50                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 225 397       | 262 935           | 5 239              | 0                     | 5 239                                   | 0,45                |
|              | 07/2026           | £4              | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 3 468 144     | 21 830            | 491                | 0                     | 491                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | SGD 28          | 22                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 438        | AUD 4 982         | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9 317           | CHF 7 537         | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 263 542         | € 231 685         | 1 344              | 0                     | 1 344                                   | 0,12                |
|              | 07/2026           | 9               | £ 7               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14 779          | SGD 19 139        | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 4 982       | \$ 3 435          | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 7 510       | 9 317             | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 231 685       | 263 899           | 0                  | (1 342)               | (1 342)                                 | (0,12)              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SSB          | 08/2026           | £ 7             | \$ 9              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 19 096      | 14 779            | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 22           | SGD 28            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 18 566      | \$ 13 464         | 378                | 0                     | 378                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | CHF 255         | 324               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 117          | CAD 165           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 108 870         | £ 82 361          | 444                | 0                     | 444                                     | 0,04                |
|              | 08/2026           | CAD 165         | \$ 117            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | £ 82 361        | 108 868           | 0                  | (445)                 | (445)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | \$ 969          | COP 3 695 193     | 92                 | 0                     | 92                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 514             | PLN 1 880         | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 2 086       | \$ 119            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 3 103       | 95                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 7 411 726   | 1 899             | 0                  | (168)                 | (168)                                   | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 13 100          | \$ (3 311)            | \$ 9 789                                | 0,85                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 5 231        | € 4 487           | \$ 0               | \$ (100)              | \$ (100)                                | (0,01)              |
| BPS          | 07/2026           | € 16 933        | \$ 19 269         | 0                  | (90)                  | (90)                                    | (0,01)              |
| CBK          | 07/2026           | \$ 188 280      | € 161 612         | 0                  | (3 510)               | (3 510)                                 | (0,30)              |
|              | 07/2026           | € 10 685        | \$ 12 462         | 246                | 0                     | 246                                     | 0,02                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 773          | € 663             | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 124 066       | \$ 141 497        | 0                  | (348)                 | (348)                                   | (0,03)              |
| MBC          | 08/2026           | \$ 141 687      | € 124 066         | 347                | 0                     | 347                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | € 209 225       | \$ 239 459        | 1 165              | (913)                 | 252                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 6 513        | € 5 614           | 0                  | (94)                  | (94)                                    | (0,01)              |
| SCX          | 08/2026           | € 157           | \$ 179            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 138 410      | € 121 697         | 914                | 0                     | 914                                     | 0,08                |
|              | 07/2026           | 180 569         | 155 204           | 0                  | (3 124)               | (3 124)                                 | (0,27)              |
| SOG          | 07/2026           | € 124 105       | \$ 141 181        | 0                  | (709)                 | (709)                                   | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$ 188 526      | € 161 612         | 0                  | (3 757)               | (3 757)                                 | (0,32)              |
| SSB          | 08/2026           | 141 372         | 124 105           | 709                | 0                     | 709                                     | 0,06                |
|              | 07/2026           | € 4 179         | \$ 4 764          | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 771        | € 4 179           | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 394           | \$ (12 674)           | \$ (9 280)                              | (0,80)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 8 281        | £ 6 168           | \$ 0               | \$ (94)               | \$ (94)                                 | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | 9               | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 6 381         | \$ 8 436          | 13                 | (46)                  | (33)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 9 281        | £ 6 926           | 0                  | (88)                  | (88)                                    | (0,01)              |
| BRC          | 08/2026           | 6 312           | 4 786             | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 83              | 62                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 266           | \$ 357            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 44           | £ 33              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 718             | 536               | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
| JPM          | 08/2026           | £ 128           | \$ 170            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 9 065        | £ 6 755           | 0                  | (99)                  | (99)                                    | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 622           | \$ 827            | 4                  | (2)                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14           | £ 11              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £ 159           | \$ 213            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 1 993           | 2 623             | 0                  | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | \$ 2 623        | £ 1 993           | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 5 972         | \$ 7 910          | 4                  | (21)                  | (17)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 23           | £ 17              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 7 456           | 5 633             | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 5 600         | \$ 7 397          | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 43           | £ 32              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | £ 32            | \$ 43             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 397        | £ 5 600           | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 312             | 236               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 147             | \$ (416)              | \$ (269)                                | (0,03)              |

## Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | SGD             | 557               | \$ 435             | \$ 4                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 386             | SGD 3 047          | 0                     | (30)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 38                | 49                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD             | 406               | \$ 314             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 788             | 1 388              | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 950               | SGD 1 212          | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
| BRC          | 08/2026           | SGD             | 27                | \$ 21              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 051             | 810                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 891             | SGD 3 689          | 0                     | (39)                                    | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           |                 | 810               | 1 049              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 1                 | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 256               | 199                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 114               | SGD 145            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 507               | \$ 391             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 314               | 243                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$              | 243               | SGD 313            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 251               | \$ 194             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 307             | 4 868              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$              | 2 985             | SGD 3 807          | 0                     | (42)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 4 868             | 6 292              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 652               | \$ 503             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           |                 | 190               | 147                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 31                | SGD 40             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 20              | \$ (137)              | \$ (117)                                | (0,01)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$(50 495) (4,37)

Total des Investissements

\$1 623 911 140,38

Autres actifs et passifs à court terme

\$(467 122) (40,38)

Actif net

\$ 1 156 789 100,00

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

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

<sup>A</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

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

(b) Affilié au Fonds.

(c) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804 % | 20/04/2033      | 13/04/2026   | \$ 1 700 | \$ 1 697     | 0,15                |

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 437 278 \$ (31 décembre 2025 : 199 593 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 12 889 \$ (31 décembre 2025 : 7 215 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 60 240 \$ (31 décembre 2025 : 2 390 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 1 667 246                                         | \$ 0                                              | \$ 1 667 246        |
| Fonds d'investissement                        | 32                                                                                | 0                                                    | 0                                                 | 32                  |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 1 016                                                | 0                                                 | 1 016               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 100                                                                               | (44 483)                                             | 0                                                 | (44 383)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 132</b>                                                                     | <b>\$ 1 623 779</b>                                  | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 1 623 911</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 282                                                                            | \$ 1 100 070                                         | \$ 0                                              | \$ 1 100 352        |
| Fonds d'investissement                        | 32                                                                                | 0                                                    | 0                                                 | 32                  |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 10 500                                               | 0                                                 | 10 500              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 144                                                                               | 15 373                                               | 0                                                 | 15 517              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 458</b>                                                                     | <b>\$ 1 125 943</b>                                  | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 1 126 401</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BSN                                           | 3,720 %        | 09/06/2026        | 15/07/2026      | \$ (80 057)      | \$ (80 239)                              | (6,94)              |
|                                               | 3,720          | 10/06/2026        | 15/07/2026      | (49 917)         | (50 025)                                 | (4,32)              |
| CIB                                           | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026      | (96 230)         | (96 497)                                 | (8,34)              |
| DEU                                           | 3,720          | 17/06/2026        | 01/07/2026      | (4 724)          | (4 730)                                  | (0,41)              |
|                                               | 3,730          | 29/06/2026        | 06/07/2026      | (10 583)         | (10 585)                                 | (0,92)              |
|                                               | 3,740          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (3 108)          | (3 108)                                  | (0,27)              |
|                                               | 3,750          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (4 015)          | (4 015)                                  | (0,35)              |
| JPS                                           | 3,720          | 08/06/2026        | 06/07/2026      | (26 790)         | (26 854)                                 | (2,32)              |
|                                               | 3,720          | 16/06/2026        | 07/07/2026      | (12 285)         | (12 304)                                 | (1,06)              |
|                                               | 3,740          | 23/06/2026        | 07/07/2026      | (7 064)          | (7 070)                                  | (0,61)              |
|                                               | 3,740          | 24/06/2026        | 15/07/2026      | (21 856)         | (21 872)                                 | (1,89)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026      | (102 136)        | (102 147)                                | (8,83)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (419 446 )</b>                     | <b>(36,26)</b>      |

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 127                                                     | \$ 0                    | \$ 127                            | \$ 135                                                     | \$ 0                    | \$ 135                            |
| BOA          | (187)                                                      | 200                     | 13                                | 24                                                         | (30)                    | (6)                               |
| BPS          | (15 100)                                                   | 16 580                  | 1 480                             | 1 475                                                      | (4 950)                 | (3 475)                           |
| BRC          | 238                                                        | (280)                   | (42)                              | 1 205                                                      | (1 370)                 | (165)                             |
| CBK          | (14 270)                                                   | 15 880                  | 1 610                             | 2 634                                                      | (8 410)                 | (5 776)                           |
| DUB          | (15)                                                       | 0                       | (15)                              | 6                                                          | 0                       | 6                                 |
| FAR          | 1 596                                                      | (1 720)                 | (124)                             | (1 824)                                                    | 2 130                   | 306                               |
| GLM          | 303                                                        | (1 040)                 | (737)                             | (345)                                                      | (480)                   | (825)                             |
| GST          | (5 907)                                                    | 6 640                   | 733                               | 955                                                        | (3 160)                 | (2 205)                           |
| JPM          | (8 613)                                                    | 9 030                   | 417                               | 1 381                                                      | (3 690)                 | (2 309)                           |
| MAC          | (2 808)                                                    | 3 070                   | 262                               | 845                                                        | (1 370)                 | (525)                             |
| MBC          | 1 667                                                      | (1 740)                 | (73)                              | 847                                                        | (1 080)                 | (233)                             |
| MEI          | (4 102)                                                    | 4 570                   | 468                               | 223                                                        | (950)                   | (727)                             |
| MYI          | (8)                                                        | 0                       | (8)                               | (2)                                                        | (20)                    | (22)                              |
| NSL          | 10                                                         | 0                       | 10                                | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 5                                                          | 0                       | 5                                 |
| SCX          | (3 118)                                                    | 3 330                   | 212                               | 125                                                        | 0                       | 125                               |
| SOG          | (603)                                                      | 940                     | 337                               | 1 087                                                      | (2 490)                 | (1 403)                           |
| SSB          | 477                                                        | (530)                   | (53)                              | 12                                                         | 0                       | 12                                |
| UAG          | (182)                                                      | 0                       | (182)                             | (148)                                                      | 260                     | 112                               |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 68,81            | 76,41                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé      | 16,93            | 16,84                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,15             | 0,06                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,05             | 0,89                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,10             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,44             | 0,77                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,89             | 1,14                 |
| Autres actifs                                                    | 12,63            | 3,81                 |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.



## Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                        | 0,50             | 0,64                 |
| Brésil                                                           | 0,07             | S/O                  |
| Canada                                                           | 0,20             | 0,29                 |
| Îles Caïmans                                                     | 1,02             | 1,09                 |
| Costa Rica                                                       | 0,02             | S/O                  |
| Danemark                                                         | 0,40             | 0,57                 |
| France                                                           | 5,04             | 3,70                 |
| Irlande                                                          | 2,71             | 2,54                 |
| Italie                                                           | 11,07            | 3,34                 |
| Japon                                                            | 3,75             | 5,45                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                     | 0,17             | S/O                  |
| Koweït                                                           | 0,15             | S/O                  |
| Mexique                                                          | 0,09             | 0,05                 |
| Nouvelle-Zélande                                                 | 0,11             | 0,15                 |
| Pérou                                                            | 0,01             | 0,03                 |
| Espagne                                                          | 3,21             | 4,48                 |
| Suède                                                            | 0,15             | 0,25                 |
| Émirats arabes unis                                              | 0,51             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                      | 9,98             | 9,21                 |
| États-Unis                                                       | 104,97           | 99,73                |
| Fonds d'investissement                                           | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,09             | 1,25                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                    | (0,01)           | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                          | 0,54             | 0,82                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         |                  |                      |
| Options vendues                                                  |                  |                      |
| Options plafonnées sur l'inflation                               | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                      | (0,04)           | (0,05)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de rendement total sur indices                             | (4,34)           | 0,98                 |
| Contrats de change à terme                                       | 0,85             | (0,41)               |
| Contrats de change à terme couverts                              | (0,84)           | 0,51                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                           | (40,38)          | (34,62)              |
| Actif net                                                        | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |  |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                     |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | CAB SELAS                   |                                     |                                  |                           |  |
| AUSTRALIE                                                                              |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd.                             |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 09/08/2031     |                                     |                                  |                           |  |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/11/2027 \$                            |                                     |                                  |                           | € 1 600 \$ 1 830            |                                     |                                  |                           |  |
| Panorama Auto Trust                                                                    | AUD                                 | 1 000                            | \$693                     | 0,28                                                  | QNB Finance Ltd.                    |                                  |                           |                             | 7,250 % éch. 23/09/2028 (d)(f)      |                                  |                           |  |
| 5,367 % éch. 20/05/2034                                                                |                                     |                                  |                           |                                                       | 3 300                               | 3 299                            | 1,35                      | Eramet S.A.                 |                                     |                                  |                           |  |
| Plenti PL & Green ABS Trust                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       | 300                                 | 302                              | 0,12                      | 6,500 % éch. 30/11/2029     |                                     |                                  |                           |  |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                                                                | 1 116                               | 772                              | 0,32                      |                                                       |                                     |                                  |                           | New Immo Holding S.A.       |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 23/04/2031     |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        |                                     | 1 465                            | 0,60                      | Total Îles Caïmans                                    |                                     |                                  |                           | 1 400 1 608 0,65            |                                     |                                  |                           |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | CHILI                                                 |                                     |                                  |                           | SEB S.A.                    |                                     |                                  |                           |  |
| Ausgrid Finance Pty. Ltd.                                                              |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 24/06/2030     |                                     |                                  |                           |  |
| 0,875 % éch. 07/10/2031                                                                |                                     |                                  |                           | Chile Electricity PEC SpA                             |                                     |                                  |                           | 2 400 2 699 1,10            |                                     |                                  |                           |  |
| Origin Energy Finance Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 25/01/2028 (c)                           |                                     |                                  |                           | Ubisoft Entertainment S.A.  |                                     |                                  |                           |  |
| 1,000 % éch. 17/09/2029                                                                |                                     |                                  |                           | 1 036 957 0,39                                        |                                     |                                  |                           | 0,878 % éch. 24/11/2027 (g) |                                     |                                  |                           |  |
| Virgin Australia Holdings Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 8,125 % éch. 15/11/2024 ^                                                              |                                     |                                  |                           | Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos        |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        | \$                                  | 373                              | 3                         | 0,00                                                  | 6,000 % éch. 01/04/2033 CLP         | 1 890 000                        | 2 123 0,86                |                             |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        |                                     |                                  | 1 010                     | 0,41                                                  | Total Chili                         |                                  |                           |                             | 500 506 0,21                        |                                  |                           |  |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | ACTIONS                                               |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Triton Bond Trust                                                                      |                                     |                                  |                           | CHINE                                                 |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 5,250 % éch. 15/02/2058                                                                |                                     |                                  |                           | ACTIONS ORDINAIRES                                    |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| AUD 2 000 1 382 0,56                                                                   |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (b)                         |                                     |                                  |                           | 1 0,00                      |                                     |                                  |                           |  |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           | VALEUR NOMINALE (en milliers)                         |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| New South Wales Treasury Corp.                                                         |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 1,750 % éch. 20/03/2034                                                                |                                     |                                  |                           | Yango Justice International Ltd.                      |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Treasury Corp. of Victoria                                                             |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/04/2024 ^ \$                          |                                     |                                  |                           | 200 1 0,00                  |                                     |                                  |                           |  |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                                                                |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 15/04/2023 ^                             |                                     |                                  |                           | 200 1 0,00                  |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        | 50                                  | 27                               | 0,01                      |                                                       |                                     |                                  |                           | 2 0,00                      |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        | 130                                 | 63                               | 0,03                      | Total Chine                                           |                                     |                                  |                           | 3 0,00                      |                                     |                                  |                           |  |
|                                                                                        |                                     | 90                               | 0,04                      | COLOMBIE                                              |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Total Australie                                                                        |                                     | 3 947                            | 1,61                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| BELGIQUE                                                                               |                                     |                                  |                           | Grupo Nutresa S.A.                                    |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 12/05/2030                               |                                     |                                  |                           | 1 100 1 167 0,47            |                                     |                                  |                           |  |
| UCB S.A.                                                                               |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 12/05/2035                               |                                     |                                  |                           | 1 300 1 447 0,59            |                                     |                                  |                           |  |
| 5,200 % éch. 21/11/2029                                                                |                                     |                                  |                           | 2 614 1,06                                            |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| € 500 600 0,24                                                                         |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| BERMUDES                                                                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement colombien   |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 26/11/2030 €                             |                                     |                                  |                           | 100 115 0,05                |                                     |                                  |                           |  |
| Armor RE Ltd.                                                                          |                                     |                                  |                           | TES colombien                                         |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 8,810 % éch. 07/06/2033                                                                |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 22/08/2029 COP                          |                                     |                                  |                           | 5 991 200 1 686 0,69        |                                     |                                  |                           |  |
| € 200 232 0,10                                                                         |                                     |                                  |                           | 11,750 % éch. 24/01/2035                              |                                     |                                  |                           | 7 328 400 2 088 0,85        |                                     |                                  |                           |  |
| Athora Holding Ltd.                                                                    | €                                   | 200                              | 232                       | 0,10                                                  | 12,750 % éch. 28/11/2040            |                                  |                           |                             | 4 347 100 1 315 0,53                |                                  |                           |  |
| 5,375 % éch. 16/12/2037                                                                |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 5 204 2,12                  |                                     |                                  |                           |  |
| Bayou Re Ltd.                                                                          | \$                                  | 250                              | 249                       | 0,10                                                  | Total Colombie                      |                                  |                           |                             | 7 818 3,18                          |                                  |                           |  |
| 10,020 % éch. 09/05/2033                                                               |                                     |                                  |                           | COSTA RICA                                            |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Cape Lookout Re Ltd.                                                                   |                                     | 250                              | 250                       | 0,10                                                  | ÉMISSIONS SOUVERAINES               |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 9,520 % éch. 21/03/2033                                                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Citrus Re Ltd.                                                                         |                                     | 250                              | 253                       | 0,11                                                  | 6,001 % éch. 16/01/2036 €           |                                  |                           |                             | 250 303 0,12                        |                                  |                           |  |
| 9,060 % éch. 07/06/2033                                                                |                                     |                                  |                           | EPH Financing International A/S                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Locke Tavern Re Ltd.                                                                   |                                     | 250                              | 249                       | 0,10                                                  | 6,651 % éch. 13/11/2028             |                                  |                           |                             | 1 200 1 458 0,59                    |                                  |                           |  |
| 6,800 % éch. 11/04/2033                                                                |                                     |                                  |                           | DANEMARK                                              |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Mayflower Re Ltd.                                                                      |                                     | 250                              | 250                       | 0,10                                                  | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 8,565 % éch. 08/07/2030                                                                |                                     |                                  |                           | TDC Net A/S                                           |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Torrey Pines Re Ltd.                                                                   |                                     | 250                              | 250                       | 0,10                                                  | 5,000 % éch. 09/08/2032             |                                  |                           |                             | 100 119 0,05                        |                                  |                           |  |
| 6,539 % éch. 07/06/2033                                                                |                                     | 250                              | 252                       | 0,10                                                  | 5,618 % éch. 06/02/2030             |                                  |                           |                             | 1 200 1 451 0,59                    |                                  |                           |  |
| 6,789 % éch. 07/06/2034                                                                |                                     | 250                              | 251                       | 0,10                                                  | Total Danemark                      |                                  |                           |                             | 1 570 0,64                          |                                  |                           |  |
| 7,536 % éch. 07/06/2034                                                                |                                     | 250                              | 256                       | 0,11                                                  | FRANCE                              |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 9,810 % éch. 07/06/2034                                                                |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Valaris Ltd.                                                                           |                                     | 375                              | 390                       | 0,16                                                  | Altrad Investment Authority S.A.S.  |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 8,375 % éch. 30/04/2030                                                                |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 23/06/2032                               |                                     |                                  |                           | 800 920 0,37                |                                     |                                  |                           |  |
| Total Bermudes                                                                         |                                     |                                  | 3 132                     | 1,28                                                  | BNP Paribas Cardif S.A.             |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| CANADA                                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 19/12/2033 (d)(f)                        |                                     |                                  |                           | 600 702 0,29                |                                     |                                  |                           |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Air Canada Pass-Through Trust                                                          |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 3,300 % éch. 15/07/2031                                                                |                                     |                                  |                           | 31                                                    | 29                                  | 0,01                             |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| CI Financial Corp.                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 4,625 % éch. 12/12/2031                                                                |                                     |                                  |                           | € 3 600                                               | 4 173                               | 1,70                             |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| Total Canada                                                                           |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     | 1,71                             |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| ILES CAÏMANS                                                                           |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| BCRED PC Static LLC                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |
| 4,974 % éch. 27/04/2036                                                                |                                     |                                  |                           | \$ 250                                                | 250                                 | 0,10                             |                           |                             |                                     |                                  |                           |  |

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

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ISRAËL</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.                          |                                     |                                  |                           |
| 5,343 % éch. 29/06/2029 \$                         | 1 200                               | \$1 205                          | 0,49                      |
| 5,642 % éch. 29/06/2033                            | 600                                 | 603                              | 0,25                      |
| Total Israël                                       |                                     | 1 808                            | 0,74                      |
| <b>JAPON</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais |                                     |                                  |                           |
| 3,200 % éch. 20/09/2055 ¥                          | 463 900                             | 2 506                            | 1,02                      |
| <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| GSG Bidco Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 15/06/2031 €                          | 400                                 | 454                              | 0,19                      |
| 5,375 % éch. 15/06/2036                            | 400                                 | 454                              | 0,18                      |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                 |                                     | 908                              | 0,37                      |
| <b>ACTIONS</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| SES S.A. (b)                                       | 7 496                               | 113                              | 0,05                      |
| <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| CPI Property Group S.A.                            |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 22/01/2028 £                          | 500                                 | 646                              | 0,26                      |
| 6,000 % éch. 27/01/2032 €                          | 800                                 | 900                              | 0,37                      |
| 6,875 % éch. 05/02/2033 £                          | 1 050                               | 1 301                            | 0,53                      |
| HLD Europe S.C.A.                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 02/04/2030 €                          | 200                                 | 231                              | 0,09                      |
| Motion Finco SARL                                  |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 15/06/2030                            | 1 100                               | 1 097                            | 0,45                      |
| Nova Securitisation SARL                           |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 03/02/2031 \$                         | 2 000                               | 1 930                            | 0,78                      |
| Novartis Finance S.A.                              |                                     |                                  |                           |
| 3,100 % éch. 13/01/2032 €                          | 700                                 | 800                              | 0,33                      |
| SELP Finance SARL                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 21/04/2031                            | 200                                 | 231                              | 0,09                      |
|                                                    |                                     | 7 136                            | 2,90                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           |
| Eagle Funding Luxco SARL                           |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/08/2030 \$                         | 2 500                               | 2 513                            | 1,02                      |
| Total Luxembourg                                   |                                     | 9 762                            | 3,97                      |
| <b>MEXIQUE</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Banco Nacional de Mexico S.A.                      |                                     |                                  |                           |
| 6,697 % éch. 07/08/2036 (f)                        | 500                                 | 493                              | 0,20                      |
| COX Asset Mexico S.A. de C.V.                      |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 08/01/2032                            | 200                                 | 203                              | 0,08                      |
| Total Mexique                                      |                                     | 696                              | 0,28                      |
| <b>PAYS-BAS</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Airbus SE                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 13/05/2033 €                          | 200                                 | 228                              | 0,09                      |
| Arcadis NV                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 20/05/2031                            | 700                                 | 804                              | 0,33                      |
| Flora Food Management BV                           |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 02/07/2029                            | 1 100                               | 1 231                            | 0,50                      |
| 7,500 % éch. 31/10/2030                            | 400                                 | 456                              | 0,18                      |
| Simon Global Development BV                        |                                     |                                  |                           |
| 3,650 % éch. 15/06/2031                            | 700                                 | 807                              | 0,33                      |
| Stellantis NV                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 16/12/2033 (d)                        | 400                                 | 447                              | 0,18                      |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV         |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 01/06/2031                            | 2 600                               | 2 996                            | 1,22                      |
| Veon Midco BV                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,950 % éch. 01/06/2031 \$                         | 1 200                               | 1 199                            | 0,49                      |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                            | 1 200                               | 1 198                            | 0,49                      |

| DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VZ Secured Financing BV</b>                                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/01/2033 \$                                                                    | 1 300                               | \$1 245                          | 0,51                      |
|                                                                                               |                                     | 10 611                           | 4,32                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| Jubilee Place BV                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 17/10/2061 €                                                                     | 2 770                               | 3 165                            | 1,29                      |
| Total Pays-Bas                                                                                |                                     | 13 776                           | 5,61                      |
| <b>PAKISTAN</b>                                                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,975 % éch. 24/04/2029 \$                                                                    | 900                                 | 903                              | 0,37                      |
| <b>PÉROU</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 12/08/2034 PEN                                                                   | 500                                 | 143                              | 0,06                      |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                                                                       | 543                                 | 172                              | 0,07                      |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                                                                       | 526                                 | 176                              | 0,07                      |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                                                       | 5 900                               | 1 939                            | 0,79                      |
| Total Pérou                                                                                   |                                     | 2 430                            | 0,99                      |
| <b>POLOGNE</b>                                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement polonais                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 25/10/2035 PLN                                                                   | 15 600                              | 4 089                            | 1,67                      |
| <b>QATAR</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| QatarEnergy                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 23/06/2029 \$                                                                    | 800                                 | 795                              | 0,32                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                                                       | 1 800                               | 1 810                            | 0,74                      |
| Total Qatar                                                                                   |                                     | 2 605                            | 1,06                      |
| <b>SERBIE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement serbe                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 06/05/2031 €                                                                     | 1 000                               | 1 146                            | 0,47                      |
| 4,875 % éch. 06/05/2038                                                                       | 1 000                               | 1 145                            | 0,46                      |
| Total Serbie                                                                                  |                                     | 2 291                            | 0,93                      |
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                                        |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 31/03/2032 ZAR                                                                   | 200                                 | 12                               | 0,00                      |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                                                       | 3 900                               | 237                              | 0,10                      |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                                                       | 39 912                              | 2 524                            | 1,03                      |
| Total Afrique du Sud                                                                          |                                     | 2 773                            | 1,13                      |
| <b>ESPAGNE</b>                                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 8,375 % éch. 21/06/2028 (d)(f)                                                                | € 1 000                             | 1 236                            | 0,50                      |
| Banco Santander S.A.                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 03/12/2035 (d)(f)                                                                | \$ 600                              | 610                              | 0,25                      |
| Molins Finance S.A.                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 15/06/2033 €                                                                     | 300                                 | 359                              | 0,15                      |
| Total Espagne                                                                                 |                                     | 2 205                            | 0,90                      |
| <b>SUÈDE</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| PPI Public Property Invest AB                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 21/04/2029                                                                       | 800                                 | 910                              | 0,37                      |
| 3,875 % éch. 16/10/2031                                                                       | 1 300                               | 1 473                            | 0,60                      |
| Sagax AB                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 26/01/2031                                                                       | 1 200                               | 1 353                            | 0,55                      |
| 4,375 % éch. 29/05/2030                                                                       | 300                                 | 352                              | 0,15                      |
| Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB                                                     |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 14/11/2028                                                                       | 700                                 | 708                              | 0,29                      |

| DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 1,125 % éch. 26/09/2029 €                                                                     | 700                                 | \$670                            | 0,27                      |
| Total Suède                                                                                   |                                     | 5 466                            | 2,23                      |
| <b>SUISSE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| UBS Group AG                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 13/11/2028 (d)(f)                                                                | \$ 500                              | 538                              | 0,22                      |
| <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi                             |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                                                       | 1 200                               | 1 196                            | 0,48                      |
| 4,875 % éch. 30/04/2029                                                                       | 700                                 | 705                              | 0,29                      |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                                                       | 700                                 | 712                              | 0,29                      |
| Total Émirats arabes unis                                                                     |                                     | 2 613                            | 1,06                      |
| <b>ROYAUME-UNI</b>                                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| Anglian Water Osprey Financing PLC                                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 31/07/2028 £                                                                     | 300                                 | 369                              | 0,15                      |
| 6,750 % éch. 27/08/2031                                                                       | 1 100                               | 1 471                            | 0,60                      |
| Burberry Group PLC                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 20/06/2030                                                                       | 975                                 | 1 307                            | 0,53                      |
| Chanel Ceres PLC                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 31/07/2031 €                                                                     | 1 000                               | 1 011                            | 0,41                      |
| EC Finance PLC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 15/10/2026                                                                       | 1 300                               | 1 484                            | 0,60                      |
| Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,950 % éch. 27/01/2029 \$                                                                    | 500                                 | 407                              | 0,17                      |
| Informa PLC                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 29/04/2032 €                                                                     | 2 100                               | 2 406                            | 0,98                      |
| Lloyds Banking Group PLC                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 27/06/2029 (d)(f) £                                                              | 1 200                               | 1 663                            | 0,68                      |
| Marex Group PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,680 % éch. 21/04/2031 \$                                                                    | 1 900                               | 1 901                            | 0,77                      |
| Nationwide Building Society                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 20/06/2027 (d)(f) £                                                              | 1 000                               | 1 329                            | 0,54                      |
| NatWest Group PLC                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,583 % éch. 01/03/2028 \$                                                                    | 200                                 | 201                              | 0,08                      |
| Northumbrian Water Finance PLC                                                                |                                     |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 05/10/2027 £                                                                     | 1 200                               | 1 543                            | 0,63                      |
| 4,500 % éch. 14/02/2031                                                                       | 1 400                               | 1 796                            | 0,73                      |
| Sage Group PLC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 1,625 % éch. 25/02/2031                                                                       | 1 225                               | 1 379                            | 0,56                      |
| Smith & Nephew PLC                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 20/03/2027 \$                                                                    | 100                                 | 100                              | 0,04                      |
| SW Finance PLC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 28/05/2028 £                                                                     | 350                                 | 438                              | 0,18                      |
| 6,125 % éch. 19/11/2033                                                                       | 400                                 | 509                              | 0,21                      |
| 6,875 % éch. 07/08/2032                                                                       | 400                                 | 535                              | 0,22                      |
| 7,750 % éch. 31/10/2031                                                                       | 600                                 | 827                              | 0,34                      |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                                                          |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                                                                       | 522                                 | 737                              | 0,30                      |
| TP ICAP Finance PLC                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 2,625 % éch. 18/11/2028                                                                       | 1 600                               | 2 003                            | 0,81                      |
| 7,875 % éch. 17/04/2030                                                                       | 1 400                               | 1 995                            | 0,81                      |
| Vmed O2 UK Financing PLC                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 15/04/2032 €                                                                     | 1 800                               | 1 814                            | 0,74                      |
| 7,750 % éch. 15/04/2032 \$                                                                    | 1 400                               | 1 266                            | 0,52                      |
| Yorkshire Water Finance PLC                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 18/11/2034 £                                                                     | 1 900                               | 2 583                            | 1,05                      |
|                                                                                               |                                     | 31 074                           | 12,65                     |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| Bletchley Park Funding PLC                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,604 % éch. 27/07/2070                                                                       | 641                                 | 852                              | 0,35                      |
| Harvest Funding PLC                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                       | 500                                 | 664                              | 0,27                      |
|                                                                                               |                                     | 1 516                            | 0,62                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Bon du Trésor britannique                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 31/07/2054                                                                       | 758                                 | 846                              | 0,34                      |
| Total Royaume-Uni                                                                             |                                     | 33 436                           | 13,61                     |

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉTATS-UNIS</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust        |                                     |                                  |                           |
| 4,588 % éch. 25/12/2045                            | \$ 212                              | \$ 164                           | 0,07                      |
| Argent Securities Trust                            |                                     |                                  |                           |
| 3,913 % éch. 25/09/2036                            | 699                                 | 222                              | 0,09                      |
| 4,123 % éch. 25/04/2036                            | 248                                 | 75                               | 0,03                      |
| 4,323 % éch. 25/04/2036                            | 605                                 | 183                              | 0,07                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/12/2036                            | 1 396                               | 781                              | 0,32                      |
| First Franklin Mortgage Loan Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 5,188 % éch. 25/10/2034                            | 166                                 | 167                              | 0,07                      |
| GSAMP Trust                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,853 % éch. 25/01/2037                            | 315                                 | 194                              | 0,08                      |
| 4,003 % éch. 25/12/2036                            | 456                                 | 225                              | 0,09                      |
| 4,223 % éch. 25/12/2046                            | 566                                 | 279                              | 0,11                      |
| MAST Ltd.                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,134 % éch. 15/02/2051                            | 488                                 | 479                              | 0,19                      |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/08/2036                            | 418                                 | 144                              | 0,06                      |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust             |                                     |                                  |                           |
| 3,883 % éch. 25/11/2037                            | 62                                  | 18                               | 0,01                      |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust             |                                     |                                  |                           |
| 3,893 % éch. 25/01/2037                            | 305                                 | 139                              | 0,06                      |
| 3,903 % éch. 25/10/2036                            | 241                                 | 104                              | 0,04                      |
| 4,063 % éch. 25/09/2036                            | 1 647                               | 553                              | 0,23                      |
| 4,223 % éch. 25/09/2036                            | 53                                  | 22                               | 0,01                      |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust              |                                     |                                  |                           |
| 3,863 % éch. 25/04/2037                            | 53                                  | 27                               | 0,01                      |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 6,465 % éch. 25/09/2046                            | 570                                 | 186                              | 0,08                      |
| New Century Home Equity Loan Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 6,763 % éch. 25/01/2033                            | 42                                  | 36                               | 0,01                      |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                    |                                     |                                  |                           |
| 2,675 % éch. 25/06/2036                            | 444                                 | 331                              | 0,13                      |
| 4,063 % éch. 25/09/2036                            | 713                                 | 273                              | 0,11                      |
| Option One Mortgage Loan Trust                     |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/03/2037                            | 435                                 | 210                              | 0,09                      |
| RCKT Mortgage Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 5,321 % éch. 25/06/2056                            | 150                                 | 150                              | 0,06                      |
| Residential Asset Mortgage Products Trust          |                                     |                                  |                           |
| 4,148 % éch. 25/12/2035                            | 921                                 | 777                              | 0,32                      |
| Residential Asset Securities Corp. Trust           |                                     |                                  |                           |
| 4,643 % éch. 25/08/2034                            | 203                                 | 206                              | 0,08                      |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust     |                                     |                                  |                           |
| 4,723 % éch. 25/01/2036                            | 70                                  | 68                               | 0,03                      |
| Soundview Home Loan Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 3,943 % éch. 25/07/2037                            | 184                                 | 166                              | 0,07                      |
| Specialty Underwriting & Residential Finance Trust |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/09/2037                            | 287                                 | 200                              | 0,08                      |
|                                                    | 6 379                               | 2 60                             |                           |

**ACTIONS**

|                                              |       |       |      |
|----------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                    |       |       |      |
| <b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b> |       |       |      |
| Amazon.com, Inc. (b)                         | 5 448 | 1 298 | 0,53 |

VALEUR  
NOMINALE  
(en milliers)

|                                      |        |       |      |
|--------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |       |      |
| Allstate Corp.                       |        |       |      |
| 6,851 % éch. 15/08/2053              | \$ 100 | 100   | 0,04 |
| American Airlines Pass-Through Trust |        |       |      |
| 3,375 % éch. 01/11/2028              | 314    | 311   | 0,13 |
| 5,250 % éch. 10/05/2040              | 200    | 199   | 0,08 |
| Apollo Debt Solutions BDC            |        |       |      |
| 6,700 % éch. 29/07/2031              | 200    | 204   | 0,08 |
| Athene Global Funding                |        |       |      |
| 5,322 % éch. 13/11/2031              | 200    | 200   | 0,08 |
| 5,583 % éch. 09/01/2029              | 100    | 101   | 0,04 |
| Beignet Investor LLC                 |        |       |      |
| 6,581 % éch. 30/05/2049              | 2 369  | 2 418 | 0,98 |
| BGC Group, Inc.                      |        |       |      |
| 6,150 % éch. 02/04/2030              | 300    | 306   | 0,12 |
| 8,000 % éch. 25/05/2028              | 50     | 52    | 0,02 |

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Block, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/06/2031                  | \$ 2 600                            | \$ 2 395                         | 0,98                      |
| Burford Capital Global Finance LLC       |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/07/2033                  | 500                                 | 424                              | 0,17                      |
| 8,500 % éch. 15/01/2034                  | 1 600                               | 1 403                            | 0,57                      |
| Core & Main LP                           |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/07/2034 (a)              | 800                                 | 805                              | 0,33                      |
| CoreWeave, Inc.                          |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/07/2032                  | € 200                               | 226                              | 0,09                      |
| CoStar Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 2,800 % éch. 15/07/2030                  | \$ 900                              | 810                              | 0,33                      |
| Diversified Healthcare Trust             |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 01/03/2031                  | 975                                 | 893                              | 0,36                      |
| Edison International                     |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/03/2030                  | 300                                 | 308                              | 0,13                      |
| Encore Capital Group, Inc.               |                                     |                                  |                           |
| 5,440 % éch. 15/07/2033                  | € 700                               | 812                              | 0,33                      |
| FMC Corp.                                |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 01/06/2031                  | \$ 200                              | 208                              | 0,08                      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 16/02/2028                  | 200                                 | 193                              | 0,08                      |
| 5,800 % éch. 08/03/2029                  | 200                                 | 202                              | 0,08                      |
| GA Global Funding Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 18/09/2030                  | 1 000                               | 970                              | 0,40                      |
| Gartner, Inc.                            |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/06/2029                  | 700                                 | 662                              | 0,27                      |
| Global Atlantic Fin Co.                  |                                     |                                  |                           |
| 7,950 % éch. 15/06/2033                  | 1 800                               | 1 993                            | 0,81                      |
| Ingevity Corp.                           |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 01/11/2028                  | 675                                 | 654                              | 0,27                      |
| LSF12 Pillar Investments U.S., Inc.      |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/05/2033                  | € 100                               | 114                              | 0,05                      |
| Maple Parent Holdings Corp.              |                                     |                                  |                           |
| 3,881 % éch. 26/03/2030                  | 100                                 | 115                              | 0,05                      |
| Mobility Global, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 15/06/2029                  | \$ 2 500                            | 2 505                            | 1,02                      |
| MSCI, Inc.                               |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 01/11/2031                  | 2 000                               | 1 856                            | 0,76                      |
| 4,000 % éch. 15/11/2029                  | 100                                 | 97                               | 0,04                      |
| Newfold Digital Holdings Group, Inc.     |                                     |                                  |                           |
| 11,750 % éch. 30/04/2029                 | 82                                  | 73                               | 0,03                      |
| Pacific Gas & Electric Co.               |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/02/2031                  | 200                                 | 180                              | 0,07                      |
| Paramount Global                         |                                     |                                  |                           |
| 4,600 % éch. 15/01/2045                  | 200                                 | 127                              | 0,05                      |
| RD Michigan Property Owner LLC           |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                  | 2 700                               | 2 693                            | 1,10                      |
| Rocket Cos., Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 01/08/2031                  | 500                                 | 511                              | 0,21                      |
| 6,375 % éch. 01/08/2033                  | 3 300                               | 3 360                            | 1,37                      |
| 6,500 % éch. 15/06/2034                  | 400                                 | 411                              | 0,17                      |
| Sammons Financial Group, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 15/06/2036                  | 100                                 | 100                              | 0,04                      |
| Sixth Street Lending Partners            |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/07/2030                  | 350                                 | 352                              | 0,14                      |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           |
| 4,100 % éch. 01/10/2029                  | 47                                  | 45                               | 0,02                      |
| Stagwell Global LLC                      |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 15/08/2029                  | 1 900                               | 1 834                            | 0,75                      |
| Starwood Property Trust, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 01/06/2031                  | 500                                 | 503                              | 0,20                      |
| Station Casinos LLC                      |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/02/2028                  | 400                                 | 396                              | 0,16                      |
| Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                     |                                  |                           |
| 5,800 % éch. 15/06/2031                  | 200                                 | 198                              | 0,08                      |
| Store Capital LLC                        |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 11/02/2031                  | 100                                 | 99                               | 0,04                      |
| Venture Global LNG, Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 15/12/2034                  | 1 200                               | 1 180                            | 0,48                      |
| 6,625 % éch. 15/06/2036                  | 1 200                               | 1 183                            | 0,48                      |
| WMG Acquisition Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 01/12/2029                  | 1 800                               | 1 724                            | 0,70                      |
|                                          |                                     | 36 505                           | 14,86                     |

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b> |                                     |                                  |                           |
| Belden, Inc.                           |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 10/06/2033                  | \$ 200                              | \$ 201                           | 0,08                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.        |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 03/06/2033                  | € 300                               | 344                              | 0,14                      |
| TBD % éch. 03/06/2033                  | \$ 1 177                            | 1 179                            | 0,48                      |
| First Advantage Holdings LLC           |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 31/10/2031                  | 1 200                               | 1 187                            | 0,48                      |
| Jane Street Group LLC                  |                                     |                                  |                           |
| 5,666 % éch. 15/12/2031                | 3 973                               | 3 942                            | 1,61                      |
| Live Nation Entertainment, Inc.        |                                     |                                  |                           |
| 5,639 % éch. 21/10/2032                | 199                                 | 199                              | 0,08                      |
| Newfold Digital Holdings Group, Inc.   |                                     |                                  |                           |
| 9,364 % éch. 30/04/2029                | 4                                   | 3                                | 0,00                      |
| QuidelOrtho Corp.                      |                                     |                                  |                           |
| 7,644 % éch. 20/08/2032                | 995                                 | 981                              | 0,40                      |
| QXO, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 03/06/2033                  | 100                                 | 100                              | 0,04                      |
| TransDigm, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| 5,894 % éch. 22/03/2030                | 399                                 | 399                              | 0,16                      |
| 6,144 % éch. 19/01/2032                | 1 791                               | 1 793                            | 0,73                      |
| UKG, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| 5,913 % éch. 10/02/2031                | 696                                 | 658                              | 0,27                      |
| Virgin Media Bristol LLC               |                                     |                                  |                           |
| 6,967 % éch. 31/03/2031                | 75                                  | 67                               | 0,03                      |
| VistaJet Malta Finance PLC             |                                     |                                  |                           |
| 7,442 % éch. 01/04/2031                | 980                                 | 985                              | 0,40                      |
|                                        |                                     | 12 038                           | 4,90                      |

**TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX**

|                                                      |       |       |      |
|------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Banc of America Funding Trust                        |       |       |      |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                              | 153   | 112   | 0,05 |
| BCAP LLC Trust                                       |       |       |      |
| 4,203 % éch. 25/05/2047                              | 112   | 104   | 0,04 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust          |       |       |      |
| 4,073 % éch. 25/07/2036                              | 32    | 27    | 0,01 |
| Countrywide Alternative Loan Trust                   |       |       |      |
| 4,134 % éch. 20/09/2046                              | 2     | 2     | 0,00 |
| 4,143 % éch. 25/09/2046                              | 3     | 4     | 0,00 |
| 5,063 % éch. 25/10/2035                              | 9     | 6     | 0,00 |
| 5,144 % éch. 25/08/2035                              | 7     | 7     | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/12/2035                              | 262   | 125   | 0,05 |
| 6,000 % éch. 25/08/2037                              | 93    | 66    | 0,03 |
| 6,500 % éch. 25/08/2037                              | 1 874 | 784   | 0,32 |
| 9,452 % éch. 25/07/2035                              | 105   | 93    | 0,04 |
| 13,349 % éch. 25/09/2037                             | 267   | 217   | 0,09 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust    |       |       |      |
| 3,949 % éch. 25/09/2037                              | 31    | 29    | 0,01 |
| 5,750 % éch. 25/07/2037                              | 7     | 3     | 0,00 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |       |       |      |
| 6,000 % éch. 25/09/2035                              | 229   | 51    | 0,02 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates          |       |       |      |
| 3,975 % éch. 29/12/2037                              | 553   | 276   | 0,11 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust |       |       |      |
| 6,000 % éch. 25/07/2036                              | 136   | 58    | 0,02 |
| 6,500 % éch. 25/10/2021                              | 162   | 3     | 0,00 |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust        |       |       |      |
| 3,870 % éch. 25/08/2035                              | 9     | 7     | 0,00 |
| 3,913 % éch. 25/02/2047                              | 2 631 | 1 459 | 0,59 |
| 4,043 % éch. 25/07/2047                              | 10    | 10    | 0,00 |
| 4,143 % éch. 25/10/2036                              | 153   | 39    | 0,02 |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust  |       |       |      |
| 4,493 % éch. 25/08/2035                              | 4     | 3     | 0,00 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                          |       |       |      |
| 3,917 % éch. 25/12/2034                              | 159   | 151   | 0,06 |
| 4,164 % éch. 25/05/2037                              | 41    | 36    | 0,02 |
| 4,263 % éch. 25/02/2037                              | 18    | 12    | 0,01 |
| JPMorgan Mortgage Trust                              |       |       |      |
| 6,500 % éch. 25/07/2036                              | 225   | 70    | 0,03 |
| Lehman XS Trust                                      |       |       |      |
| 4,123 % éch. 25/07/2037                              | 222   | 212   | 0,09 |
| 4,663 % éch. 25/08/2047                              | 138   | 132   | 0,05 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                   |       |       |      |
| 3,128 % éch. 25/11/2037                              | 166   | 114   | 0,05 |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust               |       |       |      |
| 4,113 % éch. 25/08/2035                              | 14    | 11    | 0,01 |

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

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,513 % éch. 25/11/2036                                    | \$ 371                              | \$ 280                           | 0,11                      | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |         |                                  |                           |
| 5,010 % éch. 25/07/2035                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | \$ 400                              | \$ 407                           | 0,17                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |         |                                  |                           |
| 5,129 % éch. 25/12/2035                                    | 12                                  | 10                               | 0,00                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | <b>PIMCO Specialty Funds</b>             |         |                                  |                           |
| Residential Asset Securitization Trust                     |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/05/2052                                        | 78                                  | 69                               | 0,03                      | Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO             |         |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/03/2037                                    | 225                                 | 64                               | 0,03                      | 4,000 % éch. 01/08/2052                                        | 326                                 | 306                              | 0,12                      | China Bond Fund (e)                      | 9 239   | \$ 145                           | 0,06                      |
| 6,000 % éch. 25/02/2036                                    | 321                                 | 116                              | 0,05                      | 4,500 % éch. 01/09/2052 -                                      |                                     |                                  |                           | <b>PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO</b>      |         |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 25/11/2036                                    | 486                                 | 160                              | 0,07                      | 01/12/2054                                                     | 2 313                               | 2 248                            | 0,91                      | US Dollar Short Maturity                 |         |                                  |                           |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust             |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/09/2053 -                                      |                                     |                                  |                           | UCITS ETF (e)                            | 4 000   | 402                              | 0,16                      |
| 4,243 % éch. 25/05/2037                                    | 58                                  | 54                               | 0,02                      | 01/01/2055                                                     | 1 637                               | 1 624                            | 0,66                      | <b>Total des Fonds d'investissement</b>  |         | <b>\$ 547</b>                    | <b>0,22</b>               |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                  |                           |
| 4,213 % éch. 25/05/2035                                    | 938                                 | 805                              | 0,33                      | 4,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                  |                           |
|                                                            |                                     | 5 713                            | 2,33                      | 01/08/2056                                                     | 24 800                              | 23 165                           | 9,43                      |                                          |         |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                               |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/08/2056                                        | 3 900                               | 3 974                            | 1,62                      |                                          |         |                                  |                           |
| CoBank ACB                                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2056                                        | 34 900                              | 36 105                           | 14,70                     |                                          |         |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 01/07/2031 (d)                                | 250                                 | 253                              | 0,10                      |                                                                |                                     | 68 344                           | 27,82                     |                                          |         |                                  |                           |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                   |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                               |                                     | 130 530                          | 53,14                     |                                          |         |                                  |                           |
| Freddie Mac                                                |                                     |                                  |                           | <b>Total des Valeurs mobilières</b>                            |                                     | <b>\$ 281 397</b>                | <b>114,56</b>             |                                          |         |                                  |                           |
| 5,992 % éch. 25/11/2055                                    | 602                                 | 446                              | 0,18                      |                                                                |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                  |                           |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                                 | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                               | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension à<br>recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BPS                                          | 3,700 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 12 700               | Ginnie Mae 4,000 % échéance<br>20/01/2049 | \$ (13 833)         | \$ 12 700                                      | \$ 12 701                                                                      | 5,17                   |
| <b>Total des Contrats de mise en pension</b> |                 |                      |                    |                         |                                           | <b>\$ (13 833)</b>  | <b>\$ 12 700</b>                               | <b>\$ 12 701</b>                                                               | <b>5,17</b>            |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026              | 187                   | \$ 198                                  | 0,08                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 205                   | (141)                                   | (0,06)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 51                    | (79)                                    | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 12                    | (32)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026              | 121                   | 14                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 9                     | (6)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Court | 09/2026              | 48                    | 15                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 376                   | 30                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 381                   | 200                                     | 0,08                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 112                   | 7                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Long  | 09/2026              | 41                    | 57                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 192                   | 648                                     | 0,26                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 112                   | 262                                     | 0,11                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | <b>\$ 1 173</b>                         | <b>0,48</b>            |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime         | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|---------------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | \$ 108,250         | 02/07/2026           | 1                     | \$ 0          | \$ 0            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 02/07/2026           | 2                     | 0             | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 02/07/2026           | 1                     | 0             | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500            | 02/07/2026           | 2                     | 0             | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000            | 10/07/2026           | 2                     | 0             | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750            | 10/07/2026           | 2                     | 0             | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 17/07/2026           | 2                     | (1)           | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 17/07/2026           | 2                     | (1)           | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,000            | 24/07/2026           | 3                     | (1)           | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,500            | 24/07/2026           | 1                     | 0             | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,500            | 24/07/2026           | 2                     | (1)           | (1)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 24/07/2026           | 6                     | (2)           | (2)             | 0,00                   |
|                                                                                                           |                    |                      |                       | <b>\$ (6)</b> | <b>\$ (3)</b>   | <b>0,00</b>            |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>                         |                    |                      |                       |               | <b>\$ 1 170</b> | <b>0,48</b>            |



## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence              | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Air France-KLM                   | (5,000) %              | 20/06/2031         | € 1 900                             | \$ (63)                                 | (0,03)                 |
| Bath & Body Works, Inc.          | (1,000)                | 20/12/2030         | \$ 2 700                            | (87)                                    | (0,03)                 |
| Caesars Entertainment, Inc.      | (5,000)                | 20/12/2030         | 2 750                               | 53                                      | 0,02                   |
| Charter Communications, Inc.     | (5,000)                | 20/06/2031         | 5 800                               | (15)                                    | (0,01)                 |
| Electrolux AB                    | (1,000)                | 20/12/2030         | € 2 000                             | (21)                                    | (0,01)                 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | (5,000)                | 20/12/2030         | 2 500                               | 53                                      | 0,02                   |
| Lanxess AG                       | (1,000)                | 20/12/2030         | 700                                 | (8)                                     | 0,00                   |
| Macy's Retail Holdings LLC       | (1,000)                | 20/06/2030         | \$ 1 200                            | (135)                                   | (0,06)                 |
| MGM Resorts International        | (5,000)                | 20/06/2031         | 2 200                               | 33                                      | 0,01                   |
| Navent Corp.                     | (5,000)                | 20/12/2030         | 3 600                               | 233                                     | 0,10                   |
| NCL Corp. Ltd.                   | (5,000)                | 20/06/2031         | 2 200                               | (52)                                    | (0,02)                 |
| Newell Brands, Inc.              | (1,000)                | 20/12/2030         | 6 000                               | (361)                                   | (0,15)                 |
| Oracle Corp.                     | (1,000)                | 20/06/2031         | 5 100                               | 22                                      | 0,01                   |
| United Group BV                  | (5,000)                | 20/12/2030         | € 1 600                             | (28)                                    | (0,01)                 |
| Valeo SE                         | (1,000)                | 20/12/2030         | 1 800                               | (24)                                    | (0,01)                 |
| Whirlpool Corp.                  | (1,000)                | 20/06/2030         | \$ 2 600                            | 121                                     | 0,05                   |
| WP Finance S.A.                  | (1,000)                | 20/12/2030         | € 5 600                             | (7)                                     | 0,00                   |
|                                  |                        |                    |                                     | \$ (286)                                | (0,12)                 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Entité de référence          | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Ally Financial, Inc.         | 5,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 1 100                            | \$ 3                                    | 0,00                   |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                   | 20/06/2027         | 100                                 | 2                                       | 0,00                   |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                   | 20/06/2028         | 100                                 | 2                                       | 0,00                   |
| Bank of America Corp.        | 1,000                   | 20/12/2030         | 1 700                               | (1)                                     | 0,00                   |
| Deutsche Bank AG             | 1,000                   | 20/12/2030         | € 300                               | 1                                       | 0,00                   |
| Goldman Sachs Group, Inc.    | 1,000                   | 20/12/2030         | \$ 1 700                            | (1)                                     | 0,00                   |
| Stellantis NV                | 5,000                   | 20/12/2030         | € 1 600                             | (57)                                    | (0,02)                 |
| T-Mobile USA, Inc.           | 5,000                   | 20/06/2028         | \$ 300                              | (25)                                    | (0,01)                 |
| Verisure Midholding AB       | 5,000                   | 20/06/2031         | € 1 000                             | (1)                                     | 0,00                   |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                   | 20/12/2028         | \$ 100                              | 2                                       | 0,00                   |
| Worldline S.A.               | 5,000                   | 20/12/2030         | € 700                               | (3)                                     | 0,00                   |
| ZF Europe Finance BV         | 5,000                   | 20/12/2030         | 400                                 | 16                                      | 0,01                   |
|                              |                         |                    |                                     | \$ (62)                                 | (0,02)                 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans             | 1,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 6 000                            | \$ 49                                   | 0,02                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2031         | 8 044                               | 27                                      | 0,01                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 96 730                              | 80                                      | 0,03                   |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans   | 5,000                   | 20/06/2031         | € 13 700                            | 311                                     | 0,13                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 45 300                              | 144                                     | 0,06                   |
|                                            |                         |                    |                                     | \$ 611                                  | 0,25                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable        | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|--------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %      | 18/03/2031         | £ 4 000              | \$ (113)                                | (0,05)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,000        | 18/03/2036         | 1 750                | 45                                      | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,160        | 31/01/2039         | 3 900                | 158                                     | 0,06                   |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500        | 18/03/2056         | 390                  | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour  | 1,500        | 16/09/2031         | THB 186 190          | (42)                                    | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250        | 19/03/2035         | \$ 11 500            | (131)                                   | (0,05)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,281        | 15/02/2040         | 9 200                | (34)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,975        | 15/11/2053         | 400                  | 8                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000        | 17/06/2056         | 6 400                | 63                                      | 0,03                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000        | 16/09/2056         | 3 700                | (31)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,002        | 28/05/2036         | 100                  | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,085        | 15/11/2053         | 8 169                | 164                                     | 0,07                   |
| À payer                                    | CDI BRL à un an                | 12,030       | 04/01/2027         | BRL 7 400            | (47)                                    | (0,02)                 |
| À payer                                    | CDI BRL à un an                | 13,013       | 02/01/2029         | 60 400               | (302)                                   | (0,12)                 |
| À payer                                    | CDI BRL à un an                | 13,300       | 02/01/2029         | 15 200               | (48)                                    | (0,02)                 |
| À payer                                    | CDI BRL à un an                | 13,359       | 02/01/2029         | 9 700                | (37)                                    | (0,02)                 |
| À payer                                    | CDI BRL à un an                | 13,402       | 02/01/2029         | 13 500               | (51)                                    | (0,02)                 |
| À payer                                    | CDI BRL à un an                | 13,926       | 04/01/2027         | 24 500               | (39)                                    | (0,02)                 |

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

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel |           | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,000 %   | 17/12/2035      | AUD               | 3 200     | \$ (101)                          | (0,04)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,250     | 19/03/2030      |                   | 7 100     | (114)                             | (0,05)              |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,660     | 01/04/2033      | CLP               | 1 870 000 | (24)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | €                 | 23 620    | 48                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      |                   | 10 720    | (211)                             | (0,09)              |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,180     | 22/05/2036      | PLN               | 9 400     | (68)                              | (0,03)              |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,520     | 20/04/2036      |                   | 1 200     | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 29/04/2036      |                   | 3 700     | (35)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,155     | 25/10/2034      |                   | 6 500     | (53)                              | (0,02)              |
|                                                    |                         |           |                 |                   |           | \$ (1 002)                        | (0,41)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   |           | \$ (739)                          | (0,30)              |

- <sup>(1)</sup> Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- <sup>(2)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- <sup>(3)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- <sup>(4)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 426                              | \$ 4  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 754                              | 5     | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 09/07/2026        | 1 096                            | 10    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 1 092                            | 9     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 28 | \$ 0         | 0,00                |

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                               | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,750 %         | 10/08/2026        | 220 400                          | \$ 298 | \$ 2         | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 426                              | \$ (1) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 754                              | (2)    | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 09/07/2026        | 1 096                            | (3)    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 1 092                            | (3)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (9) | \$ 0         | 0,00                |

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500 %         | 31/01/2028        | 23 800                           | \$ (70) | \$ (95)      | (0,04)              |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004           | 08/07/2026        | 300                              | (1)     | (1)          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 300                              | (1)     | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (72) | \$ (96)      | (0,04)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| CBK          | SoftBank Group Corp.                                 | (1,000) %              | 20/12/2030         | ¥ 320 350                           | \$ 190                    | \$ (48)                                 | \$ 142          | 0,06                   |
| GST          | Bellis Acquisition Company PLC                       | (5,000)                | 20/06/2031         | € 2 300                             | 197                       | (66)                                    | 131             | 0,05                   |
|              | SoftBank Group Corp.                                 | (1,000)                | 20/12/2030         | ¥ 320 350                           | 191                       | (49)                                    | 142             | 0,06                   |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement indonésien | (1,000)                | 20/06/2031         | \$ 6 200                            | (6)                       | (25)                                    | (31)            | (0,02)                 |
|              |                                                      |                        |                    |                                     | \$ 572                    | \$ (188)                                | \$ 384          | 0,15                   |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000 %                 | 20/12/2026         | \$ 200                              | \$ 4                      | \$ 0                                    | \$ 4            | 0,00                   |
|              | SW Finance PLC                                       | 1,000                   | 20/06/2035         | 200                                 | (24)                      | 1                                       | (23)            | (0,01)                 |
| GST          | Morgan Stanley                                       | 1,000                   | 20/12/2030         | 1 300                               | 24                        | 2                                       | 26              | 0,01                   |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement équatorien | 5,000                   | 20/06/2027         | 150                                 | 5                         | 1                                       | 6               | 0,01                   |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                   | 20/12/2026         | 100                                 | 2                         | 0                                       | 2               | 0,00                   |
|              |                                                      |                         |                    |                                     | \$ 11                     | \$ 4                                    | \$ 15           | 0,01                   |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %                 | 20/12/2030         | € 400                               | \$ 91                     | \$ (6)                                  | \$ 85           | 0,04                   |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 7 500                               | 1 725                     | (128)                                   | 1 597           | 0,65                   |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 100                                 | 23                        | (2)                                     | 21              | 0,01                   |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 400                                 | 92                        | (7)                                     | 85              | 0,03                   |
|              |                                                   |                         |                    |                                     | \$ 1 931                  | \$ (143)                                | \$ 1 788        | 0,73                   |

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

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

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

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                          | Nombre<br>d'actions<br>ou de parts | Taux variable | Montant<br>notionnel | Date<br>d'échéance | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------------------------------|------------------------------------|---------------|----------------------|--------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BPS          | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 34 279                             | 1,248 %       | \$ 11 600            | 22/03/2027         | \$ 0                      | \$ (236)                                | \$ (236)        | (0,10)                 |
| MYC          | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index   | 10 451                             | 1,249         | 2 400                | 21/09/2026         | 0                         | (10)                                    | (10)            | 0,00                   |
|              | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index   | 33 837                             | 1,248         | 7 800                | 21/12/2026         | 0                         | 8                                       | 8               | 0,00                   |
|              | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 35 709                             | 1,248         | 12 100               | 22/03/2027         | 0                         | (230)                                   | (230)           | (0,09)                 |
|              |                    |                                                |                                    |               |                      |                    | \$ 0                      | \$ (468)                                | \$ (468)        | (0,19)                 |

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre            | Nombre<br>d'actions<br>ou de parts | Taux variable | Montant<br>notionnel | Date<br>d'échéance | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------|------------------------------------|---------------|----------------------|--------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| FAR          | À payer            | Amazon.com, Inc. | 5 448                              | 5,620 %       | \$ 1 268             | 29/07/2026         | \$ 0                      | \$ (31)                                 | \$ (31)         | (0,01)                 |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| AZD          | 07/2026              | AUD                | 283                  | \$ 202                | \$ 6                     | \$ 6                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              | NZD                | 1 553                | 917                   | 34                       | 34                                            | 0,01                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 25                   | CAD                   | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 788                | NZD                  | 1 395                 | 6                        | 6                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | CAD                | 35                   | \$                    | 25                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | NZD                | 1 395                | 789                   | 0                        | (6)                                           | 0,00                   |



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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 52                | \$ 10              | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 348               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 630               | 842                | 6                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 27 542            | 18                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 625               | 63                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 471               | AUD 657            | 0                     | (15)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 20                | CNH 135            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 007             | € 865              | 0                     | (18)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 80                | ILS 232            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 222             | INR 115 740        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 35                | ¥ 5 558            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 204               | NOK 1 889          | 0                     | (13)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 431               | \$ 145             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 573 568           | 145                | 0                     | (18)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | INR             | 116 496           | 1 222              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 924             | 110                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 171               | 50                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 7 143             | MXN 126 632        | 59                    | 59                                      | 0,02                |
|              | 10/2026           |                 | 0                 | COP 356            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD             | 833               | \$ 574             | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 492               | 95                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 842               | 1 070              | 27                    | 27                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 086             | 160                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 548               | 80                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 922             | 7 891              | 0                     | (23)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £               | 454               | 608                | 5                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 8 770 301         | 487                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 711               | 241                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 120 431           | 1 260              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 184 800           | 1 145              | 8                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 505               | 51                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 15 042            | 460                | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 189               | BRL 976            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 810               | INR 76 953         | 2                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 118               | ¥ 18 802           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 275               | KRW 421 567        | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 5 278             | \$ 322             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 84                | 28                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 4 277 635         | 236                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 241               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 828               | IDR 14 658 554     | 1                     | (16)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 144               | INR 13 653         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 30                | THB 982            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 12/2026           |                 | 187               | IDR 3 411 315      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 23 591 700        | \$ 1 320           | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 867               | 293                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 257             | 1 334              | 51                    | 51                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | TRY             | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 993               | TRY 47 694         | 14                    | 14                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 26 067            | \$ 1 605           | 17                    | 17                                      | 0,01                |
| BSH          | 08/2026           | COP             | 224 731           | 60                 | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 897               | 1 043              | 18                    | 18                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 627               | ¥ 99 636           | 0                     | (14)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 365             | NZD 2 415          | 9                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 2 415             | \$ 1 366           | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 336             | 77                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 6 131             | BRL 31 444         | 0                     | (147)                                   | (0,06)              |
| CBK          | 07/2026           | COP             | 746 395           | \$ 196             | 0                     | (20)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £               | 1 606             | 2 154              | 23                    | 23                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS             | 792               | 273                | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 28 506            | 302                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 257               | COP 899 713        | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 171             | € 1 004            | 0                     | (23)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 613               | HUF 187 483        | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 835               | IDR 14 982 137     | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 294               | INR 28 506         | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 150               | NOK 1 390          | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 173               | PEN 583            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8                 | PLN 27             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 41                | SEK 379            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 924               | \$ 318             | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN             | 876               | 260                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 70                | ILS 207            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP             | 1 931 254         | \$ 2 158           | 62                    | 62                                      | 0,03                |
|              | 09/2026           | COP             | 967 903           | 265                | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 22 432 202        | 1 243              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 2 879             | 30                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 3 554             | 107                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 178               | IDR 3 169 102      | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 281               | MXN 4 878          | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3                 | PEN 10             | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 10/2026           | COP             | 134 904           | \$ 38              | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 2 955             | 857                | 1                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 790 794           | 219                | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 3 548             | 1 015              | 0                     | (19)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | \$              | 408               | IDR 7 413 474      | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 51                | MXN 897            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 500               | 99                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 3 497             | 37                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 57                | 15                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 25                | INR 2 384          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 505               | NOK 4 693          | 0                     | (31)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 12 121            | \$ 749             | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 109               | IDR 1 980 634      | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 37                | INR 3 521          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 080             | \$ 160             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £               | 18 621            | 25 040             | 327                   | 0                                       | 0,13                |
|              | 07/2026           | PEN             | 583               | 172                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 2 814             | 770                | 22                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 5 065             | 3 970              | 54                    | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 558               | CNH 3 796          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 186               | £ 141              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 664             | ¥ 269 173          | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12                | PLN 44             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 17 268            | \$ 1 046           | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 3 788             | 558                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 141               | 186                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 254               | 89                 | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 266 164           | 1 649              | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 528               | INR 50 603         | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 7                 | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | COP             | 22 059            | 6                  | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 69 548            | 45                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 49                | BRL 246            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 358             | CAD 3 355          | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 705               | COP 2 441 865      | 3                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 45                | KRW 69 539         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 120               | PLN 448            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 567               | TRY 26 953         | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 3 350             | \$ 2 358           | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 114               | INR 10 932         | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 1 188 678         | \$ 341             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 66 949            | 3 814              | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 17 581            | 545                | 12                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 509               | IDR 9 134 096      | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 784               | INR 75 534         | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 316               | MXN 5 473          | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
| JPM          | 11/2026           | COP             | 1 290 629         | \$ 360             | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 225             | 873                | 25                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | BRL             | 4 611             | 896                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 2 225             | 745                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 33 251            | 352                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 21 491            | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 819               | 83                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 7 002             | 1 922              | 59                    | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 850             | HUF 565 967        | 0                     | (33)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 144               | IDR 2 595 954      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 94                | ILS 264            | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 352               | INR 33 251         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 14                | KRW 21 488         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 400               | THB 13 374         | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 352             | ZAR 55 075         | 9                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 666             | \$ 569             | 9                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$              | 83                | NOK 819            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 2 610 379         | \$ 144             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 22 625            | 688                | 6                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 573               | INR 54 573         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2 045             | MXN 35 550         | 0                     | (23)                                    | (0,01)              |
|              | 10/2026           |                 | 896               | BRL 4 712          | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 3 445             | \$ 2 409           | 22                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 092             | 1 384              | 32                    | (2)                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | COP             | 1 426 202         | 376                | 0                     | (35)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | €               | 7 316             | 8 488              | 125                   | 0                                       | 0,05                |
|              | 07/2026           | £               | 572               | 757                | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 3 511             | 37                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 474 063           | 313                | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 264               | 27                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 954             | AUD 2 832          | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 314               | BRL 1 630          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 067             | € 6 106            | 0                     | (87)                                    | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 748               | £ 557              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 57                | INR 5 526          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 887               | ¥ 141 141          | 0                     | (19)                                    | (0,01)              |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| MYI          | 07/2026           | \$              | 1 203             | NOK 11 154         | \$ 0                  | \$ (76)                                 | (0,03)              |        |
|              | 08/2026           | AUD             | 2 832             | \$ 1 953           | 0                     | (8)                                     | 0,00                |        |
|              | 08/2026           | \$              | 27                | NOK 264            | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026           | THB             | 3 760             | \$ 113             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |        |
|              | 09/2026           | \$              | 592               | INR 56 762         | 3                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026           |                 | 50                | THB 1 622          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | ¥               | 431 000           | \$ 2 695           | 43                    | 43                                      | 0,02                |        |
|              | 07/2026           | NOK             | 16 905            | 1 776              | 67                    | 67                                      | 0,03                |        |
|              | 07/2026           | SEK             | 465               | 50                 | 2                     | 2                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | \$              | 6                 | € 5                | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
| NSL          | 07/2026           |                 | 1 052             | £ 783              | 0                     | (12)                                    | (0,01)              |        |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 437             | \$ 82              | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | \$              | 58                | INR 5 577          | 1                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           |                 | 553               | TRY 25 985         | 1                     | 0                                       | 0,00                |        |
| SCX          | 09/2026           |                 | 109               | IDR 1 934 814      | 0                     | (1)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | CNY             | 1 284             | \$ 188             | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | COP             | 1 188 678         | 309                | 0                     | (34)                                    | (0,01)              |        |
|              | 07/2026           | ¥               | 160 300           | 1 000              | 14                    | 14                                      | 0,01                |        |
| SOG          | 07/2026           | \$              | 587               | £ 436              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026           |                 | 336               | IDR 6 021 176      | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           |                 | 76                | INR 7 313          | 1                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 08/2026           |                 | 283               | 27 152             | 2                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026           | IDR             | 6 055 232         | \$ 336             | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026           | THB             | 6 372             | 197                | 4                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026           | \$              | 277               | IDR 4 976 337      | 1                     | (2)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 764             | \$ 261             | 1                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | €               | 54 711            | 63 823             | 1 272                 | 0                                       | 1 272               | 0,52   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 585             | AUD 2 297          | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 496               | BRL 2 515          | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 52                | CHF 42             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 69 429            | € 61 036           | 355                   | 0                                       | 355                 | 0,14   |
|              | 07/2026           |                 | 197               | £ 149              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 522             | ¥ 241 756          | 0                     | (34)                                    | (34)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 3 917             | SGD 5 072          | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 2 297             | \$ 1 584           | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | CHF             | 42                | 52                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| SSB          | 08/2026           | €               | 61 036            | 69 523             | 0                     | (354)                                   | (354)               | (0,14) |
|              | 08/2026           | £               | 149               | 197                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | SGD             | 5 061             | 3 917              | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 3 449             | 2 501              | 71                    | 0                                       | 71                  | 0,03   |
|              | 07/2026           | \$              | 22                | CAD 31             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 25 893            | £ 19 588           | 106                   | 0                                       | 106                 | 0,04   |
|              | 08/2026           | CAD             | 31                | \$ 22              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | COP             | 5 738 663         | 1 505              | 0                     | (143)                                   | (143)               | (0,06) |
|              | 08/2026           | £               | 19 588            | 25 892             | 0                     | (106)                                   | (106)               | (0,04) |
|              | 09/2026           | COP             | 629 549           | 173                | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
| UAG          | 09/2026           | PEN             | 1 474             | 430                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             | 58                | 16                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 970               | € 835              | 0                     | (15)                                    | (15)                | (0,01) |
| WST          | 08/2026           | COP             | 509 458           | \$ 135             | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 7 208 363         | 1 847              | 0                     | (164)                                   | (164)               | (0,07) |
|              | 07/2026           | \$              | 2 344             | CHF 1 892          | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | CHF             | 1 886             | \$ 2 344           | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 3 149              | \$ (1 734)                              | \$ 1 415            | 0,57   |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| BRC          | 07/2026           | CHF             | 15                | \$ 19              | \$ 1                  | \$ 0                                    | \$ 1                | 0,00 |
| CBK          | 07/2026           |                 | 1                 | 1                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| FAR          | 07/2026           |                 | 15                | 19                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| GLM          | 07/2026           |                 | 15                | 19                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 98                | CHF 77             | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
| MBC          | 07/2026           |                 | 109               | 85                 | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
| MYI          | 07/2026           | CHF             | 15                | \$ 19              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 3                 | CHF 2              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| SOG          | 07/2026           | CHF             | 69                | \$ 86              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | CHF 1              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 67                | 54                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| SSB          | 07/2026           |                 | 107               | 84                 | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
| UAG          | 07/2026           | CHF             | 15                | \$ 19              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 2                  | \$ (9)                                  | \$ (7)              | 0,00 |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 157           | \$ 178            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 24 193       | € 20 767          | 0                  | (452)                 | (452)                                   | (0,19)              |
| BSH          | 07/2026           | 22 897          | 19 638            | 0                  | (444)                 | (444)                                   | (0,18)              |
| CBK          | 07/2026           | € 35            | \$ 41             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 273          | € 234             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 18 833        | \$ 21 479         | 0                  | (53)                  | (53)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 21 508       | € 18 833          | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | € 22 464        | \$ 25 578         | 44                 | (150)                 | (106)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 99           | € 86              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 23 263          | 20 452            | 153                | 0                     | 153                                     | 0,06                |
| SOG          | 07/2026           | € 20 058        | \$ 22 816         | 0                  | (116)                 | (116)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 24 225       | € 20 767          | 0                  | (484)                 | (484)                                   | (0,20)              |
|              | 08/2026           | 22 847          | 20 058            | 117                | 0                     | 117                                     | 0,05                |
| SSB          | 07/2026           | 65              | 57                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 57            | \$ 65             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 368             | \$ (1 707)            | \$ (1 339)                              | (0,55)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 86           | £ 64              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £59             | \$ 78             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 96           | £ 71              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 78              | 59                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £1              | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 7            | £ 5               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1               | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 94              | 70                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 2               | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £14             | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 18           | £ 14              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £68             | \$ 91             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 91           | £ 68              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £69             | \$ 91             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 91           | £ 69              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 0               | \$ (3)                | \$ (3)                                  | 0,00                |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 1 660 0,67

Total des Investissements

\$ 296 735 120,80

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (51 099) (20,80)

Actif net

\$ 245 636 100,00

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

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

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Un titre d'une juste valeur globale de 101 \$ (31 décembre 2025 : 343 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 13 443 \$ (31 décembre 2025 : 16 922 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 970 \$ (31 décembre 2025 : 680 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

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

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1 300                                                                          | \$ 279 113                                           | \$ 984                                            | \$ 281 397        |
| Fonds d'investissement                        | 547                                                                               | 0                                                    | 0                                                 | 547               |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 12 700                                               | 0                                                 | 12 700            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 216                                                                               | 1 898                                                | (23)                                              | 2 091             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 2 063</b>                                                                   | <b>\$ 293 711</b>                                    | <b>\$ 961</b>                                     | <b>\$ 296 735</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 251 385                                           | \$ 565                                            | \$ 251 950        |
| Fonds d'investissement                        | 539                                                                               | 0                                                    | 0                                                 | 539               |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 35 000                                               | 0                                                 | 35 000            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 59                                                                                | 1 778                                                | 1                                                 | 1 838             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 598</b>                                                                     | <b>\$ 288 163</b>                                    | <b>\$ 566</b>                                     | <b>\$ 289 327</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BRC                                           | 1,750 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (88)           | \$ (101)                                 | (0,04)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (101)</b>                          | <b>(0,04)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 39                                                      | \$ 0                    | \$ 39                             | \$ 2                                                       | \$ 0                    | \$ 2                              |
| BOA          | (11)                                                       | 30                      | 19                                | 101                                                        | 0                       | 101                               |
| BPS          | 897                                                        | (980)                   | (83)                              | 1 780                                                      | (1 900)                 | (120)                             |
| BRC          | 65                                                         | 0                       | 65                                | 299                                                        | (360)                   | (61)                              |
| BSH          | (586)                                                      | 680                     | 94                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| CBK          | 160                                                        | (280)                   | (120)                             | (133)                                                      | 0                       | (133)                             |
| CIB          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| DUB          | (18)                                                       | 0                       | (18)                              | (13)                                                       | 0                       | (13)                              |
| FAR          | 374                                                        | (470)                   | (96)                              | (571)                                                      | 680                     | 109                               |
| GLM          | 23                                                         | 0                       | 23                                | 78                                                         | 0                       | 78                                |
| GST          | 299                                                        | (310)                   | (11)                              | 26                                                         | 0                       | 26                                |
| JPM          | 93                                                         | 0                       | 93                                | 102                                                        | 0                       | 102                               |
| MBC          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 278                                                        | (340)                   | (62)                              |
| MYC          | (230)                                                      | 260                     | 30                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| MYI          | 101                                                        | 0                       | 101                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| NSL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 6                                                          | 0                       | 6                                 |
| SCX          | (22)                                                       | 0                       | (22)                              | 6                                                          | 0                       | 6                                 |
| SOG          | 746                                                        | (930)                   | (184)                             | 10                                                         | 0                       | 10                                |
| SSB          | (82)                                                       | 0                       | (82)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | (191)                                                      | 0                       | (191)                             | (131)                                                      | 0                       | (131)                             |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 64                                                         | (60)                    | 4                                 |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 31,52            | 40,69                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 41,58            | 33,48                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,38             | 0,11                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,14             | 0,16                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 3,32             | 10,32                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,37             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,43             | 0,59                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,51             | 1,06                 |
| Autres actifs                                                    | 20,75            | 13,56                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                                | 1,61             | 0,22                 |
| Autriche                                                                                                 | S/O              | 0,46                 |
| Belgique                                                                                                 | 0,24             | 0,32                 |
| Bermudes                                                                                                 | 1,28             | 0,99                 |
| Brésil                                                                                                   | S/O              | 0,22                 |
| Canada                                                                                                   | 1,71             | 1,66                 |
| Îles Caïmans                                                                                             | 1,57             | 0,00                 |
| Chili                                                                                                    | 1,25             | 0,82                 |
| Chine                                                                                                    | 0,00             | 0,00                 |
| Colombie                                                                                                 | 3,18             | 2,13                 |
| Costa Rica                                                                                               | 0,12             | S/O                  |
| République tchèque                                                                                       | 0,59             | 0,14                 |
| Danemark                                                                                                 | 0,64             | 0,56                 |
| France                                                                                                   | 5,40             | 3,66                 |
| Allemagne                                                                                                | 0,86             | 1,21                 |
| Gibraltar                                                                                                | 0,48             | S/O                  |
| Inde                                                                                                     | 1,51             | S/O                  |
| Irlande                                                                                                  | 4,82             | 1,27                 |
| Israël                                                                                                   | 0,74             | S/O                  |
| Italie                                                                                                   | S/O              | 1,07                 |
| Japon                                                                                                    | 1,02             | 0,47                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                             | 0,37             | S/O                  |
| Liberia                                                                                                  | S/O              | 0,92                 |
| Luxembourg                                                                                               | 3,97             | 2,44                 |
| Mexique                                                                                                  | 0,28             | 2,21                 |
| Multinationales                                                                                          | S/O              | 0,23                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 5,61             | 2,58                 |
| Norvège                                                                                                  | S/O              | 0,13                 |
| Pakistan                                                                                                 | 0,37             | S/O                  |
| Pérou                                                                                                    | 0,99             | 0,77                 |
| Pologne                                                                                                  | 1,67             | 0,70                 |
| Qatar                                                                                                    | 1,06             | S/O                  |
| Roumanie                                                                                                 | S/O              | 0,09                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,93             | S/O                  |
| Afrique du Sud                                                                                           | 1,13             | 1,83                 |
| Espagne                                                                                                  | 0,90             | 0,53                 |
| Suède                                                                                                    | 2,23             | S/O                  |
| Suisse                                                                                                   | 0,22             | 0,51                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 1,06             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                                                              | 13,61            | 10,71                |
| États-Unis                                                                                               | 53,14            | 54,92                |
| Instruments à court terme                                                                                | S/O              | 0,50                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 0,22             | 0,20                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 5,17             | 13,10                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,48             | (0,06)               |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,12)           | (0,06)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,02)           | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | S/O              | (0,08)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,25             | 0,12                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,41)           | 0,04                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,01                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | (0,04)           | 0,00                 |
| Options sur titres                                                                                       | S/O              | 0,00                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,15             | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,73             | 0,74                 |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | (0,19)           | S/O                  |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | (0,01)           | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,57             | (0,44)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,55)           | 0,40                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (20,80)          | (8,26)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |                                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>ANGOLA</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |                                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |                                                               |                                     |                                  |                           |
| Sonangol Finance Ltd.                                                                          |                                     |                                  |                           | 5,863 % éch. 30/12/2057 (a)                        | AUD 4 100                           | \$2 834                          | 0,03                      | Palm RE Ltd.                                                  |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 29/01/2031                                                                       | \$ 9 200                            | \$9 275                          | 0,10                      | 6,163 % éch. 30/12/2057 (a)                        | 2 100                               | 1 452                            | 0,02                      | 8,550 % éch. 07/06/2033                                       | \$ 750                              | \$761                            | 0,01                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,563 % éch. 30/12/2057 (a)                        | 1 600                               | 1 106                            | 0,01                      | 11,270 % éch. 07/06/2032                                      | 250                                 | 255                              | 0,00                      |
| Obligation internationale du gouvernement angolais                                             |                                     |                                  |                           | Sapphire Trust Central Finance                     |                                     |                                  |                           | 13,220 % éch. 09/06/2031                                      | 1 500                               | 1 550                            | 0,02                      |
| 9,125 % éch. 26/11/2049                                                                        | 7 050                               | 6 618                            | 0,07                      | 4,999 % éch. 12/02/2067                            | 123                                 | 85                               | 0,00                      | Purple Re Ltd.                                                |                                     |                                  |                           |
| 9,244 % éch. 15/01/2031                                                                        | 17 000                              | 17 618                           | 0,18                      | 4,999 % éch. 12/12/2067                            | 3 751                               | 2 598                            | 0,03                      | 12,676 % éch. 06/06/2031                                      | 1 500                               | 1 541                            | 0,02                      |
|                                                                                                |                                     | 24 236                           | 0,25                      | 5,131 % éch. 12/03/2068                            | 1 400                               | 970                              | 0,01                      | Sabine Re Ltd.                                                |                                     |                                  |                           |
| Total Angola                                                                                   |                                     | 33 511                           | 0,35                      | 5,299 % éch. 12/12/2067                            | 44 500                              | 30 746                           | 0,32                      | 12,040 % éch. 07/04/2031                                      | 1 500                               | 1 519                            | 0,02                      |
| <b>ARGENTINE</b>                                                                               |                                     |                                  |                           | 5,501 % éch. 12/03/2068                            | 41 000                              | 28 425                           | 0,30                      | Seadrill Finance Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | Triton Bond Trust                                  |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 01/08/2030                                       | 10 350                              | 10 857                           | 0,12                      |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                                             |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/02/2058                            | 10 075                              | 6 979                            | 0,07                      | Valaris Ltd.                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 09/07/2041                                                                        | 139 874                             | 104 906                          | 1,11                      | 5,250 % éch. 15/02/2058                            | 60 000                              | 41 447                           | 0,44                      | 8,375 % éch. 30/04/2030                                       | 8 800                               | 9 143                            | 0,10                      |
| <b>AUSTRALIE</b>                                                                               |                                     |                                  |                           | Total Australie                                    |                                     | 409 823                          | 4,32                      | Weatherford International Ltd.                                |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     | 487 203                          | 5,14                      | 6,750 % éch. 15/10/2033                                       | 9 600                               | 9 800                            | 0,10                      |
| Allied Credit ABS Trust                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>AUTRICHE</b>                                    |                                     |                                  |                           | Winston RE Ltd.                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,173 % éch. 17/09/2033                                                                        | AUD 16 000                          | 11 067                           | 0,12                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 10,020 % éch. 21/02/2028                                      | 250                                 | 257                              | 0,00                      |
| Angle Asset Finance Radian Trust                                                               |                                     |                                  |                           | ams-OSRAM AG                                       |                                     |                                  |                           | Total Bermudes                                                |                                     | 62 683                           | 0,66                      |
| 5,500 % éch. 16/03/2033                                                                        | 1 971                               | 1 369                            | 0,01                      | 7,250 % éch. 31/05/2032                            | € 6 050                             | 7 139                            | 0,08                      | <b>BRESIL</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| FirstMac Asset Funding Trust                                                                   |                                     |                                  |                           | 10,500 % éch. 30/03/2029                           | 7 038                               | 8 582                            | 0,09                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 5,208 % éch. 19/09/2033                                                                        | 3 001                               | 2 078                            | 0,02                      | Total Autriche                                     |                                     | 15 721                           | 0,17                      | Banco do Brasil S.A.                                          |                                     |                                  |                           |
| Flexicommercial ABS Trust                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>AZERBAÏDJAN</b>                                 |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 29/07/2026                                       | MXN 89 000                          | 5 110                            | 0,06                      |
| 5,550 % éch. 14/06/2031                                                                        | 8 190                               | 5 689                            | 0,06                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>             |                                     |                                  |                           | Rede D'or Finance SARL                                        |                                     |                                  |                           |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust                                                    |                                     |                                  |                           | State Oil, Inc.                                    |                                     |                                  |                           | 6,550 % éch. 28/04/2036                                       | \$ 3 900                            | 3 784                            | 0,04                      |
| 5,450 % éch. 22/11/2037                                                                        | 36 100                              | 25 076                           | 0,27                      | TBD % éch. 24/03/2031                              | \$ 5 300                            | 5 242                            | 0,06                      |                                                               |                                     | 8 894                            | 0,10                      |
| Latitude Australia Personal Loans Trust                                                        |                                     |                                  |                           | <b>BAHREÏN</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,303 % éch. 17/09/2033                                                                        | 1 877                               | 1 301                            | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement brésilien           |                                     |                                  |                           |
| Metro Finance Trust                                                                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement bahreïni |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 10/02/2054                                       | 5 053                               | 5 092                            | 0,05                      |
| 5,370 % éch. 16/02/2033                                                                        | 2 885                               | 1 999                            | 0,02                      | 7,125 % éch. 10/06/2036                            | 19 800                              | 19 603                           | 0,21                      | 7,250 % éch. 12/01/2056                                       | 16 000                              | 16 108                           | 0,17                      |
| Plenti Auto ABS                                                                                |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 07/07/2037                            | 1 500                               | 1 526                            | 0,01                      |                                                               |                                     | 21 200                           | 0,22                      |
| 5,399 % éch. 12/08/2033                                                                        | 901                                 | 625                              | 0,01                      | Total Bahrein                                      |                                     | 21 129                           | 0,22                      | Total Brésil                                                  |                                     | 30 094                           | 0,32                      |
| Plenti PL & Green ABS Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>BELGIQUE</b>                                    |                                     |                                  |                           | <b>BULGARIE</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                                                                        | 2 975                               | 2 060                            | 0,02                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,506 % éch. 11/11/2036                                                                        | 6 182                               | 4 291                            | 0,05                      | Manuchar Group SARL                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement bulgare             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     | 55 555                           | 0,59                      | 7,401 % éch. 07/07/2032                            | € 6 325                             | 7 210                            | 0,07                      | 3,625 % éch. 05/09/2032                                       | € 5 000                             | 5 816                            | 0,06                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           | Sofina S.A.                                        |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 07/05/2038                                       | 5 800                               | 6 652                            | 0,07                      |
| Santos Finance Ltd.                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,707 % éch. 13/11/2033                            | 5 700                               | 6 457                            | 0,07                      | 4,125 % éch. 18/07/2045                                       | 5 000                               | 5 493                            | 0,06                      |
| 3,649 % éch. 29/04/2031                                                                        | \$ 3 200                            | 2 994                            | 0,03                      | Total Belgique                                     |                                     | 13 667                           | 0,14                      | 4,250 % éch. 05/09/2044                                       | 5 000                               | 5 647                            | 0,06                      |
| 6,875 % éch. 19/09/2033                                                                        | 5 100                               | 5 544                            | 0,06                      | <b>BÉNIN</b>                                       |                                     |                                  |                           | Total Bulgarie                                                |                                     | 23 608                           | 0,25                      |
| Woodside Finance Ltd.                                                                          |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | <b>CAMEROUN</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| 3,700 % éch. 15/09/2026                                                                        | 700                                 | 699                              | 0,01                      | Benin Sukuk S.A.                                   |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,100 % éch. 12/09/2034                                                                        | 12 800                              | 12 588                           | 0,13                      | 6,200 % éch. 29/01/2033                            | \$ 13 200                           | 12 825                           | 0,14                      | Obligation internationale du gouvernement de la République du |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     | 21 825                           | 0,23                      | <b>BERMUDES</b>                                    |                                     |                                  |                           | Cameroun                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 07/07/2032                                       | 4 200                               | 4 294                            | 0,05                      |
| AFG Trust                                                                                      |                                     |                                  |                           | Aircastle Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 30/01/2033                                       | \$ 8 900                            | 8 783                            | 0,09                      |
| 5,012 % éch. 10/10/2057                                                                        | AUD 4 153                           | 2 876                            | 0,03                      | 2,850 % éch. 26/01/2028                            | 9 900                               | 9 604                            | 0,10                      | Total Cameroun                                                |                                     | 13 077                           | 0,14                      |
| 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                        | 58 500                              | 40 422                           | 0,43                      | Armor RE Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | <b>CANADA</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| Blackwattle RMBS Trust                                                                         |                                     |                                  |                           | 8,810 % éch. 07/06/2033                            | 500                                 | 500                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 5,049 % éch. 12/12/2056                                                                        | 270                                 | 187                              | 0,00                      | 12,050 % éch. 07/01/2032                           | 250                                 | 264                              | 0,00                      | Air Canada Pass-Through Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust                                                       |                                     |                                  |                           | Carnival Corp. Ltd.                                |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 15/07/2031                                       | 616                                 | 586                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 15/08/2057                                                                        | 4 069                               | 2 818                            | 0,03                      | 4,000 % éch. 01/08/2028                            | 12 200                              | 11 980                           | 0,13                      | 5,250 % éch. 01/10/2030                                       | 1 810                               | 1 823                            | 0,02                      |
| 5,050 % éch. 15/05/2057                                                                        | 127                                 | 88                               | 0,00                      | Everglades Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | B.C. Ltd.                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,167 % éch. 13/11/2057                                                                        | 5 000                               | 3 465                            | 0,04                      | 10,289 % éch. 22/05/2033                           | 650                                 | 649                              | 0,01                      | 10,000 % éch. 15/04/2032                                      | 2 500                               | 2 534                            | 0,03                      |
| 5,300 % éch. 15/08/2057                                                                        | 51 662                              | 35 752                           | 0,38                      | Gateway Re Ltd.                                    |                                     |                                  |                           | B.C. Unlimited Liability Co.                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 15/05/2057                                                                        | 1 952                               | 1 352                            | 0,01                      | 5,550 % éch. 06/07/2029                            | 250                                 | 249                              | 0,00                      | 3,875 % éch. 15/01/2028                                       | 9 075                               | 8 909                            | 0,09                      |
| 5,507 % éch. 13/11/2057                                                                        | 4 400                               | 3 050                            | 0,03                      | Greengrove RE Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/10/2030                                       | 9 850                               | 9 305                            | 0,10                      |
| Liberty Trust                                                                                  |                                     |                                  |                           | 11,270 % éch. 08/04/2032                           | 350                                 | 357                              | 0,00                      | 4,375 % éch. 15/01/2028                                       | 9 070                               | 8 973                            | 0,09                      |
| 5,012 % éch. 10/10/2058                                                                        | 3 385                               | 2 345                            | 0,03                      | Hestia Re Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/09/2029                                       | 6 200                               | 6 240                            | 0,07                      |
| 5,312 % éch. 10/10/2058                                                                        | 40 000                              | 27 670                           | 0,29                      | 13,039 % éch. 16/04/2029                           | 500                                 | 504                              | 0,01                      | Bausch & Lomb Corp.                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,405 % éch. 25/09/2056                                                                        | 6 902                               | 4 789                            | 0,05                      | Integrity Re Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 01/10/2028                                       | 3 750                               | 3 858                            | 0,04                      |
| Pepper Prime Trust                                                                             |                                     |                                  |                           | 13,270 % éch. 06/06/2027                           | 250                                 | 253                              | 0,00                      | CI Financial Corp.                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,999 % éch. 12/04/2067                                                                        | 251                                 | 174                              | 0,00                      | 15,770 % éch. 06/06/2028                           | 250                                 | 259                              | 0,00                      | 4,625 % éch. 12/12/2031                                       | € 3 600                             | 4 172                            | 0,04                      |
| Pepper Residential Securities Trust                                                            |                                     |                                  |                           | 29,020 % éch. 06/06/2027                           | 300                                 | 314                              | 0,00                      | 7,500 % éch. 30/05/2029                                       | \$ 5 200                            | 5 452                            | 0,06                      |
| 5,299 % éch. 12/07/2067                                                                        | 63 207                              | 43 755                           | 0,46                      | Luca RE Ltd.                                       |                                     |                                  |                           | Enbridge, Inc.                                                |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                                                               |                                     |                                  |                           | 10,800 % éch. 22/07/2031                           | 1 300                               | 1 352                            | 0,01                      | 5,700 % éch. 08/03/2033                                       | 5 000                               | 5 165                            | 0,05                      |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (a)                                                                    | 174 400                             | 120 429                          | 1,27                      | Nature Coast Re Ltd.                               |                                     |                                  |                           | goeasy Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,713 % éch. 30/12/2057 (a)                                                                    | 5 800                               | 4 009                            | 0,04                      | 11,789 % éch. 26/02/2030                           | 400                                 | 403                              | 0,00                      | 6,875 % éch. 15/05/2030                                       | 1 675                               | 1 492                            | 0,02                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 13,271 % éch. 10/04/2033                           | 300                                 | 312                              | 0,00                      | 6,875 % éch. 15/02/2031                                       | 135                                 | 119                              | 0,00                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 01/10/2030                                       | 2 275                               | 2 051                            | 0,02                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 01/12/2028                                       | 1 400                               | 1 376                            | 0,01                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Open Text Corp.                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/02/2028                                       | 3 000                               | 2 925                            | 0,03                      |



## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                                   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                    | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                             |         |           |        |      |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|---------------------------|-----------------------------|---------|-----------|--------|------|
| Parex Resources, Inc.<br>8,500 % éch. 11/05/2031                       | \$                                  | 2 500                            | \$2 541                   | 0,03        | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                  |                           | 11,750 % éch. 24/01/2035 | 141 052 200                         | 40 183                                                              | 0,42                      |                             |         |           |        |      |
| Total Canada                                                           |                                     |                                  | 67 521                    | 0,71        | 7,721 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 639                              | 12                        | 0,00                     | 12,750 % éch. 28/11/2040            | 81 597 200                                                          | 24 691                    | 0,26                        |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | Lima Metro Line Finance Ltd.                                                          |                                  |                           |                          | 13,250 % éch. 09/02/2033            | 40 598 000                                                          | 12 425                    | 0,13                        |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | 5,875 % éch. 05/07/2034                                                               | 2 149                            | 2 198                     | 0,02                     | Total Colombie                      |                                                                     | 206 141                   | 2,17                        |         |           |        |      |
| ÎLES CAÏMANS                                                           |                                     |                                  |                           |             | MGM China Holdings Ltd.                                                               | 400                              | 398                       | 0,01                     |                                     |                                                                     | 209 427                   | 2,21                        |         |           |        |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                             |                                     |                                  |                           |             | 4,750 % éch. 01/02/2027                                                               |                                  |                           |                          | CONGO                               |                                                                     |                           |                             |         |           |        |      |
| ACORE Issuer LLC<br>5,089 % éch. 20/08/2043                            |                                     | 4 100                            | 4 102                     | 0,04        | QNB Finance Ltd.                                                                      |                                  |                           |                          | ÉMISSIONS SOUVERAINES               |                                                                     |                           |                             |         |           |        |      |
| AGL CLO Ltd.<br>5,040 % éch. 20/04/2037                                |                                     | 4 900                            | 4 906                     | 0,05        | 4,538 % éch. 19/09/2027                                                               | \$                               | 21 000                    | \$20 995                 | 0,22                                | Obligation internationale congolaise                                | \$                        | 10 250                      | \$9 977 | 0,10      |        |      |
| Apollo Aviation Securitization Equity Trust<br>5,243 % éch. 16/02/2050 |                                     | 20 135                           | 19 834                    | 0,21        | SRC Sukuk Ltd.                                                                        |                                  | 38 200                    | 37 740                   | 0,40                                | 9,500 % éch. 17/02/2035                                             | 8 400                     | 8 124                       | 0,09    |           |        |      |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>4,727 % éch. 24/07/2034                |                                     | 1 100                            | 1 101                     | 0,01        | 4,375 % éch. 02/04/2029                                                               |                                  |                           |                          | 9,500 % éch. 26/05/2036             |                                                                     |                           |                             | 0,19    |           |        |      |
| 4,762 % éch. 21/10/2034                                                |                                     | 1 000                            | 1 001                     | 0,01        | Suci Second Investment Co.                                                            |                                  | 9 000                     | 8 973                    | 0,10                                | Total Congo                                                         |                           | 18 101                      |         |           |        |      |
| Barings Private Credit Corp. CLO<br>5,126 % éch. 22/05/2034            |                                     | 2 300                            | 2 302                     | 0,03        | 4,375 % éch. 10/09/2027                                                               |                                  | 7 200                     | 7 242                    | 0,08                                | CONGO, RÉPUBLIQUE DÉMOCRATIQUE DU                                   |                           |                             |         |           |        |      |
| CQS U.S. CLO Ltd.<br>4,875 % éch. 20/01/2035                           |                                     | 1 000                            | 1 001                     | 0,01        | 5,171 % éch. 05/03/2031                                                               |                                  | 13 300                    | 13 639                   | 0,14                                | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                           |                             |         |           |        |      |
| FS Rialto Issuer LLC<br>5,089 % éch. 19/01/2044                        |                                     | 1 300                            | 1 304                     | 0,01        | 6,000 % éch. 25/10/2028                                                               |                                  |                           |                          | Obligation internationale de la RDC |                                                                     | 12 000                    | 12 581                      | 0,13    |           |        |      |
| PFP Ltd.<br>5,137 % éch. 18/08/2043                                    |                                     | 1 800                            | 1 808                     | 0,02        | TIB Diversified Payment Rights Finance Co.                                            |                                  | 7 400                     | 7 518                    | 0,08                                | 9,500 % éch. 16/04/2037                                             |                           |                             |         |           |        |      |
| Symphony CLO Ltd.<br>4,725 % éch. 19/04/2034                           |                                     | 2 900                            | 2 902                     | 0,03        | 6,551 % éch. 15/11/2034                                                               |                                  |                           |                          | COSTA RICA                          |                                                                     |                           |                             |         |           |        |      |
| Trinitas CLO Ltd.<br>4,825 % éch. 20/10/2034                           |                                     | 3 300                            | 3 304                     | 0,04        | Trafford Centre Finance Ltd.                                                          | £                                | 3 700                     | 4 727                    | 0,05                                | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                           |                             |         |           |        |      |
| Valerie Asset Ltd.<br>5,219 % éch. 15/09/2050 (j)                      |                                     | 39 841                           | 39 192                    | 0,41        | VD DPR Finance Co.                                                                    | \$                               | 13 300                    | 13 609                   | 0,14                                | Obligation internationale du gouvernement costaricain               | €                         | 13 500                      | 16 239  | 0,17      |        |      |
| 5,267 % éch. 15/09/2050 (j)                                            |                                     | 5 657                            | 5 085                     | 0,05        | 6,833 % éch. 15/03/2035                                                               |                                  |                           | 210 255                  | 2,22                                | 5,500 % éch. 21/11/2030                                             | €                         | 12 750                      | 15 552  | 0,17      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  | 87 842                    | 0,92        |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 5,950 % éch. 27/04/2033                                             |                           | 9 500                       | 11 500  | 0,12      |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                                    |                                     |                                  |                           |             | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                 |                                  |                           |                          |                                     | 6,001 % éch. 16/01/2036                                             | \$                        | 5 100                       | 5 769   | 0,06      |        |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.<br>0,000 % éch. 31/12/2026 (d)               |                                     | 555                              | 2                         | 0,00        |                                                                                       |                                  | 6 625                     | 6 686                    | 0,07                                | 7,300 % éch. 13/11/2054                                             |                           |                             | 49 060  | 0,52      |        |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (d)                                            |                                     | 694                              | 5                         | 0,00        | CHILI                                                                                 |                                  |                           | 304 828                  | 3,21                                | Total Costa Rica                                                    |                           |                             |         |           |        |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)                                            |                                     | 1 111                            | 8                         | 0,00        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                         |                                  |                           |                          |                                     | CHYPRE                                                              |                           |                             |         |           |        |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (d)                                            |                                     | 1 111                            | 8                         | 0,00        | Empresa Nacional del Petroleo                                                         | 2 500                            | 2 556                     | 0,03                     | Atrium Finance PLC                  | €                                                                   | 9 900                     | 10 884                      | 0,11    |           |        |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (d)                                            |                                     | 1 389                            | 9                         | 0,00        | 5,950 % éch. 30/07/2034                                                               |                                  |                           |                          | 2,625 % éch. 05/09/2027             |                                                                     |                           |                             |         |           |        |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                            |                                     | 1 389                            | 5                         | 0,00        | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                 |                                  |                           |                          | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE                  |                                                                     |                           |                             |         |           |        |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (d)                                            |                                     | 2 419                            | 8                         | 0,00        | Obligation internationale du gouvernement chilien                                     |                                  |                           |                          | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                                                     |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  | 45                        | 0,00        | 3,750 % éch. 14/01/2032                                                               | €                                | 13 650                    | 15 809                   | 0,17                                | EP Infrastructure A/S                                               |                           | 6 850                       | 7 626   | 0,08      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | 3,875 % éch. 09/07/2031                                                               | 5 000                            | 5 839                     | 0,06                     | EPH Financing International A/S     |                                                                     | 4 950                     | 6 020                       | 0,06    |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | Total Chili                                                                           |                                  |                           | 21 648                   | 0,23                                | 5,875 % éch. 30/11/2029                                             |                           |                             | 13 646  | 0,14      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           | 24 204                   | 0,26                                | Total République tchèque                                            |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | DANEMARK                                                            |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | ACTIONS                                                                               |                                  |                           |                          |                                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | CHINE                                                                                 |                                  |                           |                          |                                     | H Lundbeck A/S                                                      |                           | 4 700                       | 5 387   | 0,06      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | ACTIONS ORDINAIRES                                                                    |                                  |                           |                          |                                     | 3,375 % éch. 02/06/2029                                             |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             | Kaisa Group Holdings Ltd. (c)                                                         | 49 229 326                       | 295                       | 0,00                     |                                     | RÉPUBLIQUE DOMINICAINE                                              |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | \$                        | 1 400                       | 1 394   | 0,02      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 6,150 % éch. 17/05/2038                                             |                           | 30 900                      | 30 736  | 0,32      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 6,500 % éch. 15/02/2048 (k)                                         |                           | 9 700                       | 10 303  | 0,11      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 6,950 % éch. 15/03/2037                                             |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Total République dominicaine                                        |                           |                             | 42 433  | 0,45      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | ÉQUATEUR                                                            |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Obligation internationale du gouvernement équatorien                |                           | 19 148                      | 16 563  | 0,17      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 0,000 % éch. 31/07/2030 (d)(k)                                      |                           | 5,000 % éch. 31/07/2040     | 14 324  | 12 047    | 0,13   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 5,000 % éch. 31/07/2040                                             |                           | 6,900 % éch. 31/07/2035     | 7 006   | 6 447     | 0,07   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 6,900 % éch. 31/07/2035                                             |                           | 8,750 % éch. 29/01/2034     | 3 300   | 3 344     | 0,03   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 8,750 % éch. 29/01/2034                                             |                           | 9,250 % éch. 29/01/2039 (k) | 3 600   | 3 696     | 0,04   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 9,250 % éch. 29/01/2039 (k)                                         |                           | 9,250 % éch. 29/01/2039     | 6 100   | 6 263     | 0,07   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Total Équateur                                                      |                           |                             |         | 48 360    | 0,51   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | ÉGYPTE                                                              |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Obligation internationale du gouvernement égyptien                  | €                         | 18 850                      | 21 984  | 0,23      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 6,375 % éch. 11/04/2031                                             | \$                        | 20 175                      | 17 472  | 0,18      |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 7,500 % éch. 16/02/2061                                             |                           | 8,500 % éch. 31/01/2047     | 9 500   | 9 323     | 0,10   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 8,500 % éch. 31/01/2047                                             |                           | 9,450 % éch. 04/02/2033 (k) | 5 000   | 5 559     | 0,06   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 9,450 % éch. 04/02/2033 (k)                                         |                           | 21,954 % éch. 04/03/2028    | EGP     | 1 195 700 | 23 594 | 0,25 |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 21,954 % éch. 04/03/2028                                            |                           |                             |         | 77 932    | 0,82   |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Total Égypte                                                        |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | SALVADOR                                                            |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                           |                             |         |           |        |      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | Comision Ejecutiva Hidroelectrica del Rio Lempa                     |                           | 8,650 % éch. 24/01/2033     | \$      | 8 000     | 8 461  | 0,09 |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                                       |                                  |                           |                          |                                     | 8,650 % éch. 24/01/2033                                             |                           |                             |         |           |        |      |

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement salvadorien |                                     |                                  |                           |
| 7,650 % éch. 15/06/2035                               | \$ 494                              | \$512                            | 0,01                      |
| 8,250 % éch. 10/04/2032                               | 4 000                               | 4 282                            | 0,04                      |
| 9,250 % éch. 17/04/2030                               | 5 025                               | 5 428                            | 0,06                      |
| 9,650 % éch. 21/11/2054 (k)                           | 6 250                               | 7 182                            | 0,07                      |
|                                                       |                                     | 17 404                           | 0,18                      |
| Total Salvador                                        |                                     | 25 865                           | 0,27                      |

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>FINLANDE</b>                      |       |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |       |       |      |
| Balder Finland Oyj                   |       |       |      |
| 1,000 % éch. 18/01/2027              | € 200 | 226   | 0,00 |
| 1,375 % éch. 24/05/2030              | 4 900 | 5 140 | 0,06 |
| Total Finlande                       |       | 5 366 | 0,06 |

|                                      |     |     |      |
|--------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>FRANCE</b>                        |     |     |      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>    |     |     |      |
| FCT Ponant                           |     |     |      |
| 2,855 % éch. 27/09/2038              | 565 | 646 | 0,01 |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |     |     |      |

|                                   |          |        |      |
|-----------------------------------|----------|--------|------|
| Altice France S.A.                |          |        |      |
| 9,500 % éch. 01/11/2029           | \$ 3 811 | 3 872  | 0,04 |
| <b>BPCE S.A.</b>                  |          |        |      |
| 5,876 % éch. 14/01/2031           | 3 700    | 3 802  | 0,04 |
| 7,003 % éch. 19/10/2034           | 5 000    | 5 446  | 0,06 |
| <b>Électricité de France S.A.</b> |          |        |      |
| 4,875 % éch. 21/09/2038           | 3 000    | 2 776  | 0,03 |
| 6,375 % éch. 13/01/2055           | 6 000    | 6 131  | 0,06 |
| 9,125 % éch. 15/03/2033 (g)       | 7 425    | 8 624  | 0,09 |
| <b>Eramet S.A.</b>                |          |        |      |
| 6,500 % éch. 30/11/2029           | € 8 000  | 9 059  | 0,09 |
| <b>iliad S.A.</b>                 |          |        |      |
| 4,250 % éch. 09/01/2032           | 3 600    | 4 152  | 0,04 |
| <b>New Immo Holding S.A.</b>      |          |        |      |
| 4,875 % éch. 08/12/2028           | 7 900    | 9 072  | 0,10 |
| 6,000 % éch. 22/03/2029           | 1 300    | 1 531  | 0,02 |
| <b>TDF Infrastructure S.A.S.</b>  |          |        |      |
| 1,750 % éch. 01/12/2029           | 4 300    | 4 621  | 0,05 |
| <b>Worldline S.A.</b>             |          |        |      |
| 4,125 % éch. 12/09/2028           | 2 600    | 2 802  | 0,03 |
|                                   |          | 61 888 | 0,65 |

|                                        |           |        |      |
|----------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |           |        |      |
| Altice France S.A.                     |           |        |      |
| 9,079 % éch. 30/05/2031                | 1 966     | 2 298  | 0,02 |
| 10,548 % éch. 31/05/2031               | \$ 10 697 | 10 943 | 0,12 |
|                                        |           | 13 241 | 0,14 |
| Total France                           |           | 75 775 | 0,80 |

|                                                    |        |        |      |
|----------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>GABON</b>                                       |        |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |        |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement gabonais |        |        |      |
| 9,500 % éch. 18/02/2029                            | 12 825 | 12 267 | 0,13 |

|                                                                  |          |        |      |
|------------------------------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>ALLEMAGNE</b>                                                 |          |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |          |        |      |
| Cerdia Finanz GmbH                                               |          |        |      |
| 9,375 % éch. 03/10/2031                                          | 1 500    | 1 348  | 0,01 |
| <b>Cheplapharm Arzneimittel GmbH</b>                             |          |        |      |
| 7,125 % éch. 15/06/2031                                          | € 5 100  | 5 987  | 0,06 |
| <b>Deutsche Bank AG</b>                                          |          |        |      |
| 3,742 % éch. 07/01/2033                                          | \$ 1 725 | 1 582  | 0,02 |
| 5,882 % éch. 08/07/2031                                          | 23 775   | 24 165 | 0,26 |
| <b>DVI Deutsche Vermoegens- &amp; Immobilienverwaltungs GmbH</b> |          |        |      |
| 4,875 % éch. 21/08/2030                                          | € 4 500  | 5 255  | 0,06 |
| <b>IHO Verwaltungs GmbH</b>                                      |          |        |      |
| 5,625 % éch. 15/05/2031                                          | 1 800    | 2 143  | 0,02 |
| <b>Volkswagen Bank GmbH</b>                                      |          |        |      |
| 2,500 % éch. 31/07/2026                                          | 15 800   | 18 066 | 0,19 |

|                         |                                     |                                  |                           |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
| ZF Finance GmbH         |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 21/09/2028 | € 29 300                            | \$33 325                         | 0,35                      |
|                         |                                     | 91 871                           | 0,97                      |

|                                        |          |        |      |
|----------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |          |        |      |
| Envalor Finance GmbH                   |          |        |      |
| 9,163 % éch. 29/03/2030                | \$ 2 614 | 2 283  | 0,02 |
| Total Allemagne                        |          | 94 154 | 0,99 |

|                                                   |        |        |      |
|---------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>GHANA</b>                                      |        |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                      |        |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement ghanéen |        |        |      |
| 0,000 % éch. 03/07/2026 (d)                       | 287    | 287    | 0,00 |
| 0,000 % éch. 03/01/2030 (d)(k)                    | 1 573  | 1 414  | 0,01 |
| 5,000 % éch. 03/07/2029                           | 17 752 | 17 566 | 0,19 |
| 5,000 % éch. 03/07/2035                           | 11 893 | 11 042 | 0,12 |
| Total Ghana                                       |        | 30 309 | 0,32 |

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>GUATEMALA</b>                     |       |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |       |       |      |
| Industrial Subordinated Trust 2.0    |       |       |      |
| 6,550 % éch. 15/04/2036              | 1 300 | 1 321 | 0,01 |

|                                                         |        |        |      |
|---------------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |        |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement guatémaltèque |        |        |      |
| 3,700 % éch. 07/10/2033                                 | 6 800  | 6 071  | 0,06 |
| 7,050 % éch. 04/10/2032                                 | 14 600 | 15 800 | 0,17 |
|                                                         |        | 21 871 | 0,23 |
| Total Guatemala                                         |        | 23 192 | 0,24 |

|                                        |         |       |      |
|----------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b> |         |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |         |       |      |
| Sirius Real Estate Ltd.                |         |       |      |
| 4,000 % éch. 22/01/2032                | € 4 400 | 4 999 | 0,05 |

|                                      |          |       |      |
|--------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>HONG KONG</b>                     |          |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |          |       |      |
| Fortune Star BVI Ltd.                |          |       |      |
| 8,500 % éch. 19/05/2028              | \$ 3 000 | 3 082 | 0,03 |

|                                                    |          |        |      |
|----------------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>HONGRIE</b>                                     |          |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |          |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois |          |        |      |
| 4,500 % éch. 16/06/2034                            | € 5 000  | 5 986  | 0,06 |
| 4,875 % éch. 22/03/2040 (k)                        | 4 500    | 5 396  | 0,06 |
| 5,375 % éch. 12/09/2033                            | 7 125    | 8 954  | 0,09 |
| 5,500 % éch. 26/03/2036                            | \$ 5 000 | 5 027  | 0,05 |
| <b>Magyar Export-Import Bank</b>                   |          |        |      |
| 6,000 % éch. 16/05/2029                            | € 6 000  | 7 302  | 0,08 |
| Total Hongrie                                      |          | 32 665 | 0,34 |

|                                      |          |       |      |
|--------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>INDE</b>                          |          |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |          |       |      |
| Muthoot Finance Ltd.                 |          |       |      |
| 5,750 % éch. 04/08/2030              | \$ 4 100 | 4 018 | 0,04 |

|                                                                  |        |        |      |
|------------------------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>INDONÉSIE</b>                                                 |        |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |        |        |      |
| Pertamina Persero PT                                             |        |        |      |
| 6,500 % éch. 07/11/2048                                          | 33 400 | 34 071 | 0,36 |
| <b>Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara</b> |        |        |      |
| 3,000 % éch. 30/06/2030                                          | 22 900 | 21 085 | 0,22 |
| 6,150 % éch. 21/05/2048                                          | 23 600 | 22 580 | 0,24 |
|                                                                  |        | 77 736 | 0,82 |

|                                                      |         |        |      |
|------------------------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |         |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien |         |        |      |
| 4,100 % éch. 04/03/2034                              | € 6 000 | 6 742  | 0,07 |
| 4,460 % éch. 04/03/2038                              | 9 500   | 10 571 | 0,11 |
| 5,125 % éch. 29/05/2038                              | 3 000   | 3 527  | 0,04 |
|                                                      |         | 20 840 | 0,22 |
| Total Indonésie                                      |         | 98 576 | 1,04 |

|                                   |                                     |                                  |                           |
|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| DESCRIPTION                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
| <b>IRLANDE</b>                    |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b> |                                     |                                  |                           |

|                                     |          |           |      |
|-------------------------------------|----------|-----------|------|
| Anchorage Capital Europe CLO DAC    |          |           |      |
| 3,424 % éch. 15/10/2038             | € 18 900 | \$ 21 653 | 0,23 |
| <b>Aqueduct European CLO DAC</b>    |          |           |      |
| 3,511 % éch. 15/07/2039 (a)         | 1 800    | 2 058     | 0,02 |
| <b>Arbour CLO DAC</b>               |          |           |      |
| 3,433 % éch. 15/11/2037             | 2 300    | 2 633     | 0,03 |
| 3,453 % éch. 15/08/2038             | 2 200    | 2 516     | 0,03 |
| 3,581 % éch. 15/12/2038             | 2 300    | 2 633     | 0,03 |
| 3,883 % éch. 15/08/2038             | 1 000    | 1 145     | 0,01 |
| 4,451 % éch. 15/12/2038             | 1 000    | 1 148     | 0,01 |
| <b>Arcano Euro CLO DAC</b>          |          |           |      |
| 4,215 % éch. 25/07/2039             | 4 400    | 5 049     | 0,05 |
| <b>Ares European CLO DAC</b>        |          |           |      |
| 2,984 % éch. 15/10/2031             | 807      | 923       | 0,01 |
| 3,088 % éch. 20/04/2032             | 291      | 332       | 0,00 |
| 3,234 % éch. 21/10/2034             | 551      | 630       | 0,01 |
| 3,840 % éch. 17/04/2032             | 1 000    | 1 146     | 0,01 |
| 4,004 % éch. 21/10/2034             | 1 000    | 1 147     | 0,01 |
| <b>Aurium CLO DAC</b>               |          |           |      |
| 2,973 % éch. 16/01/2031             | 1 972    | 2 258     | 0,02 |
| 3,347 % éch. 22/06/2034             | 4 997    | 5 709     | 0,06 |
| <b>Bain Capital Euro CLO DAC</b>    |          |           |      |
| 3,449 % éch. 15/01/2037             | 3 000    | 3 435     | 0,04 |
| <b>Barings Euro CLO DAC</b>         |          |           |      |
| 3,426 % éch. 15/08/2039             | 2 500    | 2 861     | 0,03 |
| 3,444 % éch. 21/10/2038             | 2 500    | 2 863     | 0,03 |
| 4,154 % éch. 21/10/2038             | 1 000    | 1 151     | 0,01 |
| 4,850 % éch. 21/10/2038             | 1 000    | 1 149     | 0,01 |
| <b>Black Diamond CLO DAC</b>        |          |           |      |
| 3,263 % éch. 15/05/2032             | 339      | 388       | 0,00 |
| <b>Blackrock European CLO DAC</b>   |          |           |      |
| 3,158 % éch. 20/01/2036             | 5 000    | 5 723     | 0,06 |
| 3,220 % éch. 17/07/2034             | 9 831    | 11 259    | 0,12 |
| <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>         |          |           |      |
| 2,804 % éch. 15/04/2031             | 617      | 704       | 0,01 |
| <b>Bosphorus CLO DAC</b>            |          |           |      |
| 3,614 % éch. 15/04/2038             | 1 800    | 2 062     | 0,02 |
| <b>Bridgepoint CLO DAC</b>          |          |           |      |
| 3,414 % éch. 15/01/2034             | 762      | 872       | 0,01 |
| <b>Cairn CLO DAC</b>                |          |           |      |
| 3,170 % éch. 29/10/2034             | 1 000    | 1 145     | 0,01 |
| 4,304 % éch. 15/01/2040             | 1 000    | 1 152     | 0,01 |
| <b>Capital Four CLO DAC</b>         |          |           |      |
| 3,394 % éch. 15/04/2038             | 4 600    | 5 259     | 0,06 |
| 3,415 % éch. 25/10/2038             | 2 600    | 2 976     | 0,03 |
| 3,854 % éch. 15/04/2038             | 2 000    | 2 290     | 0,02 |
| <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>         |          |           |      |
| 3,173 % éch. 15/08/2032             | 831      | 950       | 0,01 |
| 3,493 % éch. 15/08/2038             | 7 500    | 8 592     | 0,09 |
| <b>Cumulus Static CLO DAC</b>       |          |           |      |
| 3,483 % éch. 15/11/2033             | 12 977   | 14 847    | 0,16 |
| <b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>   |          |           |      |
| 3,066 % éch. 25/04/2036             | 2 300    | 2 631     | 0,03 |
| 3,285 % éch. 23/01/2039             | 2 000    | 2 290     | 0,02 |
| <b>Dryden Euro CLO DAC</b>          |          |           |      |
| 2,864 % éch. 15/04/2033             | 3 951    | 4 518     | 0,05 |
| 3,143 % éch. 15/05/2034             | 4 084    | 4 669     | 0,05 |
| <b>Euro-Galaxy CLO DAC</b>          |          |           |      |
| 2,781 % éch. 24/04/2034             | 5 412    | 6 184     | 0,07 |
| <b>Grosvenor Place CLO DAC</b>      |          |           |      |
| 3,444 % éch. 15/01/2039             | 3 100    | 3 548     | 0,04 |
| <b>Harvest CLO DAC</b>              |          |           |      |
| 3,054 % éch. 15/01/2032             | 10 052   | 11 497    | 0,12 |
| 3,523 % éch. 25/07/2037 (a)         | 2 000    | 2 287     | 0,02 |
| <b>Hayfin Emerald CLO DAC</b>       |          |           |      |
| 3,054 % éch. 27/05/2034             | 5 791    | 6 626     | 0,07 |
| 3,404 % éch. 22/01/2039             | 3 200    | 3 665     | 0,04 |
| 3,454 % éch. 15/10/2038             | 2 600    | 2 975     | 0,03 |
| 3,498 % éch. 18/10/2039             | 4 000    | 4 577     | 0,05 |
| <b>ICG Euro CLO DAC</b>             |          |           |      |
| 3,455 % éch. 26/01/2038             | 2 200    | 2 518     | 0,03 |
| 4,055 % éch. 26/01/2038             | 2 000    | 2 299     | 0,02 |
| <b>Indigo Credit Management DAC</b> |          |           |      |
| 3,404 % éch. 15/07/2038             | 3 600    | 4 122     | 0,04 |
| 3,464 % éch. 15/10/2037             | 1 000    | 1 145     | 0,01 |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Invesco Euro CLO DAC                                                                           | € 2 400                             | \$ 2 747                         | 0,03                      | <b>ISRAËL</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,277 % éch. 15/07/2037                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Madison Park Euro Funding DAC                                                                  | 5 523                               | 6 322                            | 0,07                      | Bank Hapoalim B.M.                                 | \$ 5 200                            | \$ 5 139                         | 0,05                      |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,722 % éch. 14/07/2029                            | 3 300                               | 3 269                            | 0,03                      |
| Montmartre Euro CLO DAC                                                                        | 2 312                               | 2 646                            | 0,03                      | 5,252 % éch. 14/01/2033                            |                                     |                                  |                           |
| 3,164 % éch. 15/07/2034                                                                        |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.                          | 8 000                               | 8 044                            | 0,09                      |
| MV Credit Euro CLO DAC                                                                         | 2 300                               | 2 632                            | 0,03                      | 5,642 % éch. 29/06/2033                            |                                     |                                  |                           |
| 3,583 % éch. 15/02/2038                                                                        |                                     |                                  |                           | Total Israël                                       | 16 452                              | 16 452                           | 0,17                      |
| OCP Euro CLO DAC                                                                               | 22 500                              | 25 747                           | 0,27                      | <b>ITALIE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,158 % éch. 20/04/2035                                                                        | 3 800                               | 4 348                            | 0,05                      | <b>TITRES ADOSSES À DES ACTIFS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| 3,478 % éch. 20/07/2036                                                                        | 2 000                               | 2 287                            | 0,02                      | Fulvia Spv SRL                                     | € 29 300                            | 33 594                           | 0,35                      |
| 3,513 % éch. 15/04/2037                                                                        |                                     |                                  |                           | 3,013 % éch. 24/12/2042                            |                                     |                                  |                           |
| Palmer Square European Loan Funding DAC                                                        | 4 057                               | 4 638                            | 0,05                      | Golden Bar Securitisation SRL                      | 9 000                               | 10 320                           | 0,11                      |
| 3,054 % éch. 15/10/2034                                                                        | 4 300                               | 4 922                            | 0,05                      | 3,116 % éch. 20/12/2045                            | 6 428                               | 7 391                            | 0,08                      |
| 3,150 % éch. 15/10/2035                                                                        | 10 645                              | 12 178                           | 0,13                      | 3,436 % éch. 22/09/2043                            |                                     |                                  |                           |
| 3,433 % éch. 15/02/2035                                                                        | 1 000                               | 1 143                            | 0,01                      | Koromo Italy Compartment                           | 2 334                               | 2 674                            | 0,03                      |
| 3,754 % éch. 15/10/2034                                                                        |                                     |                                  |                           | 2,905 % éch. 26/02/2032                            |                                     |                                  |                           |
| Penta CLO DAC                                                                                  | 2 000                               | 2 289                            | 0,02                      | Marzio Finance SRL                                 | 2 053                               | 2 354                            | 0,02                      |
| 3,015 % éch. 25/07/2036                                                                        |                                     |                                  |                           | 2,751 % éch. 28/09/2049                            | 56 333                              | 56 333                           | 0,59                      |
| Providus CLO DAC                                                                               | 1 700                               | 1 944                            | 0,02                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| 3,374 % éch. 15/07/2038                                                                        | 2 900                               | 3 319                            | 0,04                      | Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC                   | \$ 5 175                            | 5 183                            | 0,05                      |
| 3,513 % éch. 15/11/2039                                                                        | 2 000                               | 2 291                            | 0,02                      | 7,500 % éch. 15/02/2032                            |                                     |                                  |                           |
| 3,904 % éch. 15/07/2038                                                                        |                                     |                                  |                           | Eni SpA                                            | 16 000                              | 16 248                           | 0,17                      |
| Rockford Tower Europe CLO DAC                                                                  | 22 000                              | 25 182                           | 0,27                      | 5,500 % éch. 15/05/2034                            | 4 800                               | 4 937                            | 0,05                      |
| 3,489 % éch. 29/08/2036                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 19/05/2035                            |                                     |                                  |                           |
| St. Paul's CLO DAC                                                                             | 3 087                               | 3 533                            | 0,04                      | Fiberco SpA                                        | € 4 100                             | 4 867                            | 0,05                      |
| 3,124 % éch. 15/04/2033                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 15/04/2031                            |                                     |                                  |                           |
| Tikehau CLO DAC                                                                                | 3 400                               | 3 894                            | 0,04                      | Intesa Sanpaolo SpA                                | \$ 6 276                            | 6 136                            | 0,07                      |
| 3,458 % éch. 20/01/2037                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 23/09/2029                            | 2 600                               | 3 006                            | 0,03                      |
| Toro European CLO DAC                                                                          | 1 292                               | 1 479                            | 0,02                      | 8,248 % éch. 21/11/2033                            |                                     |                                  |                           |
| 3,070 % éch. 12/01/2032                                                                        | 5 565                               | 6 367                            | 0,07                      | Lottomatica Group SpA                              | € 2 300                             | 2 650                            | 0,03                      |
| 3,093 % éch. 15/02/2034                                                                        | 1 763                               | 2 017                            | 0,02                      | 4,625 % éch. 30/04/2032                            |                                     |                                  |                           |
| 3,155 % éch. 25/07/2034                                                                        | 967                                 | 1 106                            | 0,01                      | Mundys SpA                                         | 23 404                              | 26 222                           | 0,28                      |
| 3,194 % éch. 15/07/2034                                                                        | 10 100                              | 11 561                           | 0,12                      | 1,875 % éch. 12/02/2028                            |                                     |                                  |                           |
| 3,474 % éch. 15/04/2037                                                                        |                                     |                                  |                           | Snam SpA                                           | \$ 5 100                            | 5 128                            | 0,05                      |
| Voya Euro CLO DAC                                                                              | 15 600                              | 17 847                           | 0,19                      | 5,000 % éch. 28/05/2030                            |                                     |                                  |                           |
| 3,174 % éch. 15/10/2034                                                                        |                                     |                                  |                           | UniCredit SpA                                      | 5 101                               | 5 370                            | 0,06                      |
|                                                                                                |                                     | 338 648                          | 3,57                      | 7,296 % éch. 02/04/2034                            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           | Total Italie                                       | 136 080                             | 136 080                          | 1,43                      |
| AerCap Ireland Capital DAC                                                                     | \$ 23 950                           | 23 966                           | 0,25                      | <b>CÔTE D'IVOIRE</b>                               |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/10/2027                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           |
| CIMA Finance DAC                                                                               | 6 205                               | 5 901                            | 0,06                      | Obligation internationale du gouvernement ivoirien | € 10 400                            | 11 505                           | 0,12                      |
| Fluttre Treasury DAC                                                                           | 14 000                              | 14 239                           | 0,15                      | 6,625 % éch. 22/03/2048                            | 3 400                               | 4 002                            | 0,04                      |
| 6,375 % éch. 29/04/2029                                                                        |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 17/10/2040                            | \$ 6 500                            | 7 123                            | 0,08                      |
| Iridium Capital PLC                                                                            | € 19 525                            | 24 259                           | 0,26                      | 8,075 % éch. 01/04/2036                            |                                     |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 18/06/2029                                                                        |                                     |                                  |                           | Total Côte d'Ivoire                                | 22 630                              | 22 630                           | 0,24                      |
|                                                                                                |                                     | 68 365                           | 0,72                      | <b>JAPON</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                         |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| République du Panama                                                                           | 22 350                              | 25 592                           | 0,27                      | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.               | 13 400                              | 13 695                           | 0,15                      |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,574 % éch. 16/01/2036                            |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSES À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | Mizuho Financial Group, Inc.                       | 2 200                               | 2 257                            | 0,02                      |
| Dilosk RMBS DAC                                                                                | 1 000                               | 1 142                            | 0,01                      | 5,594 % éch. 10/07/2035                            |                                     |                                  |                           |
| 2,733 % éch. 25/10/2064                                                                        | 1 024                               | 1 170                            | 0,01                      | Nissan Motor Co. Ltd.                              | 17 100                              | 16 832                           | 0,18                      |
| 2,845 % éch. 25/01/2063                                                                        | 2 844                               | 3 254                            | 0,03                      | 4,345 % éch. 17/09/2027                            | 4 700                               | 4 848                            | 0,05                      |
| 3,080 % éch. 24/09/2060                                                                        |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 17/07/2030                            | 1 000                               | 1 059                            | 0,01                      |
| GS Mortgage-Backed Securities Trust                                                            | 2 900                               | 3 324                            | 0,04                      | 8,125 % éch. 17/07/2035                            |                                     |                                  |                           |
| 3,133 % éch. 24/11/2067                                                                        |                                     |                                  |                           | Norinchukin Bank                                   | 3 100                               | 3 075                            | 0,03                      |
| Jeronimo Funding DAC                                                                           | 4 915                               | 5 647                            | 0,06                      | 5,356 % éch. 10/03/2036                            |                                     |                                  |                           |
| 3,415 % éch. 25/10/2064                                                                        |                                     |                                  |                           | SoftBank Group Corp.                               | € 2 750                             | 3 162                            | 0,03                      |
| Kinbane DAC                                                                                    | 2 272                               | 2 602                            | 0,03                      | 6,375 % éch. 10/07/2033                            | \$ 1 600                            | 1 605                            | 0,02                      |
| 3,379 % éch. 24/01/2063                                                                        |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 08/07/2029                            | 3 100                               | 3 186                            | 0,03                      |
| Lugo Funding DAC                                                                               | 4 369                               | 4 989                            | 0,05                      | 7,625 % éch. 22/10/2029                            | 2 700                               | 2 788                            | 0,03                      |
| 3,195 % éch. 26/05/2066                                                                        |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 22/10/2031                            |                                     |                                  |                           |
| Merrion Square Residential DAC                                                                 | 7 836                               | 8 989                            | 0,10                      | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.              | 2 500                               | 2 563                            | 0,03                      |
| 3,378 % éch. 24/03/2081                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,558 % éch. 09/07/2034                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     | 31 117                           | 0,33                      |                                                    | 55 070                              | 55 070                           | 0,58                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Avenir Issuer Ireland DAC                                                                      | \$ 8 936                            | 8 838                            | 0,09                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/10/2027                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Total Irlande                                                                                  |                                     | 472 560                          | 4,98                      |                                                    |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                  | ¥ 470 000                           | \$ 2 539                         | 0,03                      |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                                             |                                     |                                  |                           |
| Total Japon                                                         |                                     | 57 609                           | 0,61                      |
| <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSES À DES ACTIFS</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                                        | \$ 3 200                            | 3 204                            | 0,03                      |
| 4,656 % éch. 23/04/2035                                             |                                     |                                  |                           |
| Golub Capital Partners CLO Ltd.                                     | 6 700                               | 6 708                            | 0,07                      |
| 4,852 % éch. 25/07/2037                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     | 9 912                            | 0,10                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| AA Bond Co. Ltd.                                                    | £ 1 800                             | 2 501                            | 0,03                      |
| 7,375 % éch. 31/07/2050                                             |                                     |                                  |                           |
| GSG Bidco Ltd.                                                      | € 7 700                             | 8 739                            | 0,09                      |
| 5,375 % éch. 15/06/2036                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     | 11 240                           | 0,12                      |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                                  |                                     | 21 152                           | 0,22                      |
| <b>JORDANIE</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement jordanien                 | \$ 4 000                            | 4 182                            | 0,04                      |
| 7,500 % éch. 13/01/2029                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>KAZAKHSTAN</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| KazMunayGas National Co. JSC                                        | 3 100                               | 3 130                            | 0,03                      |
| 5,375 % éch. 24/04/2030                                             | 1 908                               | 1 821                            | 0,02                      |
| 5,750 % éch. 19/04/2047                                             | 1 659                               | 1 670                            | 0,02                      |
| 6,375 % éch. 24/10/2048                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     | 6 621                            | 0,07                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Baiterek National Investment Holding JSC                            | KZT 2 100 000                       | 4 463                            | 0,05                      |
| 16,950 % éch. 02/04/2029                                            | 2 500 000                           | 5 383                            | 0,06                      |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                                            |                                     |                                  |                           |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                                  | 2 723 500                           | 5 932                            | 0,06                      |
| 16,400 % éch. 16/10/2028                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     | 15 778                           | 0,17                      |
| Total Kazakhstan                                                    |                                     | 22 399                           | 0,24                      |
| <b>KENYA</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| République du Kenya                                                 | \$ 3 333                            | 3 347                            | 0,03                      |
| 9,086 % éch. 05/04/2028                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République du Kenya | 6 200                               | 6 260                            | 0,07                      |
| 7,875 % éch. 09/10/2033                                             | 5 800                               | 5 848                            | 0,06                      |
| 8,800 % éch. 09/10/2038                                             | 6 000                               | 6 387                            | 0,07                      |
| 9,500 % éch. 05/03/2036                                             | 9 700                               | 10 569                           | 0,11                      |
| 9,750 % éch. 16/02/2031                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     | 29 064                           | 0,31                      |
| Total Kenya                                                         |                                     | 32 411                           | 0,34                      |
| <b>KOWEÏT</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït                 |                                     |                                  |                           |
| 4,804 % éch. 20/04/2033                                             | 34 400                              | 34 342                           | 0,36                      |
| (j)                                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>LIBAN</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement libanais                  | 12 025                              | 2 973                            | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 27/01/2023 ^                                           | 12 225                              | 3 026                            | 0,04                      |
| 6,100 % éch. 04/10/2022 ^                                           | 12 025                              | 3 009                            | 0,03                      |
| 6,850 % éch. 23/03/2027 ^                                           |                                     |                                  |                           |
| Total Liban                                                         |                                     | 9 008                            | 0,10                      |

| DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| LIBERIA                       |                                     |                                  |                           | MEXIQUE                                            |                                     |                                  |                           | Davide Campari-Milano NV                                                                       |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                     |                                  |                           | ACTIONS ORDINAIRES                                 |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 17/06/2033                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.  |                                     |                                  |                           | Hipotecaria Su Casita S.A.                         |                                     |                                  |                           | € 3 400                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 30/09/2031       | \$                                  | 10 200                           | \$10 289                  | de C.V. (c)                                        | 28 925                              | \$0                              | 0,00                      | \$ 3 957                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  | 0,11                      |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,04                                                                                           |                                     |                                  |                           |
| LUXEMBOURG                    |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Douro Finance BV                                                                               |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS   |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 04/06/2031                                                                        |                                     |                                  |                           |
| First Mobility SARL           |                                     |                                  |                           |                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                                  |                           | 6 100                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,809 % éch. 14/10/2032       | €                                   | 2 581                            | 2 955                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | 6 162                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  | 0,03                      | Banco Actinver S.A. Institucion de Banca Multiple  |                                     |                                  |                           | 0,06                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 31/01/2041                            | \$                                  | 3 962                            | 4 027                     | ENEL Finance International NV                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | Banco Nacional de Mexico S.A.                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/06/2032                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,697 % éch.                                       |                                     |                                  |                           | Flora Food Management BV                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 07/08/2036 (i)/(j)                                 | 10 950                              | 10 798                           | 0,11                      | 6,875 % éch. 02/07/2029                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Adler Group S.A. (c)          |                                     | 598 038                          | 0                         | Petroleos Mexicanos                                | 4 100                               | 3 382                            | 0,04                      | € 10 275                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Corestate Capital             |                                     | 3 586 721                        | 0                         | 6,350 % éch. 12/02/2048                            |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 31/10/2030 (j)                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Holding S.A. (c)/(j)          |                                     | 443 430                          | 10 162                    | 6,625 % éch. 15/06/2038                            | 5 050                               | 4 700                            | 0,05                      | 3 800                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| DrillCo Holding Lux S.A. (j)  |                                     | 25                               | 1                         | 6,700 % éch. 16/02/2032 (k)                        | 19 787                              | 19 974                           | 0,21                      | 0,12                                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Foresea Holding S.A.          |                                     | 184 535                          | 2 791                     | 6,750 % éch. 21/09/2047                            | 79 025                              | 67 703                           | 0,71                      | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
| SES S.A. (c)                  |                                     |                                  | 12 954                    | 7,690 % éch. 23/01/2050                            | 13 775                              | 12 857                           | 0,14                      | ING Groep NV                                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     | 123 441                          | 1,30                      | 5,750 % éch. 16/11/2026                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | (g)/(i)                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | \$ 9 000                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain |                                     |                                  |                           | Magnum Icc Finance BV                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 3,771 % éch. 24/05/2061                            |                                     | 4 431                            | 0,05                      | 3,250 % éch. 26/11/2031                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 24/08/2034 (f)                        | MXN                                 | 317                              | 18                        | € 5 100                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 4,490 % éch. 25/05/2032                            | €                                   | 9 400                            | 10 935                    | 5 767                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 19/03/2034                            |                                     |                                  |                           | 0,06                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 22/03/2033                            | \$                                  | 9 700                            | 9 511                     | Sandoz Finance BV                                                                              |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 09/02/2034                            |                                     | 15 800                           | 15 567                    | 4,220 % éch. 17/04/2030                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 12/10/2110                            |                                     | 10 000                           | 8 188                     | 325                                                                                            |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 07/05/2036                            |                                     | 11 750                           | 11 740                    | 384                                                                                            |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 09/02/2038                            |                                     | 22 700                           | 22 297                    | 0,00                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,350 % éch. 09/02/2035                            |                                     | 15 300                           | 15 667                    | 0,03                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 29/01/2038                            |                                     | 28 859                           | 29 609                    | 2 300                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 13/05/2037                            |                                     | 8 400                            | 8 823                     | 2 770                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,03                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Universal Music Group NV                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 16/06/2030                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 1 500                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 1 727                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,02                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Veon Midco BV                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 01/06/2031                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | \$ 4 800                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 796                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,450 % éch. 01/06/2033                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 750                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | VZ Secured Financing BV                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/01/2032                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 2 250                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 1 971                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,02                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/01/2033                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 25 525                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 24 453                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,26                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Yinson Bergeia Production BV                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 8,498 % éch. 31/01/2045                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 5 526                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 5 907                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,06                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Yinson Boronia Production BV                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 8,947 % éch. 31/07/2042                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 16 976                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 18 684                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,20                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Ziggo BV                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/01/2030                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 5 814                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 5 461                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,06                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 124 908                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 1,32                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Veon Amsterdam                                                                                 |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,924 % éch. 25/03/2027                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 6 300                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 6 292                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,07                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Domi BV                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 2,892 % éch. 15/02/2057                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | € 24 412                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 27 899                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,29                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,081 % éch. 15/06/2056                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7 391                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 8 451                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,09                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | EMF-NL Prime BV                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,040 % éch. 17/04/2041                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 2                                                                                              |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 2                                                                                              |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Jubilee Place BV                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,127 % éch. 18/09/2062                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 302                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 924                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,207 % éch. 17/09/2060                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 11 633                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 13 331                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,14                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 54 607                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,57                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Total Pays-Bas                                                                                 |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 193 833                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 2,04                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>NIGERIA</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Dangote Fertiliser Ltd.                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 05/05/2031                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | \$ 4 450                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 479                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Bank of Industry Ltd.                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,895 % éch. 23/08/2027                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | € 13 438                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 15 330                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,16                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Nigeria                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 11,300 % éch. 19/12/2032                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | \$ 5 000                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 5 069                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 20 399                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,21                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement nigérian                                             |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch. 28/11/2047 (k)                                                                    |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 12 100                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 11 901                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,13                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 16/02/2032                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 16 300                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 17 030                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,18                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 9,130 % éch. 13/01/2046                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 300                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4 770                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,05                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 33 701                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,36                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Total Nigeria                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 58 579                                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,62                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>NORVÈGE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | PPI Public Property Invest AB                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 21/04/2033                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | € 3 000                                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3 385                                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 0,04                                                                                           |                                     |                                  |                           |



## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| TGS ASA                                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/01/2030                               | \$ 1 800                            | \$1 893                          | 0,02                      | 5,500 % éch. 18/03/2054                              | \$ 10 950                           | \$10 377                         | 0,11                      | Seagate Data Storage Technology Pte. Ltd.                                                      |                                     |                                  |                           |
| Total Norvège                                         |                                     | 5 278                            | 0,06                      |                                                      |                                     | 23 370                           | 0,25                      | 4,125 % éch. 15/01/2031                                                                        | \$ 5 318                            | \$5 062                          | 0,05                      |
| <b>OMAN</b>                                           |                                     |                                  |                           | Total Pologne                                        |                                     | 26 582                           | 0,28                      | 5,750 % éch. 01/12/2034                                                                        | 4 375                               | 4 450                            | 0,05                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | <b>PORTUGAL</b>                                      |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 01/12/2032                                                                        | 7 486                               | 8 259                            | 0,09                      |
| Obligation internationale du gouvernement omanais     |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                   |                                     |                                  |                           | Yinson Production Financial Services Pte. Ltd.                                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 17/01/2048                               | 21 300                              | 23 410                           | 0,25                      | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A.    |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 03/05/2029                                                                        | 8 150                               | 8 636                            | 0,09                      |
| <b>PAKISTAN</b>                                       |                                     |                                  |                           | 3,095 % éch. 25/02/2034                              | € 2 097                             | 2 407                            | 0,03                      | Total Singapour                                                                                |                                     | 26 407                           | 0,28                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                | 27 115                              | 0,29                             |                           |
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais |                                     |                                  |                           | Banco Espirito Santo S.A.                            |                                     |                                  |                           | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 05/12/2027                               | 6 900                               | 6 970                            | 0,08                      | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^                            | 200                                 | 54                               | 0,00                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| 6,975 % éch. 24/04/2029                               | 11 550                              | 11 588                           | 0,12                      | Total Portugal                                       |                                     | 2 461                            | 0,03                      | Sasol Financing USA LLC                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 08/04/2031                               | 1 200                               | 1 211                            | 0,01                      | <b>QATAR</b>                                         |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 03/05/2029                                                                        | 2 350                               | 2 462                            | 0,03                      |
| Total Pakistan                                        |                                     | 19 769                           | 0,21                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 10/04/2033                                                                        | 9 600                               | 9 944                            | 0,10                      |
| <b>PANAMA</b>                                         |                                     |                                  |                           | QatarEnergy                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                                | 12 406                              | 0,13                             |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 23/06/2029                              | \$ 6 625                            | 6 585                            | 0,07                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| Generadora de Gatun S.A.                              |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | Transnet SOC Ltd.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,874 % éch. 30/09/2044                               | 2 700                               | 2 791                            | 0,03                      | Obligation internationale du gouvernement qatari     |                                     |                                  |                           | 10,658 % éch. 02/03/2028                                                                       | ZAR 237 714                         | 14 492                           | 0,15                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                              | 18 100                              | 18 197                           | 0,19                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen    |                                     |                                  |                           | Total Qatar                                          |                                     | 24 782                           | 0,26                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain7                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,700 % éch. 26/01/2036                               | 10 600                              | 11 427                           | 0,12                      | <b>ROUMANIE</b>                                      |                                     |                                  |                           | 5,650 % éch. 27/09/2047                                                                        | \$ 13 700                           | 11 631                           | 0,12                      |
| Total Panama                                          |                                     | 14 218                           | 0,15                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/02/2031                                                                        | ZAR 14 300                          | 843                              | 0,01                      |
| <b>PARAGUAY</b>                                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain    |                                     |                                  |                           | 7,100 % éch. 19/11/2036                                                                        | \$ 7 600                            | 8 165                            | 0,09                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 14/04/2033                              | € 1 500                             | 1 411                            | 0,02                      | 7,950 % éch. 19/11/2054                                                                        | 2 700                               | 2 921                            | 0,03                      |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen  |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 30/05/2032                              | 4 500                               | 5 253                            | 0,06                      | 8,500 % éch. 31/01/2037                                                                        | ZAR 1 225 100                       | 74 463                           | 0,78                      |
| 6,000 % éch. 09/02/2036                               | 20 500                              | 21 488                           | 0,23                      | 5,375 % éch. 07/06/2033                              | 12 500                              | 14 439                           | 0,15                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                                                        | 760 200                             | 48 067                           | 0,51                      |
| <b>PÉROU</b>                                          |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 18/09/2028                              | 4 000                               | 4 754                            | 0,05                      | 9,000 % éch. 31/01/2040                                                                        | 43 500                              | 2 685                            | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 22/02/2036                              | 2 575                               | 2 968                            | 0,03                      | 10,500 % éch. 21/12/2026                                                                       | 16 000                              | 991                              | 0,01                      |
| Banco Interacional del Peru SAA Interbank             |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 18/09/2033                              | 21 975                              | 26 792                           | 0,28                      | Total Afrique du Sud                                                                           |                                     | 149 766                          | 1,58                      |
| 4,800 % éch. 15/07/2031                               | 9 600                               | 9 436                            | 0,10                      | Total Roumanie                                       |                                     | 55 617                           | 0,59                      |                                                                                                | 176 664                             | 1,86                             |                           |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.          |                                     |                                  |                           | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                               |                                     |                                  |                           | <b>ESPAGNE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                               | PEN 12 500                          | 3 927                            | 0,04                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                              | 83 319                              | 26 880                           | 0,28                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien   |                                     |                                  |                           | Auto ABS Spanish Loans                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Niagara Energy SAC                                    |                                     |                                  |                           | 3,450 % éch. 02/02/2061                              | \$ 42 000                           | 26 673                           | 0,28                      | 3,059 % éch. 28/09/2038                                                                        | € 12 839                            | 14 713                           | 0,15                      |
| Petroleos del Peru S.A.                               |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 12/01/2029                              | 14 800                              | 14 589                           | 0,15                      | BBVA Consumer Auto                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 19/06/2047                               | 22 150                              | 15 852                           | 0,17                      | 4,875 % éch. 18/07/2033                              | 21 000                              | 20 896                           | 0,22                      | 3,239 % éch. 19/05/2042                                                                        | 889                                 | 1 016                            | 0,01                      |
|                                                       |                                     | 60 960                           | 0,64                      | 5,000 % éch. 18/01/2053                              | 20 000                              | 17 277                           | 0,18                      | BBVA Consumer FTA                                                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 13/01/2031                              | 11 000                              | 11 233                           | 0,12                      | 2,849 % éch. 20/05/2039                                                                        | 1 313                               | 1 500                            | 0,02                      |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien    |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 16/01/2054 (k)                          | 8 500                               | 8 206                            | 0,09                      | FTA Santander Consumer Spain Auto                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 12/08/2040                               | PEN 2 100                           | 538                              | 0,01                      | Total Arabie saoudite                                |                                     | 98 874                           | 1,04                      | 2,980 % éch. 17/09/2043                                                                        | 2 286                               | 2 612                            | 0,03                      |
| 5,375 % éch. 08/02/2035                               | \$ 8 400                            | 8 488                            | 0,09                      | <b>SÉNÉGAL</b>                                       |                                     |                                  |                           | 3,180 % éch. 17/09/2043                                                                        | 2 637                               | 3 001                            | 0,03                      |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                               | PEN 16 500                          | 4 729                            | 0,05                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | FTA Santander Consumo                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 30/03/2036                               | \$ 17 600                           | 17 796                           | 0,19                      | Obligation internationale du gouvernement sénégalais |                                     |                                  |                           | 3,538 % éch. 20/07/2038                                                                        | 568                                 | 651                              | 0,01                      |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                               | PEN 27 100                          | 8 608                            | 0,09                      | 4,750 % éch. 13/03/2028                              | € 2 067                             | 1 327                            | 0,02                      | Sabadell Consumo FT                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                               | 28 200                              | 8 704                            | 0,09                      | 5,375 % éch. 08/06/2037                              | 7 800                               | 4 758                            | 0,05                      | 3,085 % éch. 22/10/2035                                                                        | 1 277                               | 1 463                            | 0,01                      |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                               | 9 600                               | 3 203                            | 0,03                      | 6,250 % éch. 23/05/2033                              | \$ 700                              | 374                              | 0,00                      |                                                                                                | 24 956                              | 0,26                             |                           |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                               | 77 650                              | 25 512                           | 0,27                      | 6,750 % éch. 13/03/2048                              | 2 100                               | 1 095                            | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 21/11/2033                               | \$ 15 000                           | 18 340                           | 0,19                      | 7,750 % éch. 10/06/2031 (k)                          | 11 550                              | 6 234                            | 0,07                      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     | 95 918                           | 1,01                      | Total Sénégal                                        |                                     | 13 788                           | 0,15                      | 4,968 % éch. 08/05/2031                                                                        | \$ 6 375                            | 6 367                            | 0,07                      |
| Total Pérou                                           |                                     | 156 878                          | 1,65                      | <b>SERBIE</b>                                        |                                     |                                  |                           | Banco Santander S.A.                                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>PHILIPPINES</b>                                    |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 5,565 % éch. 17/01/2030                                                                        | 3 600                               | 3 691                            | 0,04                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | Telecommunications Co. Telekom Srbija AD Belgrade    |                                     |                                  |                           | 6,033 % éch. 17/01/2035                                                                        | 2 400                               | 2 519                            | 0,03                      |
| Obligation internationale du gouvernement philippin   |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 18/05/2031                              | 3 000                               | 2 994                            | 0,03                      | Cellnex Finance Co. S.A.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 17/07/2033                               | 2 200                               | 2 203                            | 0,02                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 19/01/2031                                                                        | € 1 500                             | 1 684                            | 0,02                      |
| <b>POLOGNE</b>                                        |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement serbe      |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 19/01/2036                                                                        | 1 400                               | 1 584                            | 0,02                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           | 1,650 % éch. 03/03/2033                              | € 8 900                             | 8 616                            | 0,09                      | EnfraGen Energia Sur S.A.U.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| ORLEN S.A.                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 12/06/2034                              | \$ 4 450                            | 4 565                            | 0,05                      | 8,499 % éch. 30/06/2032                                                                        | \$ 2 300                            | 2 403                            | 0,02                      |
| 6,000 % éch. 30/01/2035                               | 3 100                               | 3 212                            | 0,03                      | 6,500 % éch. 26/09/2033 (k)                          | 9 400                               | 9 939                            | 0,11                      | Molins Finance S.A.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 23 120                           | 0,25                      | 5,500 % éch. 15/06/2033                                                                        | € 1 800                             | 2 153                            | 0,02                      |
| Bank Gospodarstwa Krajowego                           |                                     |                                  |                           | Total Serbie                                         |                                     | 26 114                           | 0,28                      | Telefonica Emisiones S.A.                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 13/03/2032                               | € 2 000                             | 2 366                            | 0,03                      | <b>SINGAPOUR</b>                                     |                                     |                                  |                           | 4,353 % éch. 27/11/2034                                                                        | 2 400                               | 2 814                            | 0,03                      |
| 4,375 % éch. 13/03/2039                               | 5 000                               | 5 843                            | 0,06                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                | 23 215                              | 0,25                             |                           |
| 5,750 % éch. 09/07/2034                               | \$ 4 600                            | 4 784                            | 0,05                      | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.             |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,051 % éch. 11/04/2043                              | 708                                 | 708                              | 0,01                      | Subcalidora                                                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 8,041 % éch. 14/08/2029                                                                        | 11 000                              | 12 509                           | 0,13                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Santander Residential FT                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 18/10/2068                                                                        | 17 021                              | 19 510                           | 0,21                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Total Espagne                                                                                  |                                     | 80 190                           | 0,85                      |

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)            | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                                    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |         |         |      |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------|---------|------|
| SRI LANKA                                             |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/02/2036                                           | \$                                             | 17 427                           | \$11 955                  | 0,13                                 | Santander UK Group Holdings PLC                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                                |                                  |                           | 4,858 % éch. 11/09/2030              | \$                                                                                     | 2 000                            | \$1 999                   | 0,02    |         |      |
| Obligation internationale du gouvernement sri-lankais |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                                |                                  |                           | 5,694 % éch. 15/04/2031              |                                                                                        | 6 100                            | 6 259                     | 0,07    |         |      |
| 3,100 % éch. 15/01/2030                               | \$                                  | 2 693                            | \$2 752                   | 0,03                                                              | Total Ukraine                                  |                                  |                           |                                      | Smiths Group PLC                                                                       |                                  |                           |         |         |      |
| 3,350 % éch. 15/03/2033                               |                                     | 5 283                            | 5 090                     | 0,05                                                              |                                                |                                  |                           |                                      | 3,625 % éch. 13/11/2033                                                                | €                                | 2 100                     | 2 369   | 0,02    |      |
| 3,600 % éch. 15/06/2035                               |                                     | 3 567                            | 2 985                     | 0,03                                                              | ÉMIRATS ARABES UNIS                            |                                  |                           |                                      | South West Water Finance PLC                                                           |                                  |                           |         |         |      |
| 3,600 % éch. 15/05/2036                               |                                     | 2 476                            | 2 492                     | 0,03                                                              | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                  |                                  |                           |                                      | 5,250 % éch. 15/09/2031                                                                | £                                | 1 700                     | 2 236   | 0,02    |      |
| 3,600 % éch. 15/02/2038                               |                                     | 4 954                            | 5 013                     | 0,05                                                              | Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC       |                                  |                           |                                      | SW Finance PLC                                                                         |                                  |                           |         |         |      |
| 4,000 % éch. 15/04/2028                               |                                     | 1 873                            | 1 812                     | 0,02                                                              | 4,375 % éch. 02/10/2031                        | 14 600                           | 14 280                    | 0,15                                 | 5,750 % éch. 19/11/2030                                                                |                                  | 4 600                     | 5 957   | 0,06    |      |
| Total Sri Lanka                                       |                                     | 20 144                           | 0,21                      | 5,375 % éch. 08/05/2029                                           | 5 800                                          | 5 904                            | 0,06                      | 6,125 % éch. 19/11/2033              |                                                                                        | 4 700                            | 5 987                     | 0,06    |         |      |
| SUPRANATIONALES                                       |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 08/05/2034                                           | 2 500                                          | 2 561                            | 0,03                      | 6,875 % éch. 07/08/2032              |                                                                                        | 2 500                            | 3 343                     | 0,04    |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | Dhafrah P2 Energy Co. LLC                                         |                                                |                                  |                           | 6,875 % éch. 14/11/2034              |                                                                                        | 1 400                            | 1 860                     | 0,02    |         |      |
| Banque Ouest Africaine de Développement               |                                     |                                  |                           | 5,794 % éch. 30/06/2053                                           | 7 200                                          | 7 139                            | 0,08                      | Tesco Property Finance PLC           |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| 6,250 % éch. 14/10/2040                               | €                                   | 6 700                            | 7 344                     | 0,08                                                              | Emirates NBD Bank PJSC                         |                                  |                           | 5,744 % éch. 13/04/2040              |                                                                                        | 1 813                            | 2 407                     | 0,03    |         |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 29/06/2031                                           | 12 600                                         | 12 600                           | 0,13                      | Thames Water Super Senior Issuer PLC |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| Union européenne                                      |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                                         |                                                |                                  |                           | 9,750 % éch. 10/10/2027              |                                                                                        | 2 295                            | 3 235                     | 0,03    |         |      |
| 3,375 % éch. 04/10/2039                               |                                     | 18 290                           | 20 513                    | 0,21                                                              | 4,789 % éch. 03/06/2031                        | 13 700                           | 13 720                    | 0,14                                 | Vedanta Resources Finance PLC                                                          |                                  |                           |         |         |      |
| Total Supranationales                                 |                                     |                                  | 27 857                    | 0,29                                                              |                                                |                                  |                           | 9,125 % éch. 15/10/2032              | \$                                                                                     | 7 100                            | 7 295                     | 0,08    |         |      |
| SUEDE                                                 |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                             |                                                |                                  |                           | Virgin Media Secured Finance PLC     |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                                |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/08/2030              | £                                                                                      | 27 700                           | 31 710                    | 0,33    |         |      |
| Epiroc AB                                             |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 35 200                                         | 35 085                           | 0,37                      | 4,250 % éch. 15/01/2030              |                                                                                        | 4 550                            | 5 331                     | 0,06    |         |      |
| 3,625 % éch. 28/02/2031                               |                                     | 1 325                            | 1 536                     | 0,02                                                              | Total Émirats arabes unis                      |                                  |                           |                                      | Vmed O2 UK Financing PLC                                                               |                                  |                           |         |         |      |
| PPI Public Property Invest AB                         |                                     |                                  |                           | ROYAUME-UNI                                                       |                                                |                                  |                           | 4,000 % éch. 31/01/2029              |                                                                                        | 14 275                           | 17 930                    | 0,19    |         |      |
| 3,250 % éch. 21/04/2029                               |                                     | 2 900                            | 3 300                     | 0,03                                                              | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                     |                                  |                           |                                      | 4,500 % éch. 15/07/2031                                                                |                                  | 7 200                     | 7 887   | 0,08    |      |
| Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB             |                                     |                                  |                           | Curzon Mortgages PLC                                              |                                                |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/04/2032              | €                                                                                      | 8 400                            | 8 465                     | 0,09    |         |      |
| 2,375 % éch. 04/08/2026                               |                                     | 2 200                            | 2 514                     | 0,03                                                              | 4,592 % éch. 28/07/2049                        | £                                | 3 200                     | 4 249                                | 0,04                                                                                   | 6,750 % éch. 15/01/2033 (k)      | \$                        | 8 500   | 7 205   | 0,08 |
| Total Suède                                           |                                     |                                  | 7 350                     | 0,08                                                              | Morglas ABS PLC                                |                                  |                           |                                      | Yorkshire Water Finance PLC                                                            |                                  |                           |         |         |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,535 % éch. 15/09/2040                                           | 13 540                                         | 17 988                           | 0,19                      | 2,750 % éch. 18/04/2041              | £                                                                                      | 2 400                            | 2 044                     | 0,02    |         |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                                |                                  |                           |                                      |                                                                                        |                                  |                           | 258 688 | 2,73    |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                                |                                  |                           |                                      |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| SUISSE                                                |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                                |                                  |                           | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS      |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | Allwyn Entertainment Financing UK PLC                             |                                                |                                  |                           | INEOS Finance PLC                    |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| UBS Group AG                                          |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 30/04/2029                                           | \$                                             | 6 029                            | 6 198                     | 0,07                                 | TBD % éch. 08/11/2028                                                                  | €                                | 7 075                     | 8 055   | 0,09    |      |
| 3,869 % éch. 12/01/2029                               | \$                                  | 700                              | 692                       | 0,01                                                              | Amber Finco PLC                                |                                  |                           |                                      | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                  |                           |         |         |      |
| 4,194 % éch. 01/04/2031                               |                                     | 1 400                            | 1 367                     | 0,02                                                              | 6,625 % éch. 15/07/2029                        | €                                | 3 100                     | 3 678                                | 0,04                                                                                   | Edenbrook Mortgage Funding PLC   |                           |         |         |      |
| 4,703 % éch. 05/08/2027                               |                                     | 4 200                            | 4 200                     | 0,04                                                              | Anglian Water Services Financing PLC           |                                  |                           |                                      | 5,096 % éch. 22/03/2057                                                                | £                                | 2 248                     | 3 001   | 0,03    |      |
| Total Suisse                                          |                                     |                                  | 6 259                     | 0,07                                                              | 4,250 % éch. 23/06/2036                        |                                  | 8 950                     | 10 246                               | 0,11                                                                                   | Elstree PLC                      |                           |         |         |      |
| TURQUIE                                               |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 10/11/2033                                           | £                                              | 5 700                            | 7 378                     | 0,08                                 | 4,454 % éch. 21/01/2065                                                                |                                  | 3 268                     | 4 334   | 0,05    |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 20/06/2031                                           |                                                | 5 700                            | 7 695                     | 0,08                                 | Harbour PLC                                                                            |                                  |                           |         |         |      |
| QNB Bank A/S                                          |                                     |                                  |                           | Azule Energy Finance PLC                                          |                                                |                                  |                           | 4,797 % éch. 28/10/2054              |                                                                                        | 11 636                           | 15 492                    | 0,16    |         |      |
| 5,875 % éch. 11/02/2031                               |                                     | 8 800                            | 8 565                     | 0,09                                                              | 8,625 % éch. 22/01/2033                        | \$                               | 10 000                    | 10 018                               | 0,11                                                                                   | Harvest Funding PLC              |                           |         |         |      |
| Türkiye Varilik Fonu Yonetimi A/S                     |                                     |                                  |                           | Barclays PLC                                                      |                                                |                                  |                           | 4,643 % éch. 15/11/2069              |                                                                                        | 6 100                            | 8 098                     | 0,08    |         |      |
| 8,250 % éch. 14/02/2029                               |                                     | 3 500                            | 3 656                     | 0,04                                                              | 7,437 % éch. 02/11/2033                        |                                  | 8 500                     | 9 477                                | 0,10                                                                                   | 5,043 % éch. 15/11/2069          |                           | 2 014   | 2 665   | 0,03 |
|                                                       |                                     |                                  | 12 221                    | 0,13                                                              | Burberry Group PLC                             |                                  |                           |                                      | 5,443 % éch. 15/11/2069                                                                |                                  | 6 241                     | 8 283   | 0,09    |      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                       |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 20/06/2030                                           | £                                              | 5 050                            | 6 768                     | 0,07                                 | Hops Hill PLC                                                                          |                                  |                           |         |         |      |
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.                       |                                     |                                  |                           | Greene King Finance PLC                                           |                                                |                                  |                           | 4,614 % éch. 21/04/2056              |                                                                                        | 4 457                            | 5 920                     | 0,06    |         |      |
| 5,401 % éch. 15/12/2028                               | €                                   | 3 400                            | 3 902                     | 0,04                                                              | 5,106 % éch. 15/03/2034                        |                                  | 273                       | 358                                  | 0,00                                                                                   | 5,034 % éch. 21/04/2056          |                           | 1 200   | 1 603   | 0,02 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                                                 |                                                |                                  |                           | London Wall Mortgage Capital PLC     |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| Obligation internationale du gouvernement turc        |                                     |                                  |                           | 5,887 % éch. 14/08/2027                                           | \$                                             | 2 400                            | 2 403                     | 0,03                                 | 4,738 % éch. 15/05/2057                                                                |                                  | 1 108                     | 1 474   | 0,02    |      |
| 4,875 % éch. 16/04/2043                               | \$                                  | 10 542                           | 8 022                     | 0,09                                                              | ICBC Standard Bank PLC                         |                                  |                           |                                      | Pierpont BTL PLC                                                                       |                                  |                           |         |         |      |
| 5,750 % éch. 11/05/2047 (k)                           |                                     | 58 300                           | 47 319                    | 0,50                                                              | 20,000 % éch. 13/12/2029                       | UZS                              | 95 434 000                | 7 941                                | 0,08                                                                                   | 4,586 % éch. 21/09/2061          |                           | 944     | 1 254   | 0,01 |
| 5,875 % éch. 21/05/2030                               | €                                   | 5 000                            | 6 059                     | 0,06                                                              | Informa PLC                                    |                                  |                           |                                      | Polaris PLC                                                                            |                                  |                           |         |         |      |
| 36,000 % éch. 12/08/2026                              | TRY                                 | 424 200                          | 9 077                     | 0,10                                                              | 1,250 % éch. 22/04/2028                        | €                                | 5 700                     | 6 312                                | 0,07                                                                                   | 4,555 % éch. 26/02/2068          |                           | 20 281  | 26 919  | 0,28 |
| 40,305 % éch. 06/09/2028                              |                                     | 327 000                          | 7 046                     | 0,07                                                              | 3,250 % éch. 23/10/2030                        |                                  | 700                       | 796                                  | 0,01                                                                                   | Stratton Mortgage Funding PLC    |                           |         |         |      |
|                                                       |                                     |                                  | 77 523                    | 0,82                                                              | 3,750 % éch. 29/04/2032                        |                                  | 7 900                     | 9 051                                | 0,10                                                                                   | 4,721 % éch. 25/06/2049          |                           | 11 957  | 15 877  | 0,17 |
| Total Turquie                                         |                                     |                                  | 93 646                    | 0,99                                                              | John Lewis PLC                                 |                                  |                           |                                      | Towd Point Mortgage Funding PLC                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| UKRAINE                                               |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 18/12/2034                                           | £                                              | 3 710                            | 4 175                     | 0,04                                 | 4,672 % éch. 20/07/2053                                                                |                                  | 10 502                    | 13 947  | 0,15    |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           | Mitchells & Butlers Finance PLC                                   |                                                |                                  |                           | Tower Bridge Funding PLC             |                                                                                        |                                  |                           |         |         |      |
| NPC Ukrenergo                                         |                                     |                                  |                           | 4,316 % éch. 15/12/2030                                           |                                                | 1 658                            | 2 159                     | 0,02                                 | 4,627 % éch. 20/05/2066                                                                |                                  | 399                       | 529     | 0,01    |      |
| 6,875 % éch. 09/11/2028                               | \$                                  | 1 000                            | 974                       | 0,01                                                              | 4,350 % éch. 15/12/2030                        | \$                               | 669                       | 646                                  | 0,01                                                                                   | Trinity Square PLC               |                           |         |         |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                  |                           | 6,013 % éch. 15/12/2030                                           | £                                              | 184                              | 245                       | 0,00                                 | 4,647 % éch. 15/07/2059                                                                |                                  | 3 250                     | 4 317   | 0,04    |      |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien   |                                     |                                  |                           | 6,469 % éch. 15/09/2032                                           |                                                | 1 700                            | 2 275                     | 0,02                                 | 5,047 % éch. 15/07/2059                                                                |                                  | 1 000                     | 1 329   | 0,01    |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2030                               |                                     | 2 841                            | 2 046                     | 0,02                                                              | National Grid PLC                              |                                  |                           |                                      |                                                                                        |                                  |                           | 115 042 | 1,21    |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2034                               |                                     | 8 816                            | 5 004                     | 0,05                                                              | 5,418 % éch. 11/01/2034                        | \$                               | 5 000                     | 5 072                                | 0,05                                                                                   | Total Royaume-Uni                |                           |         | 404 022 | 4,26 |
| 0,000 % éch. 01/02/2035                               |                                     | 2 383                            | 1 438                     | 0,02                                                              | Nationwide Building Society                    |                                  |                           |                                      | ÉTATS-UNIS                                                                             |                                  |                           |         |         |      |
| 4,000 % éch. 01/02/2032                               |                                     | 1 316                            | 1 091                     | 0,01                                                              | 5,750 % éch. 20/06/2027 (g)(i)                 | £                                | 4 300                     | 5 714                                | 0,06                                                                                   | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS       |                           |         |         |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2034                               |                                     | 14 678                           | 10 348                    | 0,11                                                              | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                                  |                           |                                      | Accredited Mortgage Loan Trust                                                         |                                  |                           |         |         |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2035                               |                                     | 17 564                           | 12 207                    | 0,13                                                              | 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                    | \$                               | 20 529                    | 16 722                               | 0,18                                                                                   | 4,023 % éch. 25/09/2036          | \$                        | 73      | 73      | 0,00 |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Pinnacle Bidco PLC                                                |                                                |                                  |                           |                                      | 4,708 % éch. 25/09/2035                                                                |                                  | 7 750                     | 6 904   | 0,07    |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 11/10/2028                                           | €                                              | 6 800                            | 8 057                     | 0,08                                 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                            |                                  |                           |         |         |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Royalty Pharma PLC                                                |                                                |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/04/2036              |                                                                                        | 125                              | 123                       | 0,00    |         |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 02/09/2040                                           | \$                                             | 2 300                            | 1 785                     | 0,02                                 | 4,063 % éch. 25/07/2036                                                                |                                  | 10 840                    | 2 608   | 0,03    |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                                |                                  |                           | 4,073 % éch. 25/08/2036              |                                                                                        | 230                              | 224                       | 0,00    |         |      |
|                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                                |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/08/2036              |                                                                                        | 2 233                            | 506                       | 0,01    |         |      |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,123 % éch. 25/02/2037                                                    | \$ 2 652                            | \$ 1 088                         | 0,01                      | EMC Mortgage Loan Trust                      |                                     |                                  |                           | 3,893 % éch. 25/01/2037                                               | \$ 783                              | \$ 358                           | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/02/2037                                                    | 2 707                               | 1 146                            | 0,01                      | 4,863 % éch. 25/11/2041                      | \$ 3                                | \$ 3                             | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/10/2036                                               | 1 735                               | 751                              | 0,01                      |
| 4,423 % éch. 25/11/2035                                                    | 24                                  | 28                               | 0,00                      | First Franklin Mortgage Loan Trust           |                                     |                                  |                           | 3,903 % éch. 25/11/2036                                               | 167                                 | 79                               | 0,00                      |
| 4,558 % éch. 25/01/2035                                                    | 451                                 | 439                              | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/04/2036                      | 65                                  | 64                               | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/05/2037                                               | 2 705                               | 2 068                            | 0,02                      |
| 4,663 % éch. 25/12/2034                                                    | 761                                 | 699                              | 0,01                      | 4,243 % éch. 25/04/2036                      | 400                                 | 372                              | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/10/2036                                               | 153                                 | 79                               | 0,00                      |
| 4,693 % éch. 25/02/2036                                                    | 45                                  | 42                               | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/08/2036                      | 99                                  | 95                               | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/11/2036                                               | 2 529                               | 1 409                            | 0,02                      |
| 4,738 % éch. 25/06/2034                                                    | 319                                 | 305                              | 0,00                      | 4,708 % éch. 25/03/2035                      | 10                                  | 12                               | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/09/2036                                               | 3                                   | 1                                | 0,00                      |
| ACREC LLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,963 % éch. 25/01/2035                      | 22                                  | 23                               | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/11/2036                                               | 208                                 | 99                               | 0,00                      |
| 4,947 % éch. 18/08/2042                                                    | 1 800                               | 1 801                            | 0,02                      | 5,188 % éch. 25/10/2034                      | 108                                 | 109                              | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/03/2037                                               | 977                                 | 393                              | 0,01                      |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates     |                                     |                                  |                           | 5,638 % éch. 25/07/2034                      | 232                                 | 234                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/09/2036                                               | 1 480                               | 616                              | 0,01                      |
| 4,408 % éch. 25/12/2035                                                    | 2 495                               | 2 377                            | 0,03                      | First NLC Trust                              |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/03/2036                                               | 75                                  | 63                               | 0,00                      |
| 4,763 % éch. 25/03/2035                                                    | 94                                  | 90                               | 0,00                      | 2,672 % éch. 25/05/2035                      | 143                                 | 128                              | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/12/2035                                               | 43                                  | 42                               | 0,00                      |
| Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust                      |                                     |                                  |                           | 4,468 % éch. 25/12/2034                                               | 64                                  | 64                               | 0,00                      |
| 4,768 % éch. 25/07/2035                                                    | 3 500                               | 3 174                            | 0,03                      | 4,103 % éch. 25/02/2036                      | 637                                 | 623                              | 0,01                      | 4,468 % éch. 25/01/2035                                               | 1 380                               | 1 374                            | 0,02                      |
| 4,798 % éch. 25/01/2036                                                    | 7 300                               | 6 659                            | 0,07                      | 4,103 % éch. 25/02/2037                      | 994                                 | 300                              | 0,00                      | 4,558 % éch. 25/03/2034                                               | 364                                 | 390                              | 0,00                      |
| 4,813 % éch. 25/11/2034                                                    | 102                                 | 102                              | 0,00                      | Greystone CRE Notes LLC                      |                                     |                                  |                           | 4,618 % éch. 25/03/2034                                               | 144                                 | 149                              | 0,00                      |
| 4,873 % éch. 25/03/2035                                                    | 78                                  | 77                               | 0,00                      | 5,106 % éch. 15/01/2043                      | 17 000                              | 17 043                           | 0,18                      | 4,633 % éch. 25/09/2035                                               | 3 299                               | 2 794                            | 0,03                      |
| Amortizing Residential Collateral Trust                                    |                                     |                                  |                           | GSA Home Equity Trust                        |                                     |                                  |                           | 5,013 % éch. 25/07/2037                                               | 391                                 | 352                              | 0,00                      |
| 4,763 % éch. 25/10/2034                                                    | 58                                  | 58                               | 0,00                      | 3,883 % éch. 25/11/2036                      | 386                                 | 88                               | 0,00                      | 7,563 % éch. 25/02/2047                                               | 500                                 | 410                              | 0,01                      |
| Apollo Aviation Securitization Equity Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/04/2047                      | 38                                  | 36                               | 0,00                      | Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 5,522 % éch. 16/02/2050                                                    | 7 692                               | 7 628                            | 0,08                      | GSAMP Trust                                  |                                     |                                  |                           | 5,113 % éch. 25/02/2033                                               | 94                                  | 104                              | 0,00                      |
| Argent Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 3,485 % éch. 25/11/2034                      | 183                                 | 178                              | 0,00                      | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,303 % éch. 25/05/2036                                                    | 743                                 | 175                              | 0,00                      | 3,853 % éch. 25/01/2037                      | 230                                 | 142                              | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/12/2036                                               | 1 259                               | 595                              | 0,01                      |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                                    |                                     |                                  |                           | 3,863 % éch. 25/12/2046                      | 205                                 | 101                              | 0,00                      | 3,993 % éch. 25/04/2037                                               | 2 061                               | 1 049                            | 0,01                      |
| 3,983 % éch. 25/01/2037                                                    | 151                                 | 84                               | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/12/2036                      | 5 007                               | 2 664                            | 0,03                      | 4,083 % éch. 25/04/2036                                               | 56                                  | 38                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/01/2037                                                    | 510                                 | 283                              | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/04/2036                      | 2 428                               | 1 592                            | 0,02                      | 4,113 % éch. 25/04/2037                                               | 14 073                              | 7 162                            | 0,08                      |
| 4,203 % éch. 25/01/2037                                                    | 174                                 | 97                               | 0,00                      | Home Equity Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/03/2034                                                    | 188                                 | 182                              | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/04/2037                      | 2 000                               | 1 785                            | 0,02                      | 5,395 % éch. 25/11/2036                                               | 205                                 | 79                               | 0,00                      |
| 5,013 % éch. 25/06/2037                                                    | 9 895                               | 6 992                            | 0,07                      | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/02/2037                                               | 47                                  | 26                               | 0,00                      |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                 |                                     |                                  |                           | 3,903 % éch. 25/11/2036                      | 207                                 | 191                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                               | 9 115                               | 3 014                            | 0,03                      |
| 4,716 % éch. 25/11/2035                                                    | 23                                  | 24                               | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/04/2037                      | 658                                 | 446                              | 0,01                      | New Century Home Equity Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,768 % éch. 25/06/2035                                                    | 82                                  | 81                               | 0,00                      | HSI Asset Securitization Corp. Trust         |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/05/2036                                               | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 5,013 % éch. 25/08/2037                                                    | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/12/2036                      | 457                                 | 116                              | 0,00                      | 4,483 % éch. 25/03/2035                                               | 75                                  | 76                               | 0,00                      |
| Carrington Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/12/2036                      | 9 096                               | 3 455                            | 0,04                      | NovaStar Mortgage Funding Trust                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,923 % éch. 25/10/2036                                                    | 586                                 | 500                              | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/07/2036                      | 2 284                               | 977                              | 0,01                      | 3,963 % éch. 25/01/2037                                               | 932                                 | 300                              | 0,00                      |
| 3,983 % éch. 25/01/2037                                                    | 1 200                               | 947                              | 0,01                      | 4,323 % éch. 25/01/2037                      | 2 594                               | 1 793                            | 0,02                      | 3,963 % éch. 25/03/2037                                               | 772                                 | 237                              | 0,00                      |
| 4,013 % éch. 25/10/2036                                                    | 586                                 | 500                              | 0,01                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust          |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/03/2037                                               | 967                                 | 296                              | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/02/2037                                                    | 1 544                               | 1 483                            | 0,02                      | 4,023 % éch. 25/03/2037                      | 48                                  | 48                               | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/01/2037                                               | 1 111                               | 358                              | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/06/2036                                                    | 1 258                               | 1 231                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                      | 4 349                               | 4 233                            | 0,05                      | 5,638 % éch. 25/03/2035                                               | 189                                 | 188                              | 0,00                      |
| Castlelake Aircraft Structured Trust                                       |                                     |                                  |                           | 4,071 % éch. 25/01/2037                      | 419                                 | 202                              | 0,00                      | Option One Mortgage Loan Trust                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,073 % éch. 15/03/2051                                                    | 22 522                              | 22 165                           | 0,23                      | 4,168 % éch. 25/07/2036                      | 76                                  | 76                               | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/04/2037                                               | 944                                 | 461                              | 0,01                      |
| 5,087 % éch. 15/11/2050                                                    | 19 080                              | 18 836                           | 0,20                      | Lehman ABS Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/07/2037                                               | 1 882                               | 1 271                            | 0,01                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                        |                                     |                                  |                           | 3,853 % éch. 25/06/2037                      | 213                                 | 139                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/07/2036                                               | 11 514                              | 6 835                            | 0,07                      |
| 3,963 % éch. 25/05/2037                                                    | 685                                 | 466                              | 0,01                      | 3,963 % éch. 25/06/2037                      | 109                                 | 72                               | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/01/2037                                               | 128                                 | 74                               | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/03/2037                                                    | 728                                 | 666                              | 0,01                      | Long Beach Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/05/2037                                               | 110                                 | 59                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/09/2036                                                    | 495                                 | 375                              | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/09/2036                      | 13 010                              | 3 105                            | 0,03                      | 4,303 % éch. 25/01/2036                                               | 305                                 | 290                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/01/2037                                                    | 642                                 | 214                              | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/05/2046                      | 2 299                               | 673                              | 0,01                      | 4,333 % éch. 25/01/2036                                               | 7 092                               | 5 723                            | 0,06                      |
| 4,163 % éch. 25/11/2046                                                    | 255                                 | 252                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/02/2036                      | 10 089                              | 9 064                            | 0,10                      | 4,528 % éch. 25/08/2035                                               | 165                                 | 162                              | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/12/2036                                                    | 764                                 | 760                              | 0,01                      | 4,813 % éch. 25/06/2035                      | 286                                 | 280                              | 0,00                      | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 5,038 % éch. 25/02/2035                      | 1 058                               | 1 043                            | 0,01                      | 4,453 % éch. 25/11/2035                                               | 224                                 | 217                              | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/06/2037                                                    | 470                                 | 460                              | 0,01                      | LRCS LLC                                     |                                     |                                  |                           | Owinit Mortgage Loan Trust                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,203 % éch. 25/09/2037                                                    | 41                                  | 45                               | 0,00                      | 5,139 % éch. 19/08/2043                      | 4 000                               | 4 001                            | 0,04                      | 4,303 % éch. 25/03/2037                                               | 604                                 | 587                              | 0,01                      |
| 4,243 % éch. 25/02/2037                                                    | 2 568                               | 2 480                            | 0,03                      | Lyra Music Assets Delaware LP                |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/10/2036                                               | 92                                  | 91                               | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/01/2046                                                    | 4 874                               | 4 643                            | 0,05                      | MAST Ltd.                                    |                                     |                                  |                           | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates    |                                     |                                  |                           |
| 4,288 % éch. 25/08/2036                                                    | 2 356                               | 2 319                            | 0,03                      | 5,134 % éch. 15/02/2051                      | 8 395                               | 8 239                            | 0,09                      | 4,498 % éch. 25/08/2035                                               | 130                                 | 130                              | 0,00                      |
| 4,323 % éch. 25/04/2034                                                    | 16                                  | 15                               | 0,00                      | MASTR Asset-Backed Securities Trust          |                                     |                                  |                           | 4,498 % éch. 25/09/2035                                               | 1 804                               | 1 784                            | 0,02                      |
| 4,357 % éch. 25/07/2036                                                    | 1 066                               | 1 012                            | 0,01                      | 3,963 % éch. 25/08/2036                      | 4 534                               | 1 256                            | 0,01                      | 4,588 % éch. 25/07/2035                                               | 1 531                               | 1 479                            | 0,02                      |
| 4,357 % éch. 25/07/2036                                                    | 15                                  | 15                               | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/08/2036                      | 1 706                               | 587                              | 0,01                      | 4,813 % éch. 25/10/2034                                               | 78                                  | 78                               | 0,00                      |
| 4,383 % éch. 25/09/2037                                                    | 656                                 | 557                              | 0,01                      | 4,033 % éch. 25/08/2036                      | 3 084                               | 1 115                            | 0,01                      | 4,888 % éch. 25/03/2035                                               | 38                                  | 38                               | 0,00                      |
| 4,463 % éch. 25/03/2036                                                    | 1 054                               | 963                              | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/03/2036                      | 765                                 | 723                              | 0,01                      | 5,563 % éch. 25/12/2034                                               | 221                                 | 220                              | 0,00                      |
| 4,513 % éch. 25/03/2034                                                    | 10                                  | 11                               | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/02/2036                      | 298                                 | 104                              | 0,00                      | People's Choice Home Loan Securities Trust                            |                                     |                                  |                           |
| 4,603 % éch. 25/10/2047                                                    | 2 347                               | 2 295                            | 0,03                      | 4,243 % éch. 25/03/2036                      | 842                                 | 489                              | 0,01                      | 5,113 % éch. 25/01/2035                                               | 40                                  | 40                               | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/03/2047                                                    | 42                                  | 33                               | 0,00                      | 4,513 % éch. 25/10/2035                      | 230                                 | 237                              | 0,00                      | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust                   |                                     |                                  |                           |
| 4,753 % éch. 25/02/2036                                                    | 8 408                               | 7 658                            | 0,08                      | 4,543 % éch. 25/02/2034                      | 335                                 | 362                              | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/09/2036                                               | 926                                 | 214                              | 0,00                      |
| 4,863 % éch. 25/05/2047                                                    | 626                                 | 578                              | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/04/2034                      | 165                                 | 167                              | 0,00                      | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                               |                                     |                                  |                           |
| 5,263 % éch. 25/02/2035                                                    | 13                                  | 13                               | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/10/2035                      | 1 325                               | 1 195                            | 0,01                      | 3,973 % éch. 25/01/2037                                               | 155                                 | 152                              | 0,00                      |
| 5,338 % éch. 25/11/2034                                                    | 472                                 | 473                              | 0,01                      | MASTR Specialized Loan Trust                 |                                     |                                  |                           | RAAC Trust                                                            |                                     |                                  |                           |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                       |                                     |                                  |                           | 4,888 % éch. 25/11/2035                      | 92                                  | 87                               | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/06/2044                                               | 30                                  | 28                               | 0,00                      |
| 4,049 % éch. 25/01/2032                                                    | 11                                  | 11                               | 0,00                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust       |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/09/2045                                               | 20                                  | 20                               | 0,00                      |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                          |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/08/2037                      | 2 412                               | 1 154                            | 0,01                      | 4,463 % éch. 25/11/2046                                               | 124                                 | 117                              | 0,00                      |
| 3,155 % éch. 25/07/2036                                                    | 2 284                               |                                  |                           | 4,084 % éch. 25/11/2037                      | 5 053                               | 1 513                            | 0,02                      | 5,263 % éch. 25/09/2047                                               | 306                                 | 312                              | 0,00                      |
| 3,919 % éch. 25/07/2037                                                    | 146                                 | 98                               | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/02/2047                      | 88                                  | 51                               | 0,00                      | Renaissance Home Equity Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| DataBank Issuer LLC                                                        |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/04/2035                      | 14                                  | 14                               | 0,00                      | 5,340 % éch. 25/01/2037                                               | 1 336                               | 393                              | 0,00                      |
| 5,180 % éch. 27/09/2055                                                    | 5 400                               | 5 301                            | 0,06                      | MF1 LLC                                      |                                     |                                  |                           | Residential Asset Mortgage Products Trust                             |                                     |                                  |                           |
| Dwight Issuer LLC                                                          |                                     |                                  |                           | 5,087 % éch. 18/02/2043                      | 4 400                               | 4 408                            | 0,05                      | 4,403 % éch. 25/01/2036                                               | 299                                 | 279                              | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 18/01/2044 (a)                                                | 2 100                               | 2 103                            | 0,02                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust       |                                     |                                  |                           | Residential Asset Securities Corp. Trust                              |                                     |                                  |                           |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                           |                                     |                                  |                           | 3,833 % éch. 25/10/2036                      | 59                                  | 26                               | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/11/2036                                               | 190                                 | 177                              | 0,00                      |
| 4,813 % éch. 25/05/2037                                                    | 1 258                               | 1 237                            | 0,01                      | 3,893 % éch. 25/11/2036                      | 272                                 | 117                              | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/11/2036                                               | 41                                  | 39                               | 0,00                      |

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,323 % éch. 25/04/2036                               | \$ 5                                | \$ 5                             | 0,00                      | 3,350 % éch. 15/04/2031                          | \$ 2 211                            | \$ 2 130                         | 0,02                      | Builders FirstSource, Inc.             | \$ 7 175                            | \$ 6 689                         | 0,07                      |
| 4,363 % éch. 25/02/2036                               | 78                                  | 77                               | 0,00                      | 3,375 % éch. 01/11/2028                          | 3 411                               | 3 372                            | 0,04                      | 4,250 % éch. 01/02/2032                | 4 500                               | 4 555                            | 0,05                      |
| 4,423 % éch. 25/12/2035                               | 111                                 | 98                               | 0,00                      | 3,575 % éch. 15/07/2029                          | 1 754                               | 1 731                            | 0,02                      | 6,375 % éch. 01/03/2034                | 2 450                               | 2 501                            | 0,03                      |
| RIN LLC                                               |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 15/12/2029                          | 3 372                               | 3 264                            | 0,03                      | 6,750 % éch. 15/05/2035                |                                     |                                  |                           |
| 5,044 % éch. 20/07/2037 (a)                           | 3 000                               | 3 000                            | 0,03                      | 3,650 % éch. 15/08/2030                          | 3 405                               | 3 330                            | 0,04                      | Burford Capital Global Finance LLC     |                                     |                                  |                           |
| 5,194 % éch. 20/07/2037 (a)                           | 500                                 | 500                              | 0,01                      | 5,250 % éch. 10/05/2040                          | 9 800                               | 9 755                            | 0,10                      | 8,500 % éch. 15/01/2034                | 6 800                               | 5 965                            | 0,06                      |
| 5,344 % éch. 20/07/2037 (a)                           | 500                                 | 500                              | 0,01                      | American Builders & Contractors Supply Co., Inc. |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 01/07/2031                | 4 661                               | 4 542                            | 0,05                      |
| Saxon Asset Securities Trust                          |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/01/2028                          | 10 800                              | 10 627                           | 0,11                      | Cantor Fitzgerald LP                   |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/05/2047                               | 5 233                               | 3 778                            | 0,04                      | American Tower Corp.                             |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 12/12/2028                | 5 350                               | 5 556                            | 0,06                      |
| 4,163 % éch. 25/09/2047                               | 8 887                               | 8 395                            | 0,09                      | 5,450 % éch. 15/02/2034                          | 1 200                               | 1 219                            | 0,01                      | Carvana Co.                            |                                     |                                  |                           |
| 4,228 % éch. 25/03/2036                               | 659                                 | 662                              | 0,01                      | 5,900 % éch. 15/11/2033                          | 4 300                               | 4 489                            | 0,05                      | 9,000 % éch. 01/06/2030                | 7 345                               | 7 599                            | 0,08                      |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust        |                                     |                                  |                           | Amgen, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 01/06/2031                |                                     |                                  |                           |
| 3,943 % éch. 25/07/2036                               | 226                                 | 72                               | 0,00                      | 5,250 % éch. 02/03/2033                          | 10 000                              | 10 179                           | 0,11                      | (k)                                    | 963                                 | 1 063                            | 0,01                      |
| 4,043 % éch. 25/07/2036                               | 534                                 | 467                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 02/03/2033                          | 2 800                               | 2 717                            | 0,03                      | CDW LLC                                |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/03/2036                               | 1 084                               | 688                              | 0,01                      | Antares Holdings LP                              |                                     |                                  |                           | 3,569 % éch. 01/12/2031                | 11 500                              | 10 563                           | 0,11                      |
| 4,263 % éch. 25/05/2036                               | 219                                 | 117                              | 0,00                      | 2,750 % éch. 15/01/2027                          | 2 700                               | 2 661                            | 0,03                      | Centene Corp.                          |                                     |                                  |                           |
| 4,303 % éch. 25/03/2036                               | 83                                  | 78                               | 0,00                      | 6,350 % éch. 23/10/2029                          | 2 000                               | 1 994                            | 0,02                      | 3,000 % éch. 15/10/2030                | 4 200                               | 3 804                            | 0,04                      |
| 4,423 % éch. 25/08/2035                               | 72                                  | 56                               | 0,00                      | APLD ComputeCo LLC                               |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/02/2030                | 9 300                               | 8 673                            | 0,09                      |
| SG Mortgage Securities Trust                          |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/06/2031                          | 4 000                               | 3 997                            | 0,04                      | 4,625 % éch. 15/12/2029                | 10 300                              | 9 997                            | 0,11                      |
| 4,183 % éch. 25/10/2036                               | 1 500                               | 1 237                            | 0,01                      | AppLovin Corp.                                   |                                     |                                  |                           | Cheniere Energy Partners LP            |                                     |                                  |                           |
| SLAM Ltd.                                             |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 01/12/2029                          | 10 378                              | 10 466                           | 0,11                      | 4,000 % éch. 01/03/2031                | 6 000                               | 5 774                            | 0,06                      |
| 5,547 % éch. 15/07/2051                               | 23 404                              | 23 393                           | 0,25                      | Ares Strategic Income Fund                       |                                     |                                  |                           | Chord Energy Corp.                     |                                     |                                  |                           |
| Soundview Home Loan Trust                             |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 15/01/2029                          | 3 100                               | 3 037                            | 0,03                      | 6,750 % éch. 15/03/2033                | 7 100                               | 7 209                            | 0,08                      |
| 3,883 % éch. 25/11/2036                               | 31                                  | 8                                | 0,00                      | 5,150 % éch. 15/01/2031                          | 6 000                               | 5 733                            | 0,06                      | Citadel Finance LLC                    |                                     |                                  |                           |
| 4,228 % éch. 25/06/2036                               | 13 225                              | 11 940                           | 0,13                      | 6,200 % éch. 21/03/2032                          | 5 000                               | 4 949                            | 0,05                      | 5,900 % éch. 10/02/2030                | 16 600                              | 16 745                           | 0,18                      |
| 4,243 % éch. 25/07/2036                               | 169                                 | 157                              | 0,00                      | Arthur J. Gallagher & Co.                        |                                     |                                  |                           | Citadel Securities Global Holdings LLC |                                     |                                  |                           |
| Specialty Underwriting & Residential Finance Trust    |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 15/02/2035                          | 5 000                               | 4 966                            | 0,05                      | 5,750 % éch. 27/03/2036                | 2 900                               | 2 879                            | 0,03                      |
| 3,767 % éch. 25/02/2037                               | 436                                 | 137                              | 0,00                      | Ashtead Capital, Inc.                            |                                     |                                  |                           | Cloud Software Group, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/11/2037                               | 558                                 | 304                              | 0,00                      | 5,550 % éch. 30/05/2033                          | 6 100                               | 6 165                            | 0,07                      | 6,500 % éch. 31/03/2029                | 5 900                               | 5 729                            | 0,06                      |
| 4,303 % éch. 25/04/2037                               | 101                                 | 75                               | 0,00                      | Asurion LLC                                      |                                     |                                  |                           | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.  |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Investment Loan Trust                |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 01/02/2034                          | 2 500                               | 2 316                            | 0,02                      | 6,750 % éch. 15/04/2032                | 9 200                               | 8 936                            | 0,09                      |
| 4,063 % éch. 25/06/2036                               | 2                                   | 2                                | 0,00                      | AT&T, Inc.                                       |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/01/2030                | 7 200                               | 7 182                            | 0,08                      |
| 4,363 % éch. 25/01/2036                               | 17                                  | 17                               | 0,00                      | 3,800 % éch. 01/12/2057                          | 12 425                              | 8 299                            | 0,09                      | Cogent Communications Group LLC        |                                     |                                  |                           |
| 4,438 % éch. 25/11/2035                               | 4 391                               | 4 085                            | 0,04                      | Aviation Capital Group LLC                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2032                | 8 900                               | 8 019                            | 0,08                      |
| 4,528 % éch. 25/08/2035                               | 2 377                               | 2 319                            | 0,03                      | 4,800 % éch. 24/10/2030                          | 15 000                              | 14 860                           | 0,16                      | 7,000 % éch. 15/06/2027                | 8 305                               | 8 252                            | 0,09                      |
| 4,663 % éch. 25/09/2034                               | 22                                  | 21                               | 0,00                      | Axon Enterprise, Inc.                            |                                     |                                  |                           | Community Health Systems, Inc.         |                                     |                                  |                           |
| 4,693 % éch. 25/01/2035                               | 118                                 | 116                              | 0,00                      | 6,125 % éch. 15/03/2030                          | 10 100                              | 10 327                           | 0,11                      | 6,000 % éch. 15/01/2029                | 6 425                               | 6 365                            | 0,07                      |
| 4,888 % éch. 25/07/2033                               | 7                                   | 7                                | 0,00                      | B&G Foods, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | CoreWeave, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| 5,143 % éch. 25/04/2033                               | 11                                  | 11                               | 0,00                      | 8,000 % éch. 15/09/2028                          | 5 000                               | 5 011                            | 0,05                      | 8,500 % éch. 15/07/2032                | € 7 075                             | 7 978                            | 0,08                      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           | Bank of America Corp.                            |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 01/02/2031                | \$ 12 850                           | 12 715                           | 0,13                      |
| 4,103 % éch. 25/12/2036                               | 28                                  | 28                               | 0,00                      | 2,592 % éch. 29/04/2031                          | 8 900                               | 8 214                            | 0,09                      | 9,250 % éch. 01/06/2030                | 4 800                               | 4 835                            | 0,05                      |
| 4,183 % éch. 25/02/2037                               | 76                                  | 75                               | 0,00                      | 3,261 % éch. 28/01/2031                          | € 7 500                             | 8 569                            | 0,09                      | CoStar Group, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| 4,223 % éch. 25/01/2037                               | 1 762                               | 1 008                            | 0,01                      | 4,571 % éch. 27/04/2033                          | \$ 5 000                            | 4 903                            | 0,05                      | 2,800 % éch. 15/07/2030                | 600                                 | 540                              | 0,01                      |
| 4,453 % éch. 25/09/2035                               | 95                                  | 91                               | 0,00                      | 5,288 % éch. 25/04/2034                          | 5 950                               | 6 031                            | 0,06                      | CQP Holdco LP                          |                                     |                                  |                           |
| WalMu Asset-Backed Certificates WalMu Trust           |                                     |                                  |                           | Bayer U.S. Finance LLC                           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/06/2031                | 14 675                              | 14 410                           | 0,15                      |
| 4,063 % éch. 25/01/2037                               | 1 222                               | 1 073                            | 0,01                      | 6,125 % éch. 21/11/2026                          | 5 457                               | 5 486                            | 0,06                      | Crowdstrike Holdings, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust     |                                     |                                  |                           | Beacon Mobility Corp.                            |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/02/2029                | 12 100                              | 11 549                           | 0,12                      |
| 4,243 % éch. 25/05/2036                               | 539                                 | 431                              | 0,01                      | 7,250 % éch. 01/08/2030                          | 9 675                               | 10 078                           | 0,11                      | Crown Castle, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC                             |                                     |                                  |                           | 2,100 % éch. 01/04/2031                | 6 500                               | 5 719                            | 0,06                      |
| 4,503 % éch. 25/04/2034                               | 12                                  | 12                               | 0,00                      | 6,581 % éch. 30/05/2049                          | 47 090                              | 48 062                           | 0,51                      | 2,250 % éch. 15/01/2031                | 4 000                               | 3 564                            | 0,04                      |
|                                                       |                                     | 320 670                          | 3,38                      | BGC Group, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 11/01/2028                | 2 600                               | 2 615                            | 0,03                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,600 % éch. 10/06/2029                          | 2 400                               | 2 475                            | 0,03                      | CVS Health Corp.                       |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Black Pearl Compute LLC                          |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 20/07/2045                | 3 400                               | 3 081                            | 0,03                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/02/2031                          | 6 600                               | 6 693                            | 0,07                      | DAE Funding LLC                        |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Block, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 20/03/2028                | 3 725                               | 3 608                            | 0,04                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/08/2033                          | 14 000                              | 14 105                           | 0,15                      | Diamondback Energy, Inc.               |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/05/2032                          | 13 275                              | 13 559                           | 0,14                      | 5,550 % éch. 01/04/2035                | 4 500                               | 4 591                            | 0,05                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Blue Owl Capital Corp.                           |                                     |                                  |                           | Digital Euro Finco LLC                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,450 % éch. 15/09/2028                          | 6 200                               | 6 281                            | 0,07                      | 3,750 % éch. 15/01/2033                | € 3 800                             | 4 305                            | 0,05                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Blue Owl Finance LLC                             |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 20/11/2037                | 8 100                               | 9 142                            | 0,10                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 18/04/2034                          | 5 875                               | 5 754                            | 0,06                      | Discovery Communications LLC           |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Boeing Co.                                       |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 15/05/2030                | \$ 2 450                            | 2 280                            | 0,02                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 01/02/2028                          | 7 500                               | 7 344                            | 0,08                      | Discovery Global Holdings, Inc.        |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 01/08/2059                          | 1 500                               | 1 072                            | 0,01                      | 4,279 % éch. 15/03/2032                | 6 823                               | 6 127                            | 0,06                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 01/05/2030                          | 10 700                              | 10 832                           | 0,11                      | 5,050 % éch. 15/03/2042                | 7 825                               | 5 742                            | 0,06                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,805 % éch. 01/05/2050                          | 1 400                               | 1 384                            | 0,01                      | Duke Energy Indiana LLC                |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,930 % éch. 01/05/2060                          | 10 000                              | 9 844                            | 0,10                      | 5,250 % éch. 01/03/2034                | 9 000                               | 9 144                            | 0,10                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 6,298 % éch. 01/05/2029                          | 1 700                               | 1 770                            | 0,02                      | Edison International                   |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 7,008 % éch. 01/05/2064                          | 1 700                               | 1 935                            | 0,02                      | 5,450 % éch. 15/06/2029                | 3 100                               | 3 132                            | 0,03                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | British Airways Pass-Through Trust               |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/06/2027                | 300                                 | 302                              | 0,00                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 15/09/2036                          | 995                                 | 911                              | 0,01                      | El Paso Natural Gas Co. LLC            |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Brixmor Operating Partnership LP                 |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 15/06/2032                | 1 000                               | 1 167                            | 0,01                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 01/04/2032                          | 3 400                               | 3 421                            | 0,04                      | ELK Grove Village Property LLC         |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Broadcom, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/06/2031                | 3 700                               | 3 728                            | 0,04                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/02/2031                          | 8 900                               | 8 054                            | 0,08                      | Ellucian Holdings, Inc.                |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,187 % éch. 15/11/2036                          | 2 600                               | 2 179                            | 0,02                      | 6,500 % éch. 01/12/2029                | 5 600                               | 5 427                            | 0,06                      |



# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Encore Capital Group, Inc.                  |                                     |                                  |                           | HCA, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 03/06/2030                                 | € 4 700                             | \$ 5 346                         | 0,06                      |
| 6,625 % éch. 15/04/2031                     | \$ 9 100                            | \$ 9 211                         | 0,10                      | 3,500 % éch. 15/07/2051              | \$ 5 000                            | \$ 3 385                         | 0,04                      | 3,724 % éch. 25/11/2034                                 | 7 000                               | 7 946                            | 0,08                      |
| 8,500 % éch. 15/05/2030                     | 7 575                               | 8 050                            | 0,08                      | 4,625 % éch. 15/03/2052              | 4 100                               | 3 341                            | 0,04                      | National Health Investors, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
| Energy Transfer LP                          |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/06/2033              | 4 925                               | 5 034                            | 0,05                      | 5,350 % éch. 01/02/2033                                 | \$ 9 700                            | 9 607                            | 0,10                      |
| 4,950 % éch. 15/05/2028                     | 10 863                              | 10 921                           | 0,12                      | 5,750 % éch. 01/03/2035              | 5 000                               | 5 156                            | 0,05                      | National Mentor Holdings, Inc.                          |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 01/10/2043                     | 200                                 | 197                              | 0,00                      | 5,900 % éch. 01/06/2053              | 25                                  | 24                               | 0,00                      | 10,500 % éch. 15/12/2030                                | 3 750                               | 3 955                            | 0,04                      |
| 6,100 % éch. 15/02/2042                     | 800                                 | 804                              | 0,01                      | Hilton Domestic Operating Co., Inc.  |                                     |                                  |                           | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.      |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/02/2042                     | 7 140                               | 7 549                            | 0,08                      | 5,875 % éch. 15/03/2033              | 3 450                               | 3 483                            | 0,04                      | 4,189 % éch. 03/12/2027                                 | 8 400                               | 8 414                            | 0,09                      |
| 6,625 % éch. 15/10/2036                     | 800                                 | 866                              | 0,01                      | Host Hotels & Resorts LP             |                                     |                                  |                           | Neptune Bidco U.S., Inc.                                |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 01/07/2038                     | 9 465                               | 10 943                           | 0,12                      | 5,500 % éch. 15/04/2035              | 10 000                              | 10 040                           | 0,11                      | 9,500 % éch. 15/02/2033                                 | 2 800                               | 2 834                            | 0,03                      |
| Entergy Louisiana LLC                       |                                     |                                  |                           | HPS Corporate Lending Fund           |                                     |                                  |                           | Newmark Group, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 15/09/2034                     | 8 700                               | 8 792                            | 0,09                      | 5,450 % éch. 14/01/2028              | 7 000                               | 6 975                            | 0,07                      | 7,500 % éch. 12/01/2029                                 | 3 250                               | 3 407                            | 0,04                      |
| 5,350 % éch. 15/03/2034                     | 5 000                               | 5 126                            | 0,05                      | 6,300 % éch. 19/08/2031              | 4 475                               | 4 465                            | 0,05                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                         |                                     |                                  |                           |
| EPR Properties                              |                                     |                                  |                           | Hyatt Hotels Corp.                   |                                     |                                  |                           | 5,688 % éch. 13/09/2027                                 | 2 000                               | 1 990                            | 0,02                      |
| 3,750 % éch. 15/08/2029                     | 3 000                               | 2 886                            | 0,03                      | 5,375 % éch. 15/12/2031              | 4 000                               | 4 072                            | 0,04                      | NLG Global Funding                                      |                                     |                                  |                           |
| EQT Corp.                                   |                                     |                                  |                           | IHG Finance LLC                      |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 23/01/2030                                 | 9 300                               | 9 453                            | 0,10                      |
| 4,750 % éch. 15/01/2031                     | 14 175                              | 14 047                           | 0,15                      | 3,625 % éch. 27/09/2031              | € 8 100                             | 9 271                            | 0,10                      | Noble Finance LLC                                       |                                     |                                  |                           |
| Equinix Europe Financing Corp. LLC          |                                     |                                  |                           | Ingevity Corp.                       |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 15/04/2030                                 | 13 750                              | 14 254                           | 0,15                      |
| 3,250 % éch. 15/03/2031                     | € 8 100                             | 9 154                            | 0,10                      | 3,875 % éch. 01/11/2028              | \$ 11 700                           | 11 342                           | 0,12                      | NRG Energy, Inc.                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 22/11/2034                     | 3 700                               | 4 139                            | 0,04                      | Ingram Micro, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 4,734 % éch. 15/10/2030                                 | 8 100                               | 8 005                            | 0,08                      |
| Expand Energy Corp.                         |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/05/2029              | 6 625                               | 6 511                            | 0,07                      | NuStar Logistics LP                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 01/02/2032                     | \$ 16 800                           | 16 379                           | 0,17                      | ION Platform Finance U.S., Inc.      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 28/04/2027                                 | 20 400                              | 20 465                           | 0,22                      |
| F&G Global Funding                          |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 30/09/2032 (k)          | 9 500                               | 6 895                            | 0,07                      | OAK-Eagle Acquireco, Inc.                               |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 16/01/2030                     | 2 800                               | 2 834                            | 0,03                      | 9,000 % éch. 01/08/2029              | 2 850                               | 2 538                            | 0,03                      | 8,750 % éch. 01/07/2034                                 | 2 000                               | 2 124                            | 0,02                      |
| Fidelity National Financial, Inc.           |                                     |                                  |                           | IQVIA, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Olympus Water U.S. Holding Corp.                        |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 15/06/2030                     | 200                                 | 189                              | 0,00                      | 6,250 % éch. 01/06/2032              | 7 500                               | 7 634                            | 0,08                      | 6,750 % éch. 01/08/2032                                 | 6 100                               | 5 965                            | 0,06                      |
| First Student Bidco, Inc.                   |                                     |                                  |                           | Jackson National Life Global Funding |                                     |                                  |                           | Omega Healthcare Investors, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 31/07/2029                     | 6 025                               | 5 775                            | 0,06                      | 4,600 % éch. 01/10/2029              | 6 400                               | 6 312                            | 0,07                      | 4,750 % éch. 15/01/2028                                 | 200                                 | 200                              | 0,00                      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                   |                                     |                                  |                           | Jane Street Group                    |                                     |                                  |                           | OneMain Finance Corp.                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,700 % éch. 10/08/2026                     | 11 600                              | 11 575                           | 0,12                      | 6,125 % éch. 01/11/2032              | 10 450                              | 10 457                           | 0,11                      | 6,750 % éch. 15/09/2033                                 | 9 800                               | 9 714                            | 0,10                      |
| 3,815 % éch. 02/11/2027                     | 1 200                               | 1 183                            | 0,01                      | 7,125 % éch. 30/04/2031              | 16 200                              | 16 758                           | 0,18                      | 7,125 % éch. 15/11/2031 (k)                             | 5 555                               | 5 774                            | 0,06                      |
| 4,125 % éch. 17/08/2027                     | 4 300                               | 4 263                            | 0,04                      | JetBlue Pass-Through Trust           |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/09/2032                                 | 10 700                              | 10 893                           | 0,11                      |
| 4,271 % éch. 09/01/2027                     | 1 700                               | 1 695                            | 0,02                      | 2,750 % éch. 15/11/2033              | 695                                 | 617                              | 0,01                      | ONEOK, Inc.                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 07/11/2029                     | 9 000                               | 9 111                            | 0,10                      | 4,000 % éch. 15/05/2034              | 7 444                               | 7 071                            | 0,07                      | 5,850 % éch. 01/11/2064                                 | 1 725                               | 1 613                            | 0,02                      |
| 7,350 % éch. 04/11/2027                     | 1 100                               | 1 131                            | 0,01                      | JPMorgan Chase & Co.                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/09/2030                                 | 2 475                               | 2 603                            | 0,03                      |
| Fortress Intermediate, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 4,586 % éch. 26/04/2033              | 5 000                               | 4 925                            | 0,05                      | Pacific Gas & Electric Co.                              |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 01/06/2031                     | 2 850                               | 2 901                            | 0,03                      | 5,040 % éch. 23/01/2028              | 4 000                               | 4 013                            | 0,04                      | 2,100 % éch. 01/08/2027                                 | 300                                 | 292                              | 0,00                      |
| Freedom Mortgage Holdings LLC               |                                     |                                  |                           | 5,294 % éch. 22/07/2035              | 7 825                               | 7 909                            | 0,08                      | 2,500 % éch. 01/02/2031                                 | 1 300                               | 1 167                            | 0,01                      |
| 6,875 % éch. 01/05/2031                     | 4 300                               | 4 176                            | 0,04                      | 5,766 % éch. 22/04/2035              | 11 000                              | 11 446                           | 0,12                      | 3,300 % éch. 15/03/2027                                 | 3 100                               | 3 073                            | 0,03                      |
| FS KKR Capital Corp.                        |                                     |                                  |                           | Kilroy Realty LP                     |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 01/12/2027                                 | 2 900                               | 2 846                            | 0,03                      |
| 3,125 % éch. 12/10/2028                     | 6 600                               | 6 216                            | 0,07                      | 5,875 % éch. 15/10/2035              | 7 742                               | 7 655                            | 0,08                      | 3,300 % éch. 01/08/2040                                 | 31 900                              | 23 940                           | 0,25                      |
| 6,125 % éch. 15/01/2031 (k)                 | 5 000                               | 4 809                            | 0,05                      | Ladder Capital Finance Holdings LLLP |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/07/2028                                 | 2 350                               | 2 309                            | 0,02                      |
| FTAI Aviation Investors LLC                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/08/2030              | 7 600                               | 7 678                            | 0,08                      | 3,950 % éch. 01/12/2047                                 | 800                                 | 587                              | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 01/05/2028                     | 19 750                              | 19 714                           | 0,21                      | 7,000 % éch. 15/07/2031              | 1 400                               | 1 452                            | 0,02                      | 4,200 % éch. 01/06/2041                                 | 1 100                               | 903                              | 0,01                      |
| GA Global Funding Trust                     |                                     |                                  |                           | Las Vegas Sands Corp.                |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/03/2046                                 | 2 000                               | 1 550                            | 0,02                      |
| 5,400 % éch. 13/01/2030                     | 1 600                               | 1 606                            | 0,02                      | 3,900 % éch. 08/08/2029              | 6 875                               | 6 642                            | 0,07                      | 4,450 % éch. 15/04/2042                                 | 3 500                               | 2 912                            | 0,03                      |
| 5,900 % éch. 13/01/2035                     | 2 400                               | 2 421                            | 0,03                      | 5,900 % éch. 01/06/2027              | 8 250                               | 8 328                            | 0,09                      | 4,500 % éch. 01/07/2040                                 | 8 196                               | 7 057                            | 0,07                      |
| Gaia Purchaser, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/08/2029              | 3 475                               | 3 570                            | 0,04                      | 4,600 % éch. 15/06/2043                                 | 3 600                               | 3 001                            | 0,03                      |
| 7,625 % éch. 15/07/2033 (a)                 | 3 000                               | 3 036                            | 0,03                      | Level 3 Financing, Inc.              |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 01/08/2028                                 | 100                                 | 100                              | 0,00                      |
| Gartner, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 31/03/2034              | 1 635                               | 1 687                            | 0,02                      | PacifiCorp                                              |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/06/2029                     | 4 350                               | 4 115                            | 0,04                      | Live Nation Entertainment, Inc.      |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/02/2031                                 | 3 300                               | 3 351                            | 0,04                      |
| 3,750 % éch. 01/10/2030                     | 5 300                               | 4 843                            | 0,05                      | 3,750 % éch. 15/01/2028              | 7 700                               | 7 556                            | 0,08                      | 5,450 % éch. 15/02/2034                                 | 9 000                               | 9 107                            | 0,10                      |
| Genesis Energy LP                           |                                     |                                  |                           | Lseg U.S. Fin Corp.                  |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/08/2056                                 | 10 550                              | 10 484                           | 0,11                      |
| 7,875 % éch. 15/05/2032                     | 5 025                               | 5 184                            | 0,05                      | 5,297 % éch. 28/03/2034              | 5 000                               | 5 041                            | 0,05                      | Paradigm Parent LLC and Paradigm Parent CO-Issuer, Inc. |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/01/2029                     | 4 100                               | 4 236                            | 0,04                      | Marriott International, Inc.         |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 17/04/2032                                 | 6 800                               | 6 094                            | 0,06                      |
| Georgia Power Co.                           |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/06/2030              | 900                                 | 898                              | 0,01                      | Paramount Global                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/03/2034                     | 7 700                               | 7 823                            | 0,08                      | 5,500 % éch. 15/04/2037              | 10 050                              | 10 151                           | 0,11                      | 4,600 % éch. 15/01/2045                                 | 1 500                               | 956                              | 0,01                      |
| Global Atlantic Fin Co.                     |                                     |                                  |                           | Mars, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 15/08/2044                                 | 4 275                               | 2 828                            | 0,03                      |
| 4,400 % éch. 15/10/2029                     | 11 620                              | 11 282                           | 0,12                      | 5,200 % éch. 01/03/2035              | 5 000                               | 5 022                            | 0,05                      | 4,950 % éch. 15/01/2031                                 | 9 100                               | 8 462                            | 0,09                      |
| GLP Capital LP                              |                                     |                                  |                           | Marvell Technology, Inc.             |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 30/04/2036                                 | 6 100                               | 5 725                            | 0,06                      |
| 5,625 % éch. 01/03/2036                     | 5 700                               | 5 589                            | 0,06                      | 5,750 % éch. 15/02/2029              | 6 300                               | 6 464                            | 0,07                      | Post Holdings, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 01/06/2028                     | 7 720                               | 7 810                            | 0,08                      | Matador Resources Co.                |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/03/2036                                 | 14 700                              | 14 545                           | 0,15                      |
| 6,250 % éch. 15/09/2054                     | 3 500                               | 3 516                            | 0,04                      | 6,250 % éch. 15/04/2033              | 1 950                               | 1 944                            | 0,02                      | PR RNO Property Owner LLC                               |                                     |                                  |                           |
| Goat Holdco LLC                             |                                     |                                  |                           | Meridian Arc Holdco LLC              |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/05/2031                                 | 7 700                               | 7 694                            | 0,08                      |
| 6,750 % éch. 01/02/2032                     | 4 900                               | 5 026                            | 0,05                      | 6,250 % éch. 30/04/2031              | 9 450                               | 9 477                            | 0,10                      | Prime Security Services Borrower LLC                    |                                     |                                  |                           |
| Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           | Mobility Global, Inc.                |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 31/08/2027                                 | 8 275                               | 8 111                            | 0,09                      |
| 2,615 % éch. 22/04/2032                     | 5 375                               | 4 829                            | 0,05                      | 6,050 % éch. 15/06/2036              | 2 000                               | 2 023                            | 0,02                      | Primo Water Holdings, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| 5,330 % éch. 23/07/2035                     | 16 275                              | 16 336                           | 0,17                      | Morgan Stanley                       |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 01/04/2029                                 | 12 400                              | 12 454                           | 0,13                      |
| Goodman U.S. Finance Seven LLC              |                                     |                                  |                           | 3,955 % éch. 21/03/2035              | € 2 800                             | 3 246                            | 0,03                      | Qnity Electronics, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 28/04/2036                     | 2 900                               | 2 852                            | 0,03                      | 5,664 % éch. 17/04/2036              | \$ 8 100                            | 8 319                            | 0,09                      | 5,750 % éch. 15/08/2032                                 | 1 800                               | 1 812                            | 0,02                      |
| Gray Media, Inc.                            |                                     |                                  |                           | MSCI, Inc.                           |                                     |                                  |                           | Quikrete Holdings, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |
| 9,625 % éch. 15/07/2032                     | 8 400                               | 8 115                            | 0,09                      | 5,250 % éch. 01/09/2035              | 5 700                               | 5 581                            | 0,06                      | 6,375 % éch. 01/03/2032                                 | 12 150                              | 12 413                           | 0,13                      |
| Gray Oak Pipeline LLC                       |                                     |                                  |                           | National Fuel Gas Co.                |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/03/2033                                 | 2 925                               | 2 983                            | 0,03                      |
| 3,450 % éch. 15/10/2027                     | 2 900                               | 2 849                            | 0,03                      | 2,950 % éch. 01/03/2031              | 1 017                               | 931                              | 0,01                      | QXO Building Products, Inc.                             |                                     |                                  |                           |
| HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 15/10/2031              | 4 100                               | 4 083                            | 0,04                      | 6,500 % éch. 15/07/2031                                 | 4 250                               | 4 334                            | 0,05                      |
| 6,375 % éch. 01/07/2034                     | 5 700                               | 5 816                            | 0,06                      | National Grid North America, Inc.    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 30/04/2032                                 | 5 775                               | 5 967                            | 0,06                      |
|                                             |                                     |                                  |                           | 1,054 % éch. 20/01/2031              | € 2 000                             | 2 068                            | 0,02                      | 6,875 % éch. 15/07/2034                                 | 3 750                               | 3 852                            | 0,04                      |

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| RD Michigan Property Owner LLC           | \$ 22 825                           | \$22 762                         | 0,24                      | United Airlines Pass-Through Trust        | \$ 1 271                            | \$1 160                          | 0,01                      | Databricks, Inc.                     | \$ 10 735                           | \$10 735                         | 0,11                      |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                  |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch. 01/11/2033                   | 1 271                               |                                  | 0,01                      | 1,000 % éch. 05/01/2032              | 10 735                              |                                  | 0,11                      |
| RFNA LP                                  |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 01/11/2029                   | 1 854                               | 1 780                            | 0,02                      | 8,114 % éch. 05/01/2032              | 14 165                              | 14 147                           | 0,15                      |
| 7,875 % éch. 15/02/2030                  | 575                                 | 580                              | 0,01                      | 3,100 % éch. 07/01/2030                   | 551                                 | 540                              | 0,01                      | Discovery Global Holdings, Inc.      |                                     |                                  |                           |
| RGA Global Funding                       |                                     |                                  |                           | 3,450 % éch. 01/06/2029                   | 620                                 | 608                              | 0,01                      | 6,144 % éch. 03/06/2033              | 36 190                              | 36 245                           | 0,38                      |
| 5,250 % éch. 09/01/2030                  | 8 400                               | 8 511                            | 0,09                      | 3,450 % éch. 07/01/2030                   | 1 103                               | 1 070                            | 0,01                      | Ecopetrol S.A.                       |                                     |                                  |                           |
| Rio Oil Finance Trust                    |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/09/2031                   | 1 456                               | 1 406                            | 0,01                      | 5,843 % éch. 18/12/2027              | 7 500                               | 7 527                            | 0,08                      |
| 8,200 % éch. 06/04/2028                  | 670                                 | 687                              | 0,01                      | 4,150 % éch. 25/02/2033                   | 385                                 | 374                              | 0,00                      | Finastra USA, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 06/01/2027                  | 481                                 | 488                              | 0,01                      | 5,875 % éch. 15/04/2029                   | 13 629                              | 13 797                           | 0,15                      | 7,746 % éch. 15/09/2032              | 10 349                              | 9 568                            | 0,10                      |
| RLJ Lodging Trust LP                     |                                     |                                  |                           | Uniti Services LLC                        |                                     |                                  |                           | Fortress Intermediate, Inc.          |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 01/07/2026                  | 3 600                               | 3 600                            | 0,04                      | 7,500 % éch. 15/10/2033                   | 1 280                               | 1 348                            | 0,01                      | 6,624 % éch. 27/06/2031              | 3 501                               | 3 490                            | 0,04                      |
| Rocket Cos., Inc.                        |                                     |                                  |                           | Univision Communications, Inc.            |                                     |                                  |                           | Hilton Grand Vacations Borrower LLC  |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 01/08/2030                  | 4 800                               | 4 885                            | 0,05                      | 8,875 % éch. 15/04/2033                   | 5 100                               | 5 024                            | 0,05                      | 5,644 % éch. 02/08/2028              | 754                                 | 754                              | 0,01                      |
| 6,125 % éch. 01/08/2031                  | 5 200                               | 5 315                            | 0,06                      | 9,375 % éch. 01/08/2032                   | 5 934                               | 6 034                            | 0,06                      | ION Platform Finance U.S., Inc.      |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/08/2029                  | 8 000                               | 8 176                            | 0,09                      | Venture Global Calcasieu Pass LLC         |                                     |                                  |                           | 7,482 % éch. 07/10/2032              | 10 627                              | 7 692                            | 0,08                      |
| 7,125 % éch. 01/02/2032                  | 3 650                               | 3 791                            | 0,04                      | 6,250 % éch. 15/01/2030                   | 5 300                               | 5 431                            | 0,06                      | Jane Street Group LLC                |                                     |                                  |                           |
| Rollins, Inc.                            |                                     |                                  |                           | Venture Global LNG, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 5,666 % éch. 15/12/2031              | 4 775                               | 4 737                            | 0,05                      |
| 5,250 % éch. 24/02/2035                  | 3 000                               | 2 997                            | 0,03                      | 6,375 % éch. 15/12/2034                   | 12 000                              | 11 800                           | 0,12                      | Kaseya, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
| Sammons Financial Group, Inc.            |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/06/2036                   | 12 375                              | 12 205                           | 0,13                      | 6,913 % éch. 22/03/2032              | 4 695                               | 3 654                            | 0,04                      |
| 6,875 % éch. 15/04/2034                  | 7 450                               | 7 978                            | 0,08                      | 7,000 % éch. 15/01/2030                   | 20 000                              | 20 408                           | 0,22                      | LifePoint Health, Inc.               |                                     |                                  |                           |
| San Diego Gas & Electric Co.             |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 01/06/2031                   | 2 175                               | 2 265                            | 0,02                      | 7,423 % éch. 19/05/2031              | 1 567                               | 1 546                            | 0,02                      |
| 5,200 % éch. 15/03/2036                  | 2 700                               | 2 688                            | 0,03                      | 9,500 % éch. 01/02/2029                   | 15 182                              | 16 348                           | 0,17                      | Newfold Digital Holdings Group, Inc. |                                     |                                  |                           |
| SBA Tower Trust                          |                                     |                                  |                           | Venture Global Plaquemines LNG LLC        |                                     |                                  |                           | 7,214 % éch. 30/04/2029              | 11 956                              | 8 834                            | 0,09                      |
| 4,831 % éch. 15/10/2054                  | 21 800                              | 21 810                           | 0,23                      | 6,125 % éch. 15/12/2030                   | 8 000                               | 8 189                            | 0,09                      | 9,364 % éch. 30/04/2029              | 712                                 | 579                              | 0,01                      |
| Sirius XM Radio LLC                      |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/01/2036                   | 14 375                              | 15 249                           | 0,16                      | Olympus Water U.S. Holding Corp.     |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 15/07/2028                  | 1 530                               | 1 491                            | 0,02                      | Verizon Communications, Inc.              |                                     |                                  |                           | 6,732 % éch. 20/06/2031              | 444                                 | 444                              | 0,00                      |
| 4,125 % éch. 01/07/2030                  | 8 600                               | 8 100                            | 0,09                      | 2,355 % éch. 15/03/2032                   | 19 975                              | 17 461                           | 0,18                      | Paradigm Parent LLC                  |                                     |                                  |                           |
| Sixth Street Lending Partners            |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 30/01/2031                   | 2 600                               | 2 691                            | 0,03                      | 8,232 % éch. 16/04/2032              | 597                                 | 514                              | 0,01                      |
| 5,750 % éch. 15/01/2030                  | 10 000                              | 9 938                            | 0,10                      | VICI Properties LP                        |                                     |                                  |                           | Qnity Electronics, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| SLM Corp.                                |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/02/2029                   | 2 350                               | 2 284                            | 0,02                      | 5,666 % éch. 01/11/2032              | 6 667                               | 6 688                            | 0,07                      |
| 6,500 % éch. 31/01/2030                  | 10 925                              | 11 081                           | 0,12                      | 4,500 % éch. 15/01/2028                   | 2 750                               | 2 732                            | 0,03                      | QualityTech LP                       |                                     |                                  |                           |
| SM Energy Co.                            |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 15/11/2031                   | 4 000                               | 3 984                            | 0,04                      | 7,114 % éch. 30/10/2031              | 9 085                               | 9 130                            | 0,10                      |
| 9,625 % éch. 15/06/2033                  | 2 100                               | 2 304                            | 0,02                      | 5,625 % éch. 01/04/2035                   | 8 700                               | 8 707                            | 0,09                      | QuidelOrtho Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| Snap, Inc.                               |                                     |                                  |                           | VMware LLC                                |                                     |                                  |                           | 7,644 % éch. 20/08/2032              | 11 674                              | 11 511                           | 0,12                      |
| 6,875 % éch. 01/03/2033                  | 9 500                               | 9 266                            | 0,10                      | 4,700 % éch. 15/05/2030                   | 3 900                               | 3 908                            | 0,04                      | Quikrete Holdings, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| Southern California Edison Co.           |                                     |                                  |                           | Vornado Realty LP                         |                                     |                                  |                           | 5,894 % éch. 10/02/2032              | 2 024                               | 2 025                            | 0,02                      |
| 4,000 % éch. 01/04/2047                  | 7 900                               | 5 894                            | 0,06                      | 3,400 % éch. 01/06/2031                   | 4 800                               | 4 411                            | 0,05                      | QXO, Inc.                            |                                     |                                  |                           |
| 5,200 % éch. 01/06/2034                  | 7 700                               | 7 634                            | 0,08                      | Weir Group, Inc.                          |                                     |                                  |                           | TBD % éch. 03/06/2033                | 4 300                               | 4 296                            | 0,05                      |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           | 5,350 % éch. 06/05/2030                   | 6 800                               | 6 862                            | 0,07                      | Rockpoint Gas Storage Partners LP    |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/08/2031                  | 576                                 | 531                              | 0,01                      | Wells Fargo & Co.                         |                                     |                                  |                           | 5,982 % éch. 18/09/2031              | 6 976                               | 6 992                            | 0,07                      |
| 4,100 % éch. 01/10/2029                  | 3 108                               | 3 016                            | 0,03                      | 3,900 % éch. 22/07/2032                   | 10 700                              | 12 473                           | 0,13                      | Spirit Airlines, Inc.                |                                     |                                  |                           |
| Sprint Capital Corp.                     |                                     |                                  |                           | Westinghouse Air Brake Technologies Corp. |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 14/07/2026              | 1 414                               | 832                              | 0,01                      |
| 8,750 % éch. 15/03/2032                  | 12 000                              | 14 140                           | 0,15                      | 5,611 % éch. 11/03/2034                   | \$ 1 900                            | 1 952                            | 0,02                      | SS&C Technologies, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| Standard Industries, Inc.                |                                     |                                  |                           | Windstream Services LLC                   |                                     |                                  |                           | 5,644 % éch. 09/05/2031              | 8 169                               | 8 162                            | 0,09                      |
| 4,750 % éch. 15/01/2028                  | 3 450                               | 3 428                            | 0,04                      | 8,250 % éch. 01/10/2031                   | 15 425                              | 16 275                           | 0,17                      | Standard Industries, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| Starwood Property Trust, Inc.            |                                     |                                  |                           | WMG Acquisition Corp.                     |                                     |                                  |                           | 5,389 % éch. 22/09/2028              | 3 648                               | 3 656                            | 0,04                      |
| 5,750 % éch. 15/01/2031                  | 12 800                              | 12 736                           | 0,13                      | 3,875 % éch. 15/07/2030                   | 3 000                               | 2 844                            | 0,03                      | Stepstone Group Midco GmbH           |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 01/06/2031                  | 3 800                               | 3 823                            | 0,04                      | Wynn Las Vegas LLC                        |                                     |                                  |                           | 6,885 % éch. 26/04/2032              | 8 325                               | 7 814                            | 0,08                      |
| Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/05/2027                   | 700                                 | 700                              | 0,01                      | 8,176 % - 8,179 %                    |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 15/06/2029                  | 3 500                               | 3 488                            | 0,04                      | Wynn Resorts Finance LLC                  |                                     |                                  |                           | éch. 19/12/2031                      | \$ 1 238                            | 1 003                            | 0,01                      |
| Stonepeak Nile Parent LLC                |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 01/10/2029                   | 10 950                              | 10 883                           | 0,11                      | TransDigm, Inc.                      |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 15/03/2032                  | 8 025                               | 8 316                            | 0,09                      | 7,125 % éch. 15/02/2031                   | 2 225                               | 2 353                            | 0,02                      | 5,894 % éch. 22/03/2030              | 1 921                               | 1 923                            | 0,02                      |
| Stryker Corp.                            |                                     |                                  |                           | XPO, Inc.                                 |                                     |                                  |                           | 6,144 % éch. 28/02/2031              | 2 461                               | 2 464                            | 0,03                      |
| 3,375 % éch. 11/09/2032                  | € 1 600                             | 1 826                            | 0,02                      | 6,250 % éch. 01/06/2028                   | 2 475                               | 2 504                            | 0,03                      | 6,144 % éch. 19/08/2032              | 6 368                               | 6 376                            | 0,07                      |
| 3,625 % éch. 11/09/2036                  | 1 850                               | 2 101                            | 0,02                      | Yum! Brands, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 6,144 % éch. 13/02/2033              | 12 300                              | 12 314                           | 0,13                      |
| Sumisho Air Lease Corp.                  |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 31/01/2032                   | 3 100                               | 2 968                            | 0,03                      | U.S. Renal Care, Inc.                |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 24/03/2029                  | \$ 3 600                            | 3 570                            | 0,04                      |                                           |                                     | 2 033 866                        | 21,44                     | 8,758 % éch. 28/06/2028              | 8 104                               | 7 990                            | 0,08                      |
| 4,850 % éch. 24/03/2031                  | 5 300                               | 5 246                            | 0,06                      |                                           |                                     |                                  |                           | UKG, Inc.                            |                                     |                                  |                           |
| SV RNO Property Owner LLC                |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | 5,913 % éch. 10/02/2031              | 8 628                               | 8 146                            | 0,09                      |
| 5,875 % éch. 01/03/2031                  | 10 700                              | 10 553                           | 0,11                      |                                           |                                     |                                  |                           | Venture Global Calcasieu Pass LLC    |                                     |                                  |                           |
| T-Mobile USA, Inc.                       |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | 6,954 % éch. 11/04/2033              | 7 700                               | 7 732                            | 0,08                      |
| 3,500 % éch. 11/02/2037                  | € 5 000                             | 5 532                            | 0,06                      |                                           |                                     |                                  |                           | Versant Media Group, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 15/01/2035                  | \$ 8 000                            | 7 724                            | 0,08                      |                                           |                                     |                                  |                           | 7,232 % éch. 30/01/2031              | 2 000                               | 2 009                            | 0,02                      |
| 5,650 % éch. 15/01/2053                  | 2 000                               | 1 878                            | 0,02                      |                                           |                                     |                                  |                           | VistaJet Malta Finance PLC           |                                     |                                  |                           |
| Tennessee Gas Pipeline Co. LLC           |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | 7,442 % éch. 01/04/2031              | 8 428                               | 8 474                            | 0,09                      |
| 8,375 % éch. 15/06/2032                  | 1 351                               | 1 571                            | 0,02                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     | 302 301                          | 3,19                      |
| TopBuild Corp.                           |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/03/2029                  | 5 775                               | 5 775                            | 0,06                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2032                  | 8 900                               | 9 014                            | 0,10                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| TransDigm, Inc.                          |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 31/01/2034                  | 3 300                               | 3 370                            | 0,04                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 01/03/2029                  | 3 400                               | 3 456                            | 0,04                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 01/12/2031                  | 7 125                               | 7 387                            | 0,08                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| Uber Technologies, Inc.                  |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 15/09/2034                  | 4 100                               | 4 025                            | 0,04                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| UKG, Inc.                                |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 01/02/2031                  | 12 525                              | 12 176                           | 0,13                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |

## CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                                              |                         |        |        |      |
|----------------------------------------------|-------------------------|--------|--------|------|
| Aligned Data Centers International LP        | 7,164 % éch. 13/05/2028 | 5 983  | 5 983  | 0,06 |
| American Axle & Manufacturing Holdings, Inc. | 6,874 % - 6,915 %       |        |        |      |
|                                              | éch. 03/02/2033         | 3 031  | 3 038  | 0,03 |
| Avolon TLB Borrower U.S. LLC                 | 5,389 % éch. 24/06/2030 | 27 798 | 27 835 | 0,29 |
| BCPE Empire Holdings, Inc.                   | 6,894 % éch. 11/12/2030 | 963    | 952    | 0,01 |
| Charter Communications Operating LLC         | 5,942 % éch. 15/12/2031 | 6 155  | 6 078  | 0,06 |
| Columbus McKinnon Corp.                      | 7,232 % éch. 03/02/2033 | 6 780  | 6 776  | 0,07 |
| Cotiviti Corp.                               | 6,370 % éch. 01/05/2031 | 17 694 | 16 229 | 0,17 |
|                                              | 6,370 % éch. 26/03/2032 | 5 940  | 5 407  | 0,06 |

## OBLIGATIONS ET BILLETTS MUNICIPAUX

|                                                                     |                         |     |     |      |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----|-----|------|
| Obligations Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011 | 6,202 % éch. 01/07/2031 | 340 | 353 | 0,00 |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----|-----|------|

## TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

|                                |                         |    |    |      |
|--------------------------------|-------------------------|----|----|------|
| Adjustable Rate Mortgage Trust | 4,064 % éch. 25/01/2036 | 24 | 22 | 0,00 |
|                                | 4,303 % éch. 25/02/2036 | 68 | 43 | 0,00 |

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>American Home Mortgage Assets Trust</b>                 |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/08/2037                                     | \$ 257                              | \$ 248                           | 0,00                      | <b>First Horizon Mortgage Pass-Through Trust</b>  |                                     |                                  |                           |
| 4,143 % éch. 25/09/2046                                    | \$ 1 066                            | \$ 1 053                         | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/04/2047                                     | 3 115                               | 2 870                            | 0,03                      | 6,060 % éch. 25/09/2035                           | \$ 181                              | \$ 175                           | 0,00                      |
| 6,750 % éch. 25/06/2037                                    | 70                                  | 63                               | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/08/2036                                     | 49                                  | 19                               | 0,00                      | <b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>          |                                     |                                  |                           |
| <b>American Home Mortgage Investment Trust</b>             |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/11/2036                                     | 10                                  | 15                               | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/10/2046                           | 502                                 | 479                              | 0,01                      |
| 5,895 % éch. 25/12/2035                                    | 703                                 | 204                              | 0,00                      | 4,134 % éch. 20/09/2046                                     | 42                                  | 44                               | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/04/2036                           | 80                                  | 74                               | 0,00                      |
| <b>Angel Oak Mortgage Trust</b>                            |                                     |                                  |                           | 4,143 % éch. 25/07/2046                                     | 7                                   | 8                                | 0,00                      | <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 1,469 % éch. 25/06/2065                                    | 51                                  | 50                               | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/09/2046                                     | 140                                 | 139                              | 0,00                      | 3,824 % éch. 25/03/2047                           | 217                                 | 109                              | 0,00                      |
| <b>Banc of America Alternative Loan Trust</b>              |                                     |                                  |                           | 4,174 % éch. 20/03/2046                                     | 62                                  | 59                               | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/12/2034                           | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2046                                    | 66                                  | 58                               | 0,00                      | 4,174 % éch. 20/05/2046                                     | 1 055                               | 961                              | 0,01                      | 4,479 % éch. 25/01/2036                           | 7                                   | 7                                | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2046                                    | 72                                  | 62                               | 0,00                      | 4,174 % éch. 20/07/2046                                     | 41                                  | 36                               | 0,00                      | 4,596 % éch. 25/11/2035                           | 26                                  | 25                               | 0,00                      |
| <b>Banc of America Funding Trust</b>                       |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/12/2046                                     | 1 366                               | 913                              | 0,01                      | 4,893 % éch. 25/04/2035                           | 12                                  | 11                               | 0,00                      |
| 4,174 % éch. 20/04/2047                                    | 181                                 | 157                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/06/2035                                     | 55                                  | 51                               | 0,00                      | 5,550 % éch. 25/04/2032                           | 15                                  | 15                               | 0,00                      |
| 4,343 % éch. 25/07/2037                                    | 179                                 | 172                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/04/2036                                     | 2 878                               | 939                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/02/2036                           | 115                                 | 101                              | 0,00                      |
| 4,488 % éch. 20/09/2047                                    | 57                                  | 50                               | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/07/2035                                     | 42                                  | 39                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/03/2036                           | 29                                  | 26                               | 0,00                      |
| 4,563 % éch. 25/05/2037                                    | 46                                  | 43                               | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/08/2035                                     | 60                                  | 59                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/01/2037                           | 85                                  | 49                               | 0,00                      |
| 4,727 % éch. 20/01/2047                                    | 154                                 | 135                              | 0,00                      | 4,418 % éch. 20/11/2035                                     | 205                                 | 195                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2036                           | 337                                 | 131                              | 0,00                      |
| 4,970 % éch. 20/09/2035                                    | 50                                  | 41                               | 0,00                      | 4,978 % éch. 25/05/2036                                     | 102                                 | 100                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/09/2036                           | 233                                 | 89                               | 0,00                      |
| 5,750 % éch. 25/03/2036                                    | 40                                  | 33                               | 0,00                      | 5,224 % éch. 25/01/2036                                     | 220                                 | 213                              | 0,00                      | <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>             |                                     |                                  |                           |
| <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                      |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 25/06/2035                                     | 164                                 | 119                              | 0,00                      | 4,234 % éch. 19/06/2035                           | 104                                 | 103                              | 0,00                      |
| 4,288 % éch. 25/02/2036                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/02/2035                                     | 674                                 | 622                              | 0,01                      | 4,237 % éch. 19/06/2036                           | 151                                 | 56                               | 0,00                      |
| 5,438 % éch. 25/07/2035                                    | 4                                   | 3                                | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                     | 1 576                               | 813                              | 0,01                      | 4,294 % éch. 19/03/2035                           | 16                                  | 15                               | 0,00                      |
| 5,616 % éch. 25/01/2035                                    | 20                                  | 19                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/12/2035                                     | 456                                 | 264                              | 0,00                      | 4,374 % éch. 19/11/2035                           | 72                                  | 46                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/10/2036                                    | 16                                  | 14                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/05/2036                                     | 301                                 | 95                               | 0,00                      | 4,454 % éch. 19/01/2035                           | 167                                 | 159                              | 0,00                      |
| <b>BCAP LLC Trust</b>                                      |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/01/2035                                     | 107                                 | 106                              | 0,00                      | 4,643 % éch. 19/08/2036                           | 33                                  | 26                               | 0,00                      |
| 1,466 % éch. 26/05/2037                                    | 3 286                               | 3 256                            | 0,04                      | 5,750 % éch. 25/07/2037                                     | 313                                 | 172                              | 0,00                      | 5,133 % éch. 19/08/2036                           | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/05/2047                                    | 131                                 | 121                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2035                                     | 4 173                               | 1 732                            | 0,02                      | <b>HomeBanc Mortgage Trust</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 5,063 % éch. 25/09/2047                                    | 39                                  | 36                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2036                                     | 129                                 | 57                               | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/03/2035                           | 62                                  | 51                               | 0,00                      |
| 6,250 % éch. 26/08/2036                                    | 1 841                               | 621                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/03/2036                                     | 332                                 | 139                              | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/01/2036                           | 48                                  | 47                               | 0,00                      |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>         |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/08/2036                                     | 189                                 | 101                              | 0,00                      | <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>       |                                     |                                  |                           |
| 4,056 % éch. 25/05/2034                                    | 15                                  | 14                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2037                                     | 418                                 | 340                              | 0,01                      | 4,203 % éch. 25/11/2035                           | 1 041                               | 973                              | 0,01                      |
| 4,073 % éch. 25/07/2036                                    | 14                                  | 12                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                                     | 1 990                               | 660                              | 0,01                      | <b>Impac Secured Assets Trust</b>                 |                                     |                                  |                           |
| 4,095 % éch. 25/06/2047                                    | 77                                  | 69                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2037                                     | 485                                 | 150                              | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/05/2037                           | 30                                  | 25                               | 0,00                      |
| 4,329 % éch. 25/02/2036                                    | 24                                  | 22                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                     | 1 398                               | 572                              | 0,01                      | <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                |                                     |                                  |                           |
| 4,590 % éch. 25/03/2035                                    | 17                                  | 16                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                     | 191                                 | 73                               | 0,00                      | 3,077 % éch. 25/06/2037                           | 37                                  | 31                               | 0,00                      |
| 4,786 % éch. 25/01/2035                                    | 71                                  | 69                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2037                                     | 201                                 | 89                               | 0,00                      | 3,272 % éch. 25/07/2037                           | 43                                  | 27                               | 0,00                      |
| 4,974 % éch. 25/01/2035                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                                     | 40                                  | 19                               | 0,00                      | 3,372 % éch. 25/06/2036                           | 93                                  | 77                               | 0,00                      |
| 5,040 % éch. 25/07/2034                                    | 11                                  | 11                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2047                                     | 306                                 | 144                              | 0,00                      | 3,609 % éch. 25/08/2035                           | 486                                 | 349                              | 0,01                      |
| 5,528 % éch. 25/06/2035                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/02/2047                                     | 238                                 | 92                               | 0,00                      | 3,822 % éch. 25/12/2036                           | 46                                  | 35                               | 0,00                      |
| 5,778 % éch. 25/10/2035                                    | 16                                  | 16                               | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/12/2036                                     | 238                                 | 92                               | 0,00                      | 3,827 % éch. 25/11/2035                           | 24                                  | 17                               | 0,00                      |
| 6,273 % éch. 25/12/2046                                    | 43                                  | 37                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2032                                     | 7                                   | 7                                | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/07/2047                           | 142                                 | 94                               | 0,00                      |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                            |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/09/2037                                     | 8 790                               | 3 263                            | 0,04                      | 4,163 % éch. 25/06/2046                           | 909                                 | 840                              | 0,01                      |
| 3,533 % éch. 25/03/2036                                    | 171                                 | 91                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/11/2037                                     | 801                                 | 346                              | 0,01                      | 4,164 % éch. 25/05/2037                           | 105                                 | 90                               | 0,00                      |
| 4,050 % éch. 25/08/2036                                    | 231                                 | 102                              | 0,00                      | 7,836 % éch. 25/02/2036                                     | 215                                 | 166                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/07/2036                           | 4 207                               | 4 188                            | 0,05                      |
| 4,083 % éch. 25/01/2047                                    | 97                                  | 92                               | 0,00                      | <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>    |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/07/2035                           | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/04/2036                                    | 54                                  | 49                               | 0,00                      | 3,949 % éch. 25/09/2037                                     | 16                                  | 15                               | 0,00                      | 4,288 % éch. 25/03/2036                           | 377                                 | 286                              | 0,01                      |
| 4,231 % éch. 25/11/2036                                    | 202                                 | 107                              | 0,00                      | 3,991 % éch. 25/10/2035                                     | 127                                 | 105                              | 0,00                      | 4,331 % éch. 25/06/2035                           | 112                                 | 110                              | 0,00                      |
| 4,548 % éch. 25/05/2036                                    | 323                                 | 124                              | 0,00                      | 4,050 % éch. 25/03/2037                                     | 35                                  | 30                               | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/07/2035                           | 105                                 | 84                               | 0,00                      |
| 4,642 % éch. 25/09/2035                                    | 50                                  | 26                               | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/03/2036                                     | 78                                  | 74                               | 0,00                      | 4,731 % éch. 25/10/2034                           | 159                                 | 153                              | 0,00                      |
| 4,738 % éch. 25/07/2035                                    | 5 518                               | 5 542                            | 0,06                      | 4,303 % éch. 25/04/2046                                     | 7 069                               | 1 943                            | 0,02                      | <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>            |                                     |                                  |                           |
| <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>        |                                     |                                  |                           | 4,443 % éch. 25/03/2035                                     | 34                                  | 33                               | 0,00                      | 3,938 % éch. 25/05/2036                           | 136                                 | 69                               | 0,00                      |
| 4,750 % éch. 26/01/2036                                    | 59                                  | 41                               | 0,00                      | 4,614 % éch. 25/09/2047                                     | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/10/2036                           | 605                                 | 578                              | 0,01                      |
| <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                        |                                     |                                  |                           | 4,704 % éch. 25/04/2046                                     | 747                                 | 194                              | 0,00                      | 4,422 % éch. 25/05/2037                           | 125                                 | 108                              | 0,00                      |
| 4,040 % éch. 25/01/2036                                    | 133                                 | 119                              | 0,00                      | 4,994 % éch. 20/12/2035                                     | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,843 % éch. 26/05/2037                           | 1 150                               | 893                              | 0,01                      |
| 4,350 % éch. 25/03/2037                                    | 30                                  | 29                               | 0,00                      | 5,012 % éch. 20/11/2035                                     | 37                                  | 33                               | 0,00                      | <b>JPMorgan Mortgage Trust</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/02/2037                                    | 45                                  | 13                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/10/2034                                     | 279                                 | 277                              | 0,00                      | 3,894 % éch. 25/10/2036                           | 210                                 | 146                              | 0,00                      |
| 4,847 % éch. 25/03/2037                                    | 138                                 | 135                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/09/2035                                     | 70                                  | 69                               | 0,00                      | 4,599 % éch. 25/06/2037                           | 153                                 | 113                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/11/2036                                    | 56                                  | 22                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/10/2035                                     | 39                                  | 18                               | 0,00                      | 5,070 % éch. 25/11/2035                           | 92                                  | 67                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/03/2037                                    | 106                                 | 53                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                                     | 115                                 | 49                               | 0,00                      | 5,175 % éch. 25/11/2035                           | 76                                  | 62                               | 0,00                      |
| <b>ChaseFlex Trust</b>                                     |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/02/2037                                     | 348                                 | 222                              | 0,00                      | 5,285 % éch. 25/07/2035                           | 5                                   | 5                                | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/07/2037                                    | 124                                 | 112                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2037                                     | 29                                  | 11                               | 0,00                      | 5,349 % éch. 25/08/2035                           | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 6,300 % éch. 25/06/2036                                    | 44                                  | 38                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/09/2037                                     | 24                                  | 11                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2036                           | 94                                  | 43                               | 0,00                      |
| <b>Citicorp Mortgage Securities Trust</b>                  |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 25/09/2036                                     | 617                                 | 196                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/07/2036                           | 225                                 | 70                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/09/2037                                    | 15                                  | 15                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/11/2036                                     | 152                                 | 37                               | 0,00                      | <b>Lehman XS Trust</b>                            |                                     |                                  |                           |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b> |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/12/2036                           | 1 252                               | 1 304                            | 0,02                      |
| 3,817 % éch. 25/10/2046                                    | 41                                  | 38                               | 0,00                      | 5,149 % éch. 25/06/2033                                     | 7                                   | 7                                | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/03/2047                           | 2 911                               | 2 787                            | 0,03                      |
| 4,016 % éch. 25/09/2037                                    | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2036                                     | 191                                 | 124                              | 0,00                      | 4,213 % éch. 25/08/2046                           | 5 625                               | 5 970                            | 0,06                      |
| 4,445 % éch. 25/09/2037                                    | 49                                  | 48                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/04/2033                                     | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/09/2046                           | 8                                   | 26                               | 0,00                      |
| 4,490 % éch. 25/03/2037                                    | 2 281                               | 2 116                            | 0,02                      | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b> |                                     |                                  |                           | 4,283 % éch. 25/02/2046                           | 148                                 | 136                              | 0,00                      |
| 4,854 % éch. 25/07/2046                                    | 119                                 | 116                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                     | 690                                 | 293                              | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/08/2047                           | 312                                 | 298                              | 0,01                      |
| 5,750 % éch. 25/09/2035                                    | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                     | 163                                 | 50                               | 0,00                      | 5,463 % éch. 25/10/2037                           | 1 408                               | 1 390                            | 0,02                      |
| 6,028 % éch. 25/03/2034                                    | 2                                   | 1                                | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/02/2022                                     | 557                                 | 37                               | 0,00                      | <b>Luminent Mortgage Trust</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 6,160 % éch. 25/02/2034                                    | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 6,750 % éch. 25/08/2036                                     | 574                                 | 278                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/10/2046                           | 613                                 | 571                              | 0,01                      |
| 6,625 % éch. 25/09/2037                                    | 39                                  | 37                               | 0,00                      | 7,000 % éch. 25/08/2037                                     | 599                                 | 291                              | 0,01                      | <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>      |                                     |                                  |                           |
| <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>        |                                     |                                  |                           | 5,370 % éch. 21/11/2034                           | 28                                  | 28                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/01/2037                                    | 32                                  | 28                               | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/08/2047                                     | 68                                  | 65                               | 0,00                      | <b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b> |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/06/2037                                    | 399                                 | 359                              | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/02/2035                                     | 1 543                               | 1 467                            | 0,02                      | 3,983 % éch. 25/03/2037                           | 209                                 | 48                               | 0,00                      |
| <b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b> |                                     |                                  |                           | <b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>  |                                     |                                  |                           | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>     |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/05/2036                                    | 196                                 | 102                              | 0,00                      | 4,776 % éch. 25/06/2036                                     | 28                                  | 22                               | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/04/2029                           | 6                                   | 6                                | 0,00                      |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                  |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 25/08/2037                                     | 59                                  | 18                               | 0,00                      | 4,244 % éch. 25/03/2036                           | 239                                 | 106                              | 0,00                      |
| 3,934 % éch. 20/02/2047                                    | 124                                 | 101                              | 0,00                      |                                                             |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/11/2029                           | 1                                   | 1                                | 0,00                      |

[Voir les notes annexes](#)



## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                              | ACTIONS    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------|------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                            |            |                                  |                           |
| <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                                 |            |                                  |                           |
| PIMCO Funds: Global Investors<br>Series plc - Fonds US Short-<br>Term Fund (h)           | 33 669 354 | \$ 345 784                       | 3,65                      |
| PIMCO Select Funds<br>plc - Fonds PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating NAV<br>Fund (h) | 40 888 812 | 407 754                          | 4,29                      |
|                                                                                          |            | 753 538                          | 7,94                      |
| <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                                                          |            |                                  |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO<br>US Dollar Short Maturity<br>UCITS ETF (h)                | 1 726 946  | 173 524                          | 1,83                      |
| <b>Total des Fonds d'investissement</b>                                                  |            | <b>\$ 927 062</b>                | <b>9,77</b>               |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                                 | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                 | Garantie<br>(reçue) | Contrats de<br>mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOS                                          | 3,660 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 73 800               | Billets du Trésor américain 0,375 % échéance<br>30/09/2027                  | \$ (75 325)         | \$ 73 800                                         | \$ 73 808                                                                      | 0,77                   |
| CEW                                          | 2,240           | 18/06/2026           | 02/07/2026         | CAD 90 000              | Province de l'Ontario 3,750 % - 4,600 %<br>échéance 02/12/2053 - 02/12/2055 | (65 009)            | 63 436                                            | 63 487                                                                         | 0,67                   |
| FICC                                         | 3,620           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 8 300                | Billets du Trésor américain 3,750 % échéance<br>15/05/2028                  | (8 466)             | 8 300                                             | 8 301                                                                          | 0,09                   |
| <b>Total des Contrats de mise en pension</b> |                 |                      |                    |                         |                                                                             | <b>\$ (148 800)</b> | <b>\$ 145 536</b>                                 | <b>\$ 145 596</b>                                                              | <b>1,53</b>            |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026              | 494                   | \$ 529                                  | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026              | 426                   | 349                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Long  | 09/2026              | 2 635                 | 1 202                                   | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 935                   | 1 537                                   | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 110                   | 284                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 450                   | (238)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026              | 1 776                 | 165                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 3 372                 | (442)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 8 496                 | 1 779                                   | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 4 638                 | 2 565                                   | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 4 630                 | 5 488                                   | 0,06                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 3 532                 | 8 114                                   | 0,09                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026              | 1 346                 | 3 823                                   | 0,04                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | <b>\$ 25 155</b>                        | <b>0,27</b>            |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>                 |       |                      |                       | <b>\$ 25 155</b>                        | <b>0,27</b>            |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence                 | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| AT&T, Inc.                          | 1,000 %                 | 20/06/2028         | \$ 4 400                            | \$ 75                                   | 0,00                   |
| Boeing Co.                          | 1,000                   | 20/12/2026         | 500                                 | 4                                       | 0,00                   |
| Boeing Co.                          | 1,000                   | 20/06/2027         | 1 200                               | 6                                       | 0,00                   |
| Carnival Corp.                      | 1,000                   | 20/12/2028         | 6 200                               | 1 489                                   | 0,01                   |
| Charter Communications, Inc.        | 5,000                   | 20/12/2027         | 11 800                              | (200)                                   | 0,00                   |
| Ford Motor Credit Co. LLC           | 5,000                   | 20/06/2027         | 6 900                               | (233)                                   | 0,00                   |
| General Electric Co.                | 1,000                   | 20/12/2026         | 4 300                               | (29)                                    | 0,00                   |
| Glencore Finance Europe Ltd.        | 5,000                   | 20/06/2031         | 10 000                              | (5)                                     | 0,00                   |
| Glencore Finance Europe Ltd.        | 5,000                   | 20/12/2031         | 800                                 | 14                                      | 0,00                   |
| Marks & Spencer PLC                 | 1,000                   | 20/12/2028         | 11 000                              | 1 034                                   | 0,01                   |
| Oracle Corp.                        | 1,000                   | 20/12/2030         | 14 700                              | (148)                                   | 0,00                   |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000                   | 20/06/2029         | 7 200                               | 41                                      | 0,00                   |
|                                     |                         |                    |                                     | <b>\$ 2 048</b>                         | <b>0,02</b>            |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/06/2031      | \$ 88 550                        | \$ 320                            | 0,00                |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 148 764                          | 844                               | 0,01                |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                | 20/06/2031      | 556 677                          | 9 159                             | 0,10                |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2030      | 238 885                          | 87                                | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 956 945                          | 2 310                             | 0,02                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 12 720                         | 0,13                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  |                                   | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice de taux variable                            |                                   |           |                 |                   |                                   |                     |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250 %   | 19/03/2035      | \$ 114 700        | \$ (1 734)                        | (0,02)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2035      | 79 900            | 683                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2055      | 77 000            | (138)                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 2 600             | 103                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 13 669            | 253                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 517 200           | 9 677                             | 0,10                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2031      | 175 400           | 6 976                             | 0,08                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 122 500           | 2 765                             | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,874     | 05/03/2035      | 5 500             | 59                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,884     | 25/03/2035      | 5 900             | 57                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,899     | 11/03/2035      | 5 600             | 49                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 12/03/2035      | 5 300             | 42                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,908     | 04/03/2035      | 2 300             | 19                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 24/03/2035      | 10 900            | 67                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      | 7 100             | 18                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 270 600           | 1 338                             | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,221     | 15/11/2052      | 118 375           | (148)                             | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 12,820    | 02/01/2029      | BRL 113 100       | (537)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 12,867    | 02/01/2031      | 184 400           | (1 152)                           | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 12,905    | 02/01/2029      | 24 900            | (119)                             | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,015    | 02/01/2031      | 95 500            | (495)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an                   | 13,245    | 02/01/2031      | 17 700            | (67)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an                   | 13,255    | 02/01/2031      | 138 200           | (486)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,258    | 02/01/2029      | 221 500           | (734)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,291    | 02/01/2029      | 251 700           | (1 118)                           | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,310    | 02/01/2029      | 52 600            | (186)                             | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,320    | 02/01/2029      | 201 600           | (740)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,435    | 02/01/2031      | 24 100            | (68)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,440    | 02/01/2031      | 24 200            | (68)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an                   | 13,560    | 02/01/2031      | 18 000            | (40)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,681    | 02/01/2031      | 75 400            | (122)                             | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,725    | 02/01/2031      | 5 100             | (7)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,926    | 04/01/2027      | 42 200            | (67)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,927    | 04/01/2027      | 380 300           | (601)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 19/06/2029      | CAD 91 700        | 2 776                             | 0,03                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR 110 700       | (60)                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | AUD 81 800        | (2 746)                           | (0,03)              |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,750     | 20/12/2033      | 285 000           | (1 981)                           | (0,02)              |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois               | 3,365     | 28/11/2029      | CZK 512 000       | 79                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | PRIBOR CZK à 6 mois               | 3,575     | 03/07/2030      | 460 236           | (319)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 189 025         | (179)                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,350     | 29/04/2030      | 4 400             | 75                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 87 440            | (903)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 54 330            | 62                                | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 10 283                         | 0,11                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 25 051                         | 0,26                |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

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

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

#### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| MYI          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | HUF 378,000     | 26/11/2026        | 8 333                            | \$ (106) | \$ (69)      | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                    | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/reçues | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement brésilien    | 1,000 %              | 20/12/2028      | \$ 23 600                        | \$ (466)             | \$ 631                            | \$ 165       | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/06/2028      | 22 000                           | (1 915)              | 2 144                             | 229          | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement brésilien    | 1,000                | 20/12/2028      | 23 700                           | (458)                | 624                               | 166          | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/12/2026      | 7 800                            | 174                  | (10)                              | 164          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/06/2027      | 800                              | 9                    | 19                                | 28           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement indonésien   | 1,000                | 20/06/2031      | 61 600                           | (2 646)              | 2 956                             | 310          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen     | 1,000                | 20/12/2030      | 7 450                            | (92)                 | 157                               | 65           | 0,00                |
| CBK          | Petroleos Mexicanos                                    | 1,000                | 20/12/2026      | 2 200                            | (21)                 | 23                                | 2            | 0,00                |
| DUB          | Eskom                                                  | 4,650                | 30/06/2029      | 4 583                            | 0                    | 235                               | 235          | 0,01                |
| GST          | ADLER Real Estate AG                                   | 5,000                | 20/12/2026      | € 7 400                          | (47)                 | 184                               | 137          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/06/2027      | \$ 3 200                         | (288)                | 401                               | 113          | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/06/2027      | 900                              | 12                   | 20                                | 32           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien   | 5,000                | 20/06/2027      | 2 300                            | 76                   | 11                                | 87           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen     | 1,000                | 20/12/2030      | 7 800                            | (99)                 | 167                               | 68           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc         | 1,000                | 20/12/2029      | 8 100                            | (602)                | 419                               | (183)        | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/12/2026      | 3 675                            | 80                   | (3)                               | 77           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/06/2027      | 15 000                           | (14)                 | 544                               | 530          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/06/2028      | 22 400                           | (1 303)              | 1 536                             | 233          | 0,00                |
|              |                                                        |                      |                 |                                  | \$ (7 600)           | \$ 10 058                         | \$ 2 458     | 0,03                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/reçues | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 7 700                          | \$ 1 754             | \$ (115)                          | \$ 1 639     | 0,02                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 960                              | 220                  | (16)                              | 204          | 0,00                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 060                            | 467                  | (29)                              | 438          | 0,00                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 6 100                            | 1 278                | 20                                | 1 298        | 0,01                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 16 010                           | 3 510                | (103)                             | 3 407        | 0,04                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 7 229             | \$ (243)                          | \$ 6 986     | 0,07                |

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

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

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 101 617           | \$ 72 664          | \$ 2 265              | \$ 2 265                                | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH             | 5 621             | 832                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 39 929            | 23 581             | 868                   | 868                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 206               | 161                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 18 753            | 33 197             | 131                   | 131                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 33 197            | 18 774             | 0                     | (131)                                   | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 21 615            | 4 159              | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 2 295             | 3 066              | 19                    | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 530             | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 542 997           | 357                | 6                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 14 240            | 1 440              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 65                | 51                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 114             | 1 555              | 0                     | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 592             | 31 051             | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 520               | 82 727             | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 209             | 29 811             | 0                     | (196)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 497               | 1 877              | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 7 357             | 2 473              | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 4 039             | 21 151             | 15                    | 15                                      | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 08/2026           | ZAR             | 170 515           | \$ 9 789           | \$ 0                  | \$ (574)                                | (0,01)              |
|              | 09/2026           | COP             | 67 429 857        | 17 928             | 13                    | (1 306)                                 | (0,01)              |
|              | 09/2026           | KZT             | 225 905           | 449                | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 105 220           | 6 031              | 52                    | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 327             | 221 192            | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 73 564            | \$ 14 430          | 227                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 3 907             | 4 967              | 123                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 33 317            | 4 923              | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 5 702             | 274                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 1 436 956         | 1 673 557          | 30 825                | (139)                                   | 0,32                |
|              | 07/2026           | IDR             | 533 684 085       | 29 781             | 25                    | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 11 078            | 3 759              | 39                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 999 841           | 10 410             | 0                     | (153)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 2 362 326         | 1 549              | 23                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 3 270             | 332                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 137 241           | 4 184              | 56                    | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 880             | AUD 4 179          | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 647               | BRL 3 264          | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 107             | CAD 1 576          | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 850             | € 5 944            | 16                    | (70)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 080             | £ 3 813            | 7                     | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 28 995            | INR 2 749 508      | 62                    | (53)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 032             | ¥ 649 814          | 0                     | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 976             | KRW 10 701 404     | 0                     | (63)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 827               | KWD 253            | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 121               | PLN 453            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 270             | TWD 71 635         | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 147 454           | \$ 8 988           | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 809             | 607                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 4 108             | BRL 20 920         | 0                     | (97)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 27 764 689        | \$ 7 620           | 0                     | (294)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 63 093 122        | 3 475              | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 126 546           | 3 901              | 68                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 19 757            | IDR 349 738 235    | 23                    | (393)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 470             | INR 139 633        | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 788               | THB 25 820         | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 2 240             | IDR 40 778 718     | 6                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 05/2030           | KWD             | 4 881             | \$ 16 809          | 861                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS             | 13 551            | 4 579              | 28                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 202 179           | 1 251              | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 56 280            | 33 283             | 1 268                 | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 20 050            | TRY 953 823        | 189                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 728 240           | \$ 44 835          | 473                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 251             | ¥ 201 649          | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
| BSH          | 12/2026           | ZAR             | 7 627             | \$ 433             | 0                     | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 95 504            | 28 298             | 317                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 42 028            | € 36 131           | 0                     | (719)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 4 487             | ¥ 713 346          | 0                     | (97)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 32 488            | NZD 57 501         | 221                   | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 08/2026           | NZD             | 57 501            | \$ 32 525          | 0                     | (221)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 7 229 804         | 1 894              | 0                     | (198)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 12 352            | 4 252              | 104                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 686 429           | 7 275              | 24                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 16 700            | 1 800              | 113                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 6 100             | 660                | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 843             | AUD 2 608          | 0                     | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 092             | COP 10 735 411     | 21                    | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 21 207            | € 18 250           | 0                     | (342)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 058             | £ 789              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 479             | HUF 757 827        | 0                     | (46)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 676             | IDR 101 839 479    | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 084             | INR 686 429        | 168                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 780               | KRW 1 179 875      | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 286             | PEN 14 485         | 0                     | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 837               | PLN 3 060          | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 811               | TWD 25 658         | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 27 948            | \$ 9 756           | 367                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 474             | ILS 4 377          | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 165 640 832       | \$ 42 782          | 0                     | (4 431)                                 | (0,05)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 229 530 977       | 12 714             | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 69 504            | 723                | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 471 725           | 935                | 0                     | (27)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 149 610           | 4 518              | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4 106             | IDR 73 226 083     | 0                     | (47)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 44                | INR 4 199          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 5 160 077         | \$ 1 466           | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 14 546            | 4 286              | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 5 867 845         | 1 626              | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 14 713            | 4 301              | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 5 131             | COP 20 301 847     | 532                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 12/2026           |                 | 7 038             | IDR 127 955 344    | 7                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |             | Devise à recevoir |             | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|-------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| DUB          | 07/2026           | CZK             | 6 162       | \$                | 296         | \$ 6               | \$ 0                  | \$ 6                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | IDR             | 13 583 550  |                   | 759         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | INR             | 206 095     |                   | 2 182       | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 4           |                   | 3           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 456       | INR               | 140 482     | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 6 898       | KZT               | 3 702 281   | 788                | 0                     | 788                                     | 0,01                |      |
|              | 07/2026           |                 | 786         | NOK               | 7 305       | 0                  | (48)                  | (48)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 836         | PLN               | 3 104       | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | ZAR             | 338 636     | \$                | 20 919      | 290                | 0                     | 290                                     | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | PEN             | 12 578      |                   | 3 722       | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | \$              | 476         | KZT               | 254 918     | 52                 | 0                     | 52                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 134 898 225 | \$                | 7 487       | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | \$              | 2 520       | IDR               | 45 764 336  | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           |                 | 2 182       | INR               | 207 492     | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | UZS             | 20 234 470  | \$                | 1 588       | 0                  | (80)                  | (80)                                    | 0,00                |      |
|              | 10/2026           |                 | 39 446 963  |                   | 3 106       | 0                  | (132)                 | (132)                                   | 0,00                |      |
|              | 12/2026           |                 | 26 478 694  |                   | 2 038       | 0                  | (118)                 | (118)                                   | 0,00                |      |
|              | 12/2026           | ZAR             | 10 173      |                   | 577         | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |      |
|              | FAR               | 07/2026         | CNH         | 33 145            |             | 4 899              | 16                    | 0                                       | 16                  | 0,00 |
| 07/2026      |                   | £               | 197 944     |                   | 265 963     | 3 242              | 0                     | 3 242                                   | 0,03                |      |
| 07/2026      |                   | INR             | 424 740     |                   | 4 502       | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | ¥               | 4 585 503   |                   | 28 341      | 126                | 0                     | 126                                     | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | PEN             | 30 023      |                   | 8 922       | 126                | 0                     | 126                                     | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | SGD             | 115 652     |                   | 90 653      | 1 239              | 0                     | 1 239                                   | 0,01                |      |
| 07/2026      |                   | \$              | 14 249      | CNH               | 96 923      | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 1 727       | €                 | 1 514       | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 4 451       | INR               | 424 740     | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 5 099       | ¥                 | 810 307     | 0                  | (114)                 | (114)                                   | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 12 304      | PLN               | 44 994      | 0                  | (334)                 | (334)                                   | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 374         | SEK               | 3 631       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | ZAR             | 482 422     | \$                | 29 233      | 0                  | (155)                 | (155)                                   | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | CNH             | 96 710      |                   | 14 249      | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | COP             | 9 274 363   |                   | 2 457       | 0                  | (213)                 | (213)                                   | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | €               | 1 514       |                   | 1 729       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | ILS             | 18 852      |                   | 6 585       | 252                | 0                     | 252                                     | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | PEN             | 25 623      |                   | 7 579       | 74                 | 0                     | 74                                      | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | SEK             | 3 624       |                   | 374         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | \$              | 6           | £                 | 4           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   |                 | 28 341      | ¥                 | 4 573 504   | 0                  | (127)                 | (127)                                   | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | PEN             | 122 501     | \$                | 35 634      | 0                  | (182)                 | (182)                                   | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | \$              | 2 175       | INR               | 208 404     | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |      |
| GLM          |                   | 07/2026         | BRL         | 163 720           | \$          | 31 775             | 144                   | 0                                       | 144                 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | COP         | 213 668           |             | 56                 | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | KRW         | 2 161 432         |             | 1 400              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | \$          | 49 259            | BRL         | 255 024            | 733                   | (721)                                   | 12                  | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         |             | 1 306             | COP         | 4 580 646          | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         |             | 5 568             | IDR         | 99 839 171         | 16                    | 0                                       | 16                  | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         |             | 1 400             | KRW         | 2 161 124          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         |             | 3 201             | KZT         | 1 722 819          | 389                   | 0                                       | 389                 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         |             | 959               | TRY         | 45 624             | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00 |
|              |                   | 08/2026         |             | 6 679             | BRL         | 34 133             | 0                     | (136)                                   | (136)               | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 1 166       | INR               | 111 799     | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | ZAR             | 90 208      | \$                | 5 060       | 0                  | (428)                 | (428)                                   | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 100 423 840 |                   | 5 568       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | MXN             | 3 214       |                   | 185         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | THB             | 414 843     |                   | 12 855      | 289                | 0                     | 289                                     | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | \$              | 40 669      | BRL               | 211 943     | 0                  | (328)                 | (328)                                   | 0,00                |      |
|              | 09/2026           |                 | 11 764      | IDR               | 211 238 699 | 24                 | (79)                  | (55)                                    | 0,00                |      |
|              | 09/2026           |                 | 5 694       | INR               | 547 842     | 56                 | 0                     | 56                                      | 0,00                |      |
|              | 09/2026           |                 | 39 783      | MXN               | 698 112     | 0                  | (83)                  | (83)                                    | 0,00                |      |
|              | 11/2026           | COP             | 4 716 553   | \$                | 1 306       | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |      |
|              | JPM               | 07/2026         | AUD         | 414 590           |             | 295 524            | 8 296                 | 0                                       | 8 296               | 0,09 |
|              |                   | 07/2026         | ILS         | 34 734            |             | 11 633             | 0                     | (27)                                    | (27)                | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | INR         | 224 995           |             | 2 383              | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | KRW         | 667 896           |             | 432                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | NOK         | 15 195            |             | 1 535              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | NZD             | 2 597       |                   | 1 534       | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | \$              | 12          | CHF               | 9           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 4 283       | £                 | 3 192       | 0                  | (47)                  | (47)                                    | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 25 733      | HUF               | 7 792 900   | 0                  | (710)                 | (710)                                   | (0,01)              |      |
| 07/2026      |                   |                 | 826         | IDR               | 14 855 605  | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 2 385       | INR               | 224 995     | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 653         | KRW               | 1 003 163   | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 1 935       | NZD               | 3 432       | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   |                 | 25 754      | PLN               | 93 878      | 1                  | (781)                 | (780)                                   | (0,01)              |      |
| 07/2026      |                   |                 | 3 008       | THB               | 100 554     | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |      |
| 07/2026      |                   | ZAR             | 202 890     | \$                | 12 486      | 126                | 0                     | 126                                     | 0,00                |      |
| 08/2026      |                   | ILS             | 52 822      |                   | 18 236      | 491                | 0                     | 491                                     | 0,01                |      |
| 08/2026      |                   | \$              | 1 535       | NOK               | 15 202      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | IDR             | 15 452 045  | \$                | 855         | 1                  | (2)                   | (1)                                     | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | KZT             | 1 602 742   |                   | 3 173       | 0                  | (94)                  | (94)                                    | 0,00                |      |
| 09/2026      |                   | MXN             | 26 129      |                   | 1 482       | 1                  | (5)                   | (4)                                     | 0,00                |      |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |             | Devise à recevoir |             | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|-------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 09/2026           | THB             | 315 785     | \$                | 9 681       | \$ 147             | \$ (31)               | \$ 116                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 68 841      | BRL               | 354 291     | 0                  | (1 407)               | (1 407)                                 | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | 13 870      | INR               | 1 322 390   | 11                 | (5)                   | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 6 205       | MXN               | 108 354     | 0                  | (43)                  | (43)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 7 386 331   | \$                | 583         | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 37 571      | MXN               | 658 994     | 0                  | (364)                 | (364)                                   | 0,00                |
|              | 06/2027           | UZS             | 2 828 286   | \$                | 210         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 828       |                   | 1 309       | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 90 077      |                   | 64 227      | 737                | 0                     | 737                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF             | 10 765      |                   | 13 469      | 162                | (38)                  | 124                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 8 842 137   |                   | 2 334       | 0                  | (219)                 | (219)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 21 851      |                   | 25 280      | 298                | 0                     | 298                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 1 373 435   |                   | 77          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 206 909     |                   | 2 191       | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 9 346 285   |                   | 6 166       | 129                | 0                     | 129                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 5 027       |                   | 508         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 13 027      | AUD               | 18 533      | 19                 | (206)                 | (187)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 546 059   | €                 | 1 361 018   | 10 120             | (126)                 | 9 994                                   | 0,11                |
|              | 07/2026           |                 | 14 218      | £                 | 10 567      | 0                  | (193)                 | (193)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 378       | INR               | 325 622     | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 037       | ¥                 | 800 623     | 0                  | (111)                 | (111)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 872       | NOK               | 17 361      | 0                  | (118)                 | (118)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 638       | NZD               | 4 676       | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 228         | SEK               | 2 217       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 1 349 344   | \$                | 1 534 653   | 0                  | (10 118)              | (10 118)                                | (0,11)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 744         |                   | 249         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| 08/2026      | SEK               | 2 213           |             | 228               | 0           | (1)                | (1)                   | 0,00                                    |                     |
| 08/2026      | \$                | 3 147           | €           | 2 756             | 8           | 0                  | 8                     | 0,00                                    |                     |
| MYI          | 08/2026           |                 | 128         | NOK               | 1 273       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 646       | \$                | 150         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 87 654      |                   | 2 625       | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 7 870       | INR               | 752 668     | 35                 | (11)                  | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 256         | \$                | 176         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 53          |                   | 70          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 13          |                   | 10          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 25          | AUD               | 36          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 53 306      | €                 | 46 191      | 7                  | (502)                 | (495)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 5 672       | £                 | 4 267       | 8                  | (17)                  | (9)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 5 696       | ILS               | 16 313      | 0                  | (220)                 | (220)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | HUF             | 549 234     | €                 | 1 524       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$              | 4 272       | PEN               | 14 713      | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 14 713      | \$                | 4 268       | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 183       | IDR               | 92 413 205  | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 416       | INR               | 328 647     | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           |                 | 3 140       | TRY               | 147 614     | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 92 931 478  | \$                | 5 183       | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 512       | IDR               | 44 706 137  | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 5 316       | \$                | 6 180       | 102                | 0                     | 102                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 406       | £                 | 1 045       | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 920       | IDR               | 34 456 858  | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 4 496       | INR               | 430 941     | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 898       |                   | 277 689     | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 108         | KZT               | 56 452      | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 104 992 480 | \$                | 5 816       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 73 957      |                   | 147         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 147 950     |                   | 4 582       | 100                | 0                     | 100                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 6 405       | IDR               | 114 984 422 | 8                  | (40)                  | (32)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN             | 1 205 094   | \$                | 745         | 0                  | (83)                  | (83)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 55 886      |                   | 8 261       | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 4           |                   | 6           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 170         |                   | 132         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 152 609     | AUD               | 221 172     | 619                | 0                     | 619                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 25          | CAD               | 34          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 203       | CHF               | 973         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           |                 | 1 347       | €                 | 1 155       | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 895      | ¥                 | 1 730 852   | 0                  | (245)                 | (245)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 89 651      | SGD               | 116 098     | 107                | 0                     | 107                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 221 172     | \$                | 152 511     | 0                  | (627)                 | (627)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CHF             | 970         |                   | 1 203       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT             | 365 647     |                   | 747         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 115 837     |                   | 89 651      | 0                  | (112)                 | (112)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 6           | £                 | 4           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 132         | SGD               | 170         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 79 124      | \$                | 57 381      | 1 610              | 0                     | 1 610                                   | 0,02                |
| UAG          | 07/2026           | CHF             | 33 199      |                   | 42 234      | 1 077              | 0                     | 1 077                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 3 371       |                   | 3 832       | 0                  | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 237 577     | £                 | 179 729     | 969                | 0                     | 969                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | £               | 179 729     | \$                | 237 572     | 0                  | (968)                 | (968)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 851         | PLN               | 3 111       | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 10 848 386  | \$                | 2 872       | 0                  | (250)                 | (250)                                   | 0,00                |
| 09/2026      |                   | 305 349 284     |             | 78 989            | 0           | (8 043)            | (8 043)               | (0,09)                                  |                     |

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| WST          | 09/2026           | MXN             | 11 296 \$         | 644                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 16 783            | 511                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 58 075 CHF        | 46 889             | 53                    | 53                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 46 721 \$         | 58 075             | 0                     | (54)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 73 546          | \$ (39 589)           | \$ 33 957                               | 0,36                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie M Détail en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 6 750 \$          | 4 654              | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 9 069 AUD         | 12 735             | 0                     | (246)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 4 637             | 6 730              | 23                    | 23                                      | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           |                 | 23                | 32                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 284 \$            | 199                | 3                     | (1)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$              | 59 AUD            | 84                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1                 | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 1                 | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 6 987 \$          | 4 853              | 13                    | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$              | 7 243 AUD         | 10 163             | 0                     | (202)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 4 850             | 6 987              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 1 583 \$          | 1 130              | 34                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 41 AUD            | 58                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           |                 | 986               | 1 381              | 0                     | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 6 809 \$          | 4 729              | 11                    | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$              | 9 430 AUD         | 13 220             | 0                     | (272)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 4 726             | 6 809              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 11 567 \$         | 8 092              | 78                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 8 043 AUD         | 11 505             | 0                     | (77)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 6 942 \$          | 4 783              | 2                     | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 440 AUD           | 623                | 1                     | (9)                                     | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           |                 | 4 832             | 7 022              | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 295 \$            | 207                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           |                 | 264               | 188                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 264 AUD         | 3 184              | 0                     | (58)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 77                | 53                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   | \$ 202             | \$ (972)              | \$ (770)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD             | 54 457 \$         | 38 309             | 0                     | (74)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 38 309 CAD        | 54 380             | 75                    | 75                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 67 172            | 92 877             | 0                     | (1 708)                                 | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 66                | 92                 | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CAD             | 95 586 \$         | 67 172             | 0                     | (201)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 67 172 CAD        | 95 450             | 201                   | 201                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 70 558            | 97 408             | 0                     | (1 901)                                 | (0,02)              |
|              | 07/2026           | CAD             | 32 212 \$         | 22 723             | 18                    | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | \$              | 70 354 CAD        | 97 014             | 0                     | (1 974)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           |                 | 22 723            | 32 166             | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 294             | \$ (5 878)            | \$ (5 584)                              | (0,06)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation, W en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 65 CHF            | 53                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 64                | 51                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 63                | 50                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 942             | 5 427              | 0                     | (215)                                   | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | CHF             | 29 \$             | 36                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 7 826 CHF         | 6 130              | 0                     | (226)                                   | (0,01)              |
| SOG          | 07/2026           | CHF             | 6 029 \$          | 7 452              | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 7 452 CHF         | 6 007              | 22                    | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           |                 | 7 511             | 5 904              | 0                     | (192)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 6 008 \$          | 7 441              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
| WST          | 07/2026           |                 | 7 441             | 5 986              | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   | \$ 29              | \$ (664)              | \$ (635)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation, T en EUR (couverte) de distribution, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 718           | \$ 836            | \$ 15              | \$ 0                  | \$ 15                                   | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 4 498         | \$ 5 122          | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 889 591      | € 763 588         | 0                  | (16 580)              | (16 580)                                | (0,17)              |
| BSH          | 07/2026           | € 2 718         | \$ 3 161          | 54                 | 0                     | 54                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 835 664      | € 716 733         | 0                  | (16 222)              | (16 222)                                | (0,17)              |
| CBK          | 07/2026           | € 1 467         | \$ 1 710          | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 20 854       | € 17 880          | 0                  | (412)                 | (412)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 708 955       | \$ 808 562        | 0                  | (1 987)               | (1 987)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 809 653      | € 708 955         | 1 981              | 0                     | 1 981                                   | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | € 781 803       | \$ 888 384        | 276                | (5 727)               | (5 451)                                 | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 160        | € 1 008           | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 142         | \$ 1 305          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 868 476      | € 763 607         | 5 725              | 0                     | 5 725                                   | 0,06                |
| SOG          | 07/2026           | € 763 607       | \$ 868 603        | 0                  | (4 429)               | (4 429)                                 | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 890 756      | € 763 588         | 0                  | (17 745)              | (17 745)                                | (0,19)              |
|              | 08/2026           | € 869 781       | \$ 763 607        | 4 419              | 0                     | 4 419                                   | 0,05                |
| SSB          | 07/2026           | \$ 1 104        | € 968             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 968           | \$ 1 105          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 12 506          | \$ (63 136)           | \$ (50 630)                             | (0,53)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de distribution, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 217 964      | £ 162 354         | \$ 0               | \$ (2 480)            | \$ (2 480)                              | (0,03)              |
| BOA          | 07/2026           | \$ 35           | £ 26              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 171 197       | \$ 225 782        | 4                  | (1 443)               | (1 439)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 351 252      | £ 262 001         | 0                  | (3 511)               | (3 511)                                 | (0,04)              |
|              | 08/2026           | £ 102           | \$ 135            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 225 374      | £ 170 897         | 1 444              | 0                     | 1 444                                   | 0,02                |
| CBK          | 07/2026           | £ 320           | \$ 429            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 1 387        | £ 1 835           | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 11 831       | £ 8 798           | 0                  | (154)                 | (154)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 1 835         | \$ 1 387          | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 235 035      | £ 175 157         | 0                  | (2 558)               | (2 558)                                 | (0,03)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 35            | \$ 47             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 932        | £ 3 730           | 20                 | (1)                   | 19                                      | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 38 267        | \$ 50 360         | 0                  | (429)                 | (429)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 50 359       | £ 38 267          | 429                | 0                     | 429                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 278 533       | \$ 368 109        | 2                  | (1 576)               | (1 574)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 263 070      | £ 198 762         | 730                | 0                     | 730                                     | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | £ 197 732       | \$ 261 204        | 0                  | (1 236)               | (1 236)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 261 197      | £ 197 732         | 1 237              | 0                     | 1 237                                   | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £ 102 673       | \$ 77 673         | 419                | 0                     | 419                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 77 673        | \$ 102 671        | 0                  | (419)                 | (419)                                   | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 297           | \$ (13 814)           | \$ (9 517)                              | (0,10)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en JPY (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 645          | ¥ 102 653         | \$ 0               | \$ (14)               | \$ (14)                                 | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$ 364          | ¥ 57 903          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ¥ 128 286       | \$ 794            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 794          | ¥ 127 949         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | ¥ 705           | \$ 112 054        | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 39            | \$ 6 267          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | ¥ 40 404        | \$ 250            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1            | ¥ 138             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RBC          | 08/2026           | ¥ 2             | \$ 244            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | ¥ 128 270       | \$ 794            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 432          | ¥ 68 616          | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 794           | \$ 127 934        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | ¥ 113 846       | \$ 703            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 463          | ¥ 73 581          | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 703           | \$ 113 549        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 12              | \$ (68)               | \$ (56)                                 | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en MXN (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | MXN             | \$                | 98 103             | 5 585                 | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | MXN               | 98 103             | 30                    | \$ (30)                                 | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | MXN             | \$                | 1 011 241          | 57 565                | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | MXN               | 1 011 241          | 309                   | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | MXN             | \$                | 918 032            | 52 225                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | MXN               | 57 370             | 996 500               | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 52 082             | 918 032               | 314                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           |                 |                   | 2 671              | 46 363                | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | MXN             | \$                | 1 014 944          | 57 787                | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | MXN               | 56 759             | 985 776               | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 55 619             | 980 244               | 327                                     | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           |                 |                   | 1 598              | 28 031                | 1                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           |                 |                   | 58 355             | 1 013 680             | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 1 010                                | 0,01                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (2 023)                              |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (1 013)                              |                     |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | SEK               | 7 085              | 65 521                | \$ 0                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 |                   | 7 748              | 71 594                | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SEK             | \$                | 42 335             | 4 363                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | SEK               | 4 363              | 42 260                | 12                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK             | \$                | 63 929             | 6 567                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | SEK               | 7 589              | 70 485                | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 6 565              | 63 803                | 39                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 51                                   | 0,01                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (1 022)                              |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (971)                                |                     |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Administration en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et W en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | SGD               | 61 260             | 78 118                | \$ 0                                    | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD             | \$                | 35 666             | 27 556                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | SGD               | 54 132             | 69 132                | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 27 556             | 35 584                | 18                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD             | \$                | 601                | 469                   | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | SGD               | 811                | 1 043                 | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD             | \$                | 43 351             | 33 427                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | SGD               | 62 558             | 79 810                | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 33 427             | 43 252                | 89                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SGD             | \$                | 268                | 209                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | SGD               | 133                | 171                   | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | SGD             | \$                | 463                | 357                   | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 |                   | 8 663              | 6 690                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | SGD               | 6 690              | 8 643                 | 7                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD             | \$                | 84 201             | 65 020                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | SGD               | 8 858              | 11 297                | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 65 020             | 84 012                | 81                                      | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           |                 |                   | 62                 | 80                    | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 202                                  | 0,03                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (2 726)                              |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (2 524)                              |                     |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (28 368) (0,30)

| DESCRIPTION                                                                              | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                                          |                               |                            |                     |
| ABH Financial Ltd, Via Alfa Holding Issuance PLC<br>2,700 % éch. 11/06/2023 ^            | €                             | 26 550                     | \$ 1 821 0,02       |
| ALROSA Finance S.A.<br>3,100 % éch. 25/06/2027 ^                                         | \$                            | 22 400                     | 1 344 0,01          |
| 4,650 % éch. 09/04/2024 ^                                                                |                               | 3 200                      | 192 0,00            |
| Credit Suisse AG AT1 Claim<br>MMK International Capital DAC<br>4,375 % éch. 13/06/2024 ^ |                               | 10 400                     | 3 666 0,04          |
|                                                                                          |                               | 8 600                      | 516 0,01            |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,125 % éch. 29/10/2022 ^                      |                               | 3 900                      | 234 0,00            |
| Total des Autres actifs financiers                                                       |                               | \$ 7 773                   | 0,08                |
| Total des Investissements                                                                |                               | \$ 10 236 841              | 107,93              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                   |                               | \$ (752 345)               | (7,93)              |
| Actif net                                                                                |                               | \$ 9 484 496               | 100,00              |

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

μ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

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

(h) Affilié au Fonds.

(i) Titre convertible conditionnel.

(j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,18 %) :

| Description de l'émetteur                                                   | Date d'achat | Coût       | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------|------------|--------------|---------------------|
| Banco Nacional de Mexico S.A., 6,697 % éch. 07/08/2036                      | 30/04/2026   | \$ 10 950  | \$ 10 798    | 0,11                |
| Corestate Capital Holding S.A.                                              | 22/08/2023   | 0          | 0            | 0,00                |
| DrillCo Holding Lux S.A.                                                    | 08/06/2023   | 8 869      | 10 162       | 0,11                |
| Flora Food Management BV 7,500 % éch. 31/10/2030                            | 20/01/2026   | 4 457      | 4 335        | 0,05                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït 4,804 % éch. 20/04/2033 | 13/04/2026   | 34 400     | 34 342       | 0,36                |
| Prime Property 4,920 % éch. 15/03/2031                                      | 23/03/2026   | 4 000      | 3 908        | 0,04                |
| Valerie Asset Ltd, 5,219 % éch. 15/09/2050                                  | 02/03/2026   | 38 932     | 39 192       | 0,41                |
| Valerie Asset Ltd, 5,267 % éch. 15/09/2050                                  | 02/03/2026   | 5 054      | 5 085        | 0,05                |
|                                                                             |              | \$ 106 662 | \$ 107 822   | 1,13                |

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 101 872 \$ (31 décembre 2025 : 97 413 \$) et un montant en numéraire de 737 \$ (31 décembre 2025 : 568 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 8 \$) et un montant en numéraire de 459 \$ (31 décembre 2025 : 269 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 232 566 \$ (31 décembre 2025 : 211 161 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 55 250 \$ (31 décembre 2025 : 11 460 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur         |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 298                                                                            | \$ 8 786 426                                         | \$ 347 908                                        | \$ 9 134 632         |
| Fonds d'investissement                        | 927 062                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 927 062              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 145 536                                              | 0                                                 | 145 536              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 7 652                                                                             | 13 951                                               | 235                                               | 21 838               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 7 773                                                | 0                                                 | 7 773                |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 935 012</b>                                                                 | <b>\$ 8 953 686</b>                                  | <b>\$ 348 143</b>                                 | <b>\$ 10 236 841</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur         |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 2                                                                              | \$ 10 173 987                                        | \$ 293 696                                        | \$ 10 467 685        |
| Fonds d'investissement                        | 1 001 809                                                                         | 0                                                    | 0                                                 | 1 001 809            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 100 591                                              | 0                                                 | 100 591              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (2 006)                                                                           | 35 875                                               | 374                                               | 34 243               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 7 745                                                | 2 286                                             | 10 031               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 999 805</b>                                                                 | <b>\$ 10 318 198</b>                                 | <b>\$ 296 356</b>                                 | <b>\$ 11 614 359</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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



## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                    | 1,850 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 839)        | \$ (2 104)                               | (0,02)              |
| BRC                                    | 1,950          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 719)          | (5 399)                                  | (0,06)              |
|                                        | 2,200          | 22/06/2026        | 31/07/2026         | \$ (2 399)       | (2 400)                                  | (0,02)              |
|                                        | 3,000          | 28/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (5 581)          | (5 597)                                  | (0,06)              |
|                                        | 3,400          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (13 949)         | (14 213)                                 | (0,15)              |
|                                        | 3,450          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (7 202)          | (7 341)                                  | (0,08)              |
| MSC                                    | 2,200          | 22/06/2026        | 31/07/2026         | (3 705)          | (3 707)                                  | (0,04)              |
| MYI                                    | 2,150          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 606)          | (2 608)                                  | (0,03)              |
|                                        | 3,470          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (14 765)         | (14 766)                                 | (0,16)              |
|                                        | 3,490          | 10/04/2026        | 09/04/2028         | (20 731)         | (20 895)                                 | (0,22)              |
|                                        | 3,500          | 12/12/2025        | 11/12/2027         | (6 666)          | (6 796)                                  | (0,07)              |
|                                        | 3,600          | 12/12/2025        | 11/12/2027         | (1 507)          | (1 538)                                  | (0,02)              |
| NOM                                    | 3,450          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 194)          | (4 275)                                  | (0,04)              |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                    |                  | \$ (91 639)                              | (0,97)              |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (450)                                                   | \$ 980                  | \$ 530                            | \$ 5 620                                                   | \$ (6 550)              | \$ (930)                          |
| BOA          | (1 036)                                                    | 1 120                   | 84                                | 2 541                                                      | (2 670)                 | (129)                             |
| BPS          | 9 515                                                      | (9 510)                 | 5                                 | (87)                                                       | 310                     | 223                               |
| BRC          | 2 499                                                      | (2 970)                 | (471)                             | 17 863                                                     | (19 450)                | (1 587)                           |
| BSH          | (16 868)                                                   | 17 780                  | 912                               | (49)                                                       | 0                       | (49)                              |
| CBK          | (4 108)                                                    | 4 350                   | 242                               | 3 436                                                      | (2 640)                 | 796                               |
| DUB          | 1 011                                                      | (1 190)                 | (179)                             | 278                                                        | (300)                   | (22)                              |
| FAR          | 2 387                                                      | (2 860)                 | (473)                             | (2 424)                                                    | 2 720                   | 296                               |
| GLM          | (103)                                                      | 0                       | (103)                             | 638                                                        | (720)                   | (82)                              |
| GST          | 1 548                                                      | (1 690)                 | (142)                             | 191                                                        | (290)                   | (99)                              |
| JPM          | 6 249                                                      | (7 930)                 | (1 681)                           | 1 152                                                      | (910)                   | 242                               |
| MBC          | 179                                                        | (60)                    | 119                               | (7 084)                                                    | 8 160                   | 1 076                             |
| MYC          | 840                                                        | (940)                   | (100)                             | 179                                                        | (260)                   | (81)                              |
| MYI          | (798)                                                      | 1 100                   | 302                               | 1 882                                                      | (2 150)                 | (268)                             |
| NSL          | 43                                                         | 0                       | 43                                | 318                                                        | 0                       | 318                               |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| RYL          | 5                                                          | 0                       | 5                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | (706)                                                      | 450                     | (256)                             | 140                                                        | 0                       | 140                               |
| SOG          | (20 419)                                                   | 20 870                  | 451                               | 12 684                                                     | (13 230)                | (546)                             |
| SSB          | 501                                                        | (600)                   | (99)                              | 585                                                        | (660)                   | (75)                              |
| UAG          | (8 656)                                                    | 8 600                   | (56)                              | (444)                                                      | 270                     | (174)                             |
| WST          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 253                                                        | (290)                   | (37)                              |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 32,47            | 34,56                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 35,28            | 36,43                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,79             | 0,66                 |
| Fonds d'investissement                                           | 6,96             | 6,86                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 1,09             | 0,69                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,19             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,30             | 0,12                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,76             | 0,55                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,06             | 0,07                 |
| Autres actifs                                                    | 22,10            | 20,05                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Angola                            | 0,35             | 0,18                 |
| Argentine                         | 1,11             | 1,08                 |
| Australie                         | 5,14             | 2,64                 |
| Autriche                          | 0,17             | 0,12                 |
| Azerbaïdjan                       | 0,06             | 0,11                 |
| Bahreïn                           | 0,22             | S/O                  |
| Belgique                          | 0,14             | 0,13                 |
| Bénin                             | 0,14             | S/O                  |
| Bermudes                          | 0,66             | 0,78                 |
| Brésil                            | 0,32             | 0,37                 |
| Bulgarie                          | 0,25             | 0,26                 |
| Cameroun                          | 0,14             | 0,13                 |
| Canada                            | 0,71             | 0,87                 |
| Îles Caïmans                      | 3,21             | 2,18                 |
| Chili                             | 0,26             | 0,65                 |
| Chine                             | 0,00             | 0,01                 |
| Colombie                          | 2,21             | 1,38                 |
| Congo                             | 0,19             | S/O                  |
| Congo, République démocratique du | 0,13             | S/O                  |
| Costa Rica                        | 0,52             | 0,22                 |
| Chypre                            | 0,11             | 0,11                 |
| République tchèque                | 0,14             | 0,14                 |
| Danemark                          | 0,06             | 0,05                 |
| République dominicaine            | 0,45             | 0,46                 |
| Équateur                          | 0,51             | 0,49                 |
| Égypte                            | 0,82             | 0,89                 |
| Salvador                          | 0,27             | 0,26                 |
| Finlande                          | 0,06             | 0,06                 |
| France                            | 0,80             | 1,42                 |
| Gabon                             | 0,13             | 0,11                 |
| Allemagne                         | 0,99             | 1,18                 |
| Ghana                             | 0,32             | 0,33                 |
| Guatemala                         | 0,24             | 0,22                 |
| Guernesey, Îles Anglo-Normandes   | 0,05             | 0,05                 |
| Hong Kong                         | 0,03             | 0,03                 |
| Hongrie                           | 0,34             | 0,70                 |
| Inde                              | 0,04             | S/O                  |
| Indonésie                         | 1,04             | 0,80                 |
| Irlande                           | 4,98             | 5,25                 |
| Île de Man                        | S/O              | 0,02                 |
| Israël                            | 0,17             | 0,09                 |
| Italie                            | 1,43             | 1,72                 |
| Côte d'Ivoire                     | 0,24             | 0,28                 |
| Japon                             | 0,61             | 0,68                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,22             | 0,06                 |
| Jordanie                          | 0,04             | 0,04                 |
| Kazakhstan                        | 0,24             | 0,12                 |
| Kenya                             | 0,34             | 0,33                 |
| Koweït                            | 0,36             | S/O                  |
| Liban                             | 0,10             | 0,08                 |
| Liberia                           | 0,11             | 0,10                 |
| Luxembourg                        | 1,90             | 1,69                 |
| Macédoine du Nord                 | S/O              | 0,06                 |
| Mexique                           | 2,86             | 2,83                 |
| Mongolie                          | 0,14             | 0,13                 |
| Maroc                             | 0,11             | 0,11                 |
| Multinationales                   | 0,25             | 0,18                 |
| Pays-Bas                          | 2,04             | 1,61                 |
| Nigeria                           | 0,62             | 0,63                 |
| Norvège                           | 0,06             | 0,02                 |
| Oman                              | 0,25             | 0,23                 |
| Pakistan                          | 0,21             | 0,25                 |
| Panama                            | 0,15             | 0,74                 |
| Paraguay                          | 0,23             | 0,22                 |
| Pérou                             | 1,65             | 1,34                 |
| Philippines                       | 0,02             | 0,02                 |
| Pologne                           | 0,28             | 0,49                 |
| Portugal                          | 0,03             | 0,18                 |
| Qatar                             | 0,26             | S/O                  |
| Roumanie                          | 0,59             | 0,77                 |
| Arabie saoudite                   | 1,04             | 1,08                 |
| Sénégal                           | 0,15             | 0,16                 |
| Serbie                            | 0,28             | 0,23                 |
| Singapour                         | 0,29             | 0,43                 |
| Afrique du Sud                    | 1,86             | 1,31                 |
| Espagne                           | 0,85             | 1,43                 |
| Sri Lanka                         | 0,21             | 0,19                 |
| Supranationales                   | 0,29             | 0,76                 |
| Suède                             | 0,08             | 0,04                 |
| Suisse                            | 0,07             | 0,17                 |
| Thaïlande                         | S/O              | 0,08                 |
| Turquie                           | 0,99             | 1,03                 |
| Ukraine                           | 0,48             | 0,41                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,96             | 0,34                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 4,26             | 4,81                 |
| États-Unis                                                                                               | 40,46            | 50,29                |
| Ouzbékistan                                                                                              | 0,06             | 0,06                 |
| Venezuela                                                                                                | 0,79             | 0,42                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,38             | 0,63                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 9,77             | 9,81                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 1,53             | 0,99                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,27             | (0,08)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | 0,02                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,13             | 0,03                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,11             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,07             | 0,04                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,36             | (0,33)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,76)           | 0,65                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,08             | 0,10                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (7,93)           | (13,79)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES            |                                     |                                  |                           | BELGIQUE                      |                                     |                                  |                           | goeasy Ltd.             |                                     |                                  |                           |
| ANGOLA                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/05/2030 |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                     |                                  |                           | Manuchar Group SARL           |                                     |                                  |                           | \$ 75                   |                                     |                                  |                           |
| Sonangol Finance Ltd.         |                                     |                                  |                           | 7,401 % éch. 07/07/2032       |                                     |                                  |                           | 15                      |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 29/01/2031      |                                     |                                  |                           | € 300                         |                                     |                                  |                           | \$ 342                  |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | Sofina S.A.                   |                                     |                                  |                           | 0,08                    |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 3,707 % éch. 13/11/2033       |                                     |                                  |                           | 300                     |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | Total Belgique                |                                     |                                  |                           | 340                     |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           | 0,08                    |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           | 682                     |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           | 0,16                    |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | BENIN                         |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES         |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | Benin Sukuk S.A.              |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           | 6,200 % éch. 29/01/2033       |                                     |                                  |                           | \$ 700                  |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           | 680                     |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           | 0,16                    |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
| Total Angola                  |                                     |                                  |                           | 1 228                         |                                     |                                  |                           | 0,29                    |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |
|                               |                                     |                                  |                           |                               |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                         | ACTIONS     | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION                                               | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------|----------------------------|---------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>CHINE</b>                                                        |             |                            |                     | <b>ÉQUATEUR</b>                                       |                               |                            |                     | <b>Volkswagen Bank GmbH</b>                               |                               |                            |                     |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                                           |             |                            |                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                               |                            |                     | 4,000 % éch. 26/11/2030                                   |                               |                            |                     |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (c)                                       | 4 810 440   | \$ 29                      | 0,01                | Obligation internationale du gouvernement équatorien  | \$ 1 000                      | \$ 841                     | 0,20                | Volkswagen Financial Services AG                          | 500                           | 573                        | 0,14                |
|                                                                     |             |                            |                     | 5,000 % éch. 31/07/2040                               | 200                           | 203                        | 0,05                | 3,625 % éch. 19/05/2029                                   |                               | 3 427                      | 0,82                |
|                                                                     |             |                            |                     | 8,750 % éch. 29/01/2034                               | 600                           | 616                        | 0,15                |                                                           |                               |                            |                     |
|                                                                     |             |                            |                     | 9,250 % éch. 29/01/2039                               |                               |                            |                     |                                                           |                               |                            |                     |
|                                                                     |             |                            |                     | Total Équateur                                        |                               | 1 660                      | 0,40                | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                    |                               |                            |                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |             |                            |                     | <b>ÉGYPTE</b>                                         |                               |                            |                     | Envalor Finance GmbH                                      |                               |                            |                     |
| Yango Justice International Ltd.                                    |             |                            |                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                               |                            |                     | 9,163 % éch. 29/03/2030                                   | \$ 484                        | 423                        | 0,10                |
| 7,500 % éch. 15/04/2024 ^                                           | \$ 2 600    | 6                          | 0,00                | Obligation internationale du gouvernement égyptien    | € 850                         | 991                        | 0,24                | TK Elevator Midco GmbH                                    | 297                           | 298                        | 0,07                |
| 7,500 % éch. 17/02/2025 ^                                           | 1 900       | 2                          | 0,00                | 6,375 % éch. 11/04/2031                               | \$ 850                        | 736                        | 0,17                |                                                           |                               | 721                        | 0,17                |
| 7,875 % éch. 04/09/2024 ^                                           | 1 900       | 2                          | 0,00                | 8,500 % éch. 31/01/2047                               | 200                           | 196                        | 0,05                | Total Allemagne                                           |                               | 4 148                      | 0,99                |
|                                                                     |             | 10                         | 0,00                | 9,450 % éch. 04/02/2033 (k)                           | 400                           | 445                        | 0,11                |                                                           |                               |                            |                     |
| Total Chine                                                         |             | 39                         | 0,01                | 19,698 % éch. 14/10/2030                              | EGP 27 500                    | 533                        | 0,13                | <b>GHANA</b>                                              |                               |                            |                     |
| <b>COLOMBIE</b>                                                     |             |                            |                     | 21,954 % éch. 04/03/2028                              | 41 100                        | 811                        | 0,19                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                               |                            |                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |             |                            |                     | Total Égypte                                          |                               | 3 712                      | 0,89                | Obligation internationale du gouvernement ghanéen         |                               |                            |                     |
| Ecopetrol S.A.                                                      |             |                            |                     | <b>SALVADOR</b>                                       |                               |                            |                     | 0,000 % éch. 03/07/2026 (d)                               | 10                            | 11                         | 0,00                |
| 8,875 % éch. 13/01/2033                                             | 100         | 110                        | 0,02                | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                               |                            |                     | 0,000 % éch. 03/01/2030 (d)                               | 56                            | 50                         | 0,01                |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |             |                            |                     | Comision Ejecutiva Hidroelectrica del Rio Lempa       |                               |                            |                     | 5,000 % éch. 03/07/2029                                   | 538                           | 532                        | 0,13                |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                 |             |                            |                     | 8,650 % éch. 24/01/2033                               | \$ 300                        | 317                        | 0,08                | 5,000 % éch. 03/07/2035                                   | 452                           | 420                        | 0,10                |
| 5,000 % éch. 19/09/2032                                             | € 600       | 682                        | 0,16                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                               |                            |                     | Total Ghana                                               |                               | 1 013                      | 0,24                |
| 5,750 % éch. 26/11/2034                                             | 300         | 349                        | 0,08                | Obligation internationale du gouvernement salvadorien |                               |                            |                     | <b>GUATEMALA</b>                                          |                               |                            |                     |
| 6,500 % éch. 22/11/2038                                             | 300         | 361                        | 0,09                | 7,650 % éch. 15/06/2035                               | 125                           | 130                        | 0,03                | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                               |                            |                     |
| 7,500 % éch. 02/02/2034                                             | \$ 400      | 428                        | 0,10                | 9,250 % éch. 17/04/2030                               | 175                           | 189                        | 0,05                | Industrial Subordinated Trust 2.0                         |                               |                            |                     |
| TES colombien                                                       |             |                            |                     | 9,650 % éch. 21/11/2054 (k)                           | 200                           | 230                        | 0,05                | 6,550 % éch. 15/04/2036                                   | 400                           | 406                        | 0,10                |
| 2,250 % éch. 18/04/2029 (f)                                         | COP 382 799 | 100                        | 0,02                |                                                       |                               | 549                        | 0,13                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                               |                            |                     |
| 3,000 % éch. 25/03/2033 (f)                                         | 248 840     | 59                         | 0,01                | Total Salvador                                        |                               | 866                        | 0,21                | Obligation internationale du gouvernement guatémaltèque   |                               |                            |                     |
| 6,500 % éch. 22/01/2031 (f)                                         | 1 775 891   | 511                        | 0,12                | <b>FRANCE</b>                                         |                               |                            |                     | 7,050 % éch. 04/10/2032                                   | 800                           | 866                        | 0,20                |
| 7,000 % éch. 26/03/2031                                             | 1 477 000   | 353                        | 0,09                | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                               |                            |                     | Total Guatemala                                           |                               | 1 272                      | 0,30                |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                            | 5 000 100   | 1 408                      | 0,34                | Alice France S.A.                                     |                               |                            |                     | <b>GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                    |                               |                            |                     |
| 11,500 % éch. 25/07/2046                                            | 250 700     | 71                         | 0,02                | 9,500 % éch. 01/11/2029                               | 152                           | 155                        | 0,04                | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                               |                            |                     |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                            | 5 245 500   | 1 494                      | 0,36                | Altrad Investment Authority S.A.S.                    |                               |                            |                     | Sirius Real Estate Ltd.                                   |                               |                            |                     |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                            | 2 955 000   | 894                        | 0,21                | 4,429 % éch. 23/06/2032                               | € 300                         | 345                        | 0,08                | 4,000 % éch. 22/01/2032                                   | € 400                         | 454                        | 0,11                |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                                            | 1 597 000   | 489                        | 0,12                | BPCE S.A.                                             |                               |                            |                     | <b>HONGRIE</b>                                            |                               |                            |                     |
| Total Colombie                                                      |             | 7 309                      | 1,74                | 5,936 % éch. 30/05/2035                               | \$ 600                        | 616                        | 0,15                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                               |                            |                     |
| <b>CONGO</b>                                                        |             |                            |                     | Électricité de France S.A.                            |                               |                            |                     | Obligation internationale du gouvernement hongrois        |                               |                            |                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |             |                            |                     | 6,000 % éch. 22/04/2064                               | 100                           | 96                         | 0,02                | 4,875 % éch. 22/03/2040 (k)                               | 300                           | 360                        | 0,09                |
| Obligation internationale congolaise                                |             |                            |                     | 9,125 % éch. 15/03/2033 (g)                           | 325                           | 378                        | 0,09                | 5,375 % éch. 26/09/2030                                   | \$ 600                        | 610                        | 0,15                |
| 9,500 % éch. 17/02/2035                                             | \$ 400      | 389                        | 0,10                | Eramet S.A.                                           |                               |                            |                     | 5,375 % éch. 12/09/2033                                   | € 250                         | 314                        | 0,07                |
| 9,500 % éch. 26/05/2036                                             | 400         | 387                        | 0,09                | 6,500 % éch. 30/11/2029                               | € 400                         | 453                        | 0,11                | Magyar Export-Import Bank                                 |                               |                            |                     |
| Total Congo                                                         |             | 776                        | 0,19                | iliad S.A.                                            |                               |                            |                     | 6,000 % éch. 16/05/2029                                   | 500                           | 608                        | 0,14                |
| <b>CONGO, RÉPUBLIQUE DÉMOCRATIQUE DU</b>                            |             |                            |                     | 4,250 % éch. 09/01/2032                               | 300                           | 346                        | 0,08                | Total Hongrie                                             |                               | 1 892                      | 0,45                |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |             |                            |                     | New Immo Holding S.A.                                 |                               |                            |                     | <b>INDE</b>                                               |                               |                            |                     |
| Obligation internationale de la RDC                                 |             |                            |                     | 4,875 % éch. 08/12/2028                               | 300                           | 344                        | 0,08                | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                               |                            |                     |
| 9,500 % éch. 16/04/2037                                             | 400         | 419                        | 0,10                | 4,950 % éch. 14/11/2030                               | 700                           | 799                        | 0,19                | Muthoot Finance Ltd.                                      |                               |                            |                     |
| <b>COSTA RICA</b>                                                   |             |                            |                     |                                                       |                               | 3 532                      | 0,84                | 5,750 % éch. 04/08/2030                                   | \$ 400                        | 392                        | 0,10                |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |             |                            |                     | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                |                               |                            |                     | Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.                              |                               |                            |                     |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain               |             |                            |                     | Alice France S.A.                                     |                               |                            |                     | 6,500 % éch. 02/02/2031                                   | 600                           | 594                        | 0,14                |
| 5,500 % éch. 21/11/2030                                             | € 500       | 601                        | 0,15                | 10,548 % éch. 31/05/2031                              | \$ 700                        | 716                        | 0,17                | Total Inde                                                |                               | 986                        | 0,24                |
| 6,001 % éch. 16/01/2036                                             | 250         | 303                        | 0,07                | Total France                                          |                               | 4 248                      | 1,01                | <b>INDONÉSIE</b>                                          |                               |                            |                     |
| 7,300 % éch. 13/11/2054                                             | \$ 300      | 339                        | 0,08                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                               |                            |                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                               |                            |                     |
| Total Costa Rica                                                    |             | 1 243                      | 0,30                | Obligation internationale du gouvernement gabonais    |                               |                            |                     | Pertamina Persero PT                                      |                               |                            |                     |
| <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                                           |             |                            |                     | 9,500 % éch. 18/02/2029                               | 425                           | 407                        | 0,10                | 6,500 % éch. 07/11/2048                                   | 1 250                         | 1 275                      | 0,30                |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |             |                            |                     | <b>ALLEMAGNE</b>                                      |                               |                            |                     | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara |                               |                            |                     |
| EPH Financing International A/S                                     |             |                            |                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                               |                            |                     | 1,875 % éch. 05/11/2031                                   | € 325                         | 329                        | 0,08                |
| 4,625 % éch. 02/07/2032                                             | € 300       | 350                        | 0,08                | Cheplapharm Arzneimittel GmbH                         |                               |                            |                     | 4,750 % éch. 03/02/2031                                   | \$ 400                        | 390                        | 0,09                |
| 5,875 % éch. 30/11/2029                                             | 300         | 365                        | 0,09                | 6,750 % éch. 15/02/2032                               | € 300                         | 346                        | 0,08                | 6,150 % éch. 21/05/2048                                   | 1 000                         | 957                        | 0,23                |
| Total République tchèque                                            |             | 715                        | 0,17                | Deutsche Bank AG                                      |                               |                            |                     |                                                           |                               | 2 951                      | 0,70                |
| <b>RÉPUBLIQUE DOMINICAINE</b>                                       |             |                            |                     | 5,882 % éch. 08/07/2031                               | \$ 500                        | 508                        | 0,12                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                               |                            |                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |             |                            |                     | IHO Verwaltungs GmbH                                  |                               |                            |                     | Obligation internationale du gouvernement indonésien      |                               |                            |                     |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |             |                            |                     | 5,625 % éch. 15/05/2031                               | € 400                         | 476                        | 0,11                | 4,100 % éch. 04/03/2034                                   | € 300                         | 337                        | 0,08                |
| 5,875 % éch. 28/10/2035                                             | \$ 400      | 396                        | 0,10                | Mahle GmbH                                            |                               |                            |                     | 4,460 % éch. 04/03/2038                                   | 300                           | 334                        | 0,08                |
| 6,150 % éch. 17/05/2038                                             | 600         | 597                        | 0,14                | 7,125 % éch. 15/07/2032 (j)                           | 400                           | 483                        | 0,12                | 5,125 % éch. 29/05/2038                                   | 300                           | 353                        | 0,09                |
| 6,500 % éch. 15/02/2048                                             | 1 175       | 1 169                      | 0,28                | Nidda Healthcare Holding GmbH                         |                               |                            |                     |                                                           |                               | 1 024                      | 0,25                |
| Total République dominicaine                                        |             | 2 162                      | 0,52                | 5,625 % éch. 21/02/2030                               | 400                           | 464                        | 0,11                | Total Indonésie                                           |                               | 3 975                      | 0,95                |

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------|----------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| IRLANDE                                                                                |                                     |                                  |                           | ITALIE                        |                                                    |                                  |                           |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS    |                                                    |                                  |                           |
| Anchorage Capital Europe CLO DAC                                                       |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL |                                                    |                                  |                           |
| 3,424 % éch. 15/10/2038                                                                | €                                   | 700                              | \$ 802                    | 0,19                          | 3,116 % éch. 20/12/2045                            | €                                | 1 000                     |
| Aurium CLO DAC                                                                         |                                     |                                  |                           |                               | \$                                                 | 1 147                            | 0,27                      |
| 2,973 % éch. 16/01/2031                                                                |                                     | 123                              | 141                       | 0,03                          | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                  |                           |
| 3,347 % éch. 22/06/2034                                                                |                                     | 1 999                            | 2 284                     | 0,55                          | Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC                   |                                  |                           |
| Barings Euro CLO DAC                                                                   |                                     |                                  |                           |                               | 7,500 % éch. 15/02/2032                            | \$                               | 300                       |
| 3,145 % éch. 25/07/2035                                                                |                                     | 1 000                            | 1 144                     | 0,27                          | Eni SpA                                            |                                  | 301                       |
| 3,444 % éch. 21/10/2038                                                                |                                     | 1 000                            | 1 145                     | 0,27                          | 5,750 % éch. 19/05/2035                            |                                  | 325                       |
| Blackrock European CLO DAC                                                             |                                     |                                  |                           |                               | 5,950 % éch. 15/05/2054                            |                                  | 400                       |
| 3,220 % éch. 17/07/2034                                                                |                                     | 851                              | 974                       | 0,23                          | Intesa Sanpaolo SpA                                |                                  | 396                       |
| Cumulus Static CLO DAC                                                                 |                                     |                                  |                           |                               | 5,500 % éch. 01/03/2028 (g)(i)                     | €                                | 750                       |
| 3,483 % éch. 15/11/2033                                                                |                                     | 1 174                            | 1 344                     | 0,32                          | Mundys SpA                                         |                                  | 876                       |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                                                             |                                     |                                  |                           |                               | 1,875 % éch. 12/02/2028                            |                                  | 1 231                     |
| 3,066 % éch. 25/04/2036                                                                |                                     | 500                              | 572                       | 0,14                          | TeamSystem SpA                                     |                                  | 0,29                      |
| Harvest CLO DAC                                                                        |                                     |                                  |                           |                               | 5,000 % éch. 01/07/2031                            |                                  | 331                       |
| 3,054 % éch. 15/01/2032                                                                |                                     | 1 428                            | 1 633                     | 0,39                          | UniCredit SpA                                      |                                  | 0,08                      |
| Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC                                            |                                     |                                  |                           |                               | 7,296 % éch. 02/04/2034                            | \$                               | 625                       |
| 3,414 % éch. 15/07/2039                                                                |                                     | 1 400                            | 1 603                     | 0,38                          |                                                    |                                  | 658                       |
| OCP Euro CLO DAC                                                                       |                                     |                                  |                           |                               |                                                    |                                  | 4 127                     |
| 3,158 % éch. 20/04/2035                                                                |                                     | 1 000                            | 1 144                     | 0,27                          | Total Italie                                       |                                  | 5 274                     |
| Providus CLO DAC                                                                       |                                     |                                  |                           |                               |                                                    |                                  | 1,26                      |
| 3,415 % éch. 20/11/2038                                                                |                                     | 600                              | 686                       | 0,17                          | CÔTE D'IVOIRE                                      |                                  |                           |
| Rockford Tower Europe CLO DAC                                                          |                                     |                                  |                           |                               | ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                  |                           |
| 3,489 % éch. 29/08/2036                                                                |                                     | 1 000                            | 1 145                     | 0,27                          | Obligation internationale du gouvernement ivoirien |                                  |                           |
| SCF Rahoituspalvelut DAC                                                               |                                     |                                  |                           |                               | 4,875 % éch. 30/01/2032                            | €                                | 700                       |
| 2,859 % éch. 25/06/2034                                                                |                                     | 142                              | 162                       | 0,04                          | 5,750 % éch. 31/12/2032                            | \$                               | 1 001                     |
| Toro European CLO DAC                                                                  |                                     |                                  |                           |                               | 7,625 % éch. 30/01/2033                            |                                  | 450                       |
| 3,070 % éch. 12/01/2032                                                                |                                     | 155                              | 177                       | 0,04                          | Total Côte d'Ivoire                                |                                  | 2 274                     |
| 3,093 % éch. 15/02/2034                                                                |                                     | 546                              | 624                       | 0,15                          |                                                    |                                  | 0,54                      |
| 3,474 % éch. 15/04/2037                                                                |                                     | 1 000                            | 1 145                     | 0,27                          | JAPON                                              |                                  |                           |
| Voya Euro CLO DAC                                                                      |                                     |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                  |                           |
| 3,174 % éch. 15/10/2034                                                                |                                     | 500                              | 572                       | 0,14                          | Nissan Motor Co. Ltd.                              |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  | 17 297                    | 4,12                          | 4,345 % éch. 17/09/2027                            |                                  | 450                       |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           |                               | Norinchukin Bank                                   |                                  |                           |
| CIMA Finance DAC                                                                       |                                     |                                  |                           |                               | 5,359 % éch. 09/09/2035 (k)                        |                                  | 300                       |
| 2,950 % éch. 05/09/2029                                                                | \$                                  | 190                              | 181                       | 0,04                          | SoftBank Group Corp.                               |                                  | 298                       |
| Flutter Treasury DAC                                                                   |                                     |                                  |                           |                               | 5,375 % éch. 08/01/2029                            | €                                | 300                       |
| 4,000 % éch. 04/06/2031                                                                | €                                   | 625                              | 705                       | 0,17                          | 8,250 % éch. 22/10/2031                            | \$                               | 300                       |
| Iridium Capital PLC                                                                    |                                     |                                  |                           |                               | Total Japon                                        |                                  | 1 400                     |
| 9,250 % éch. 18/06/2029                                                                |                                     | 900                              | 1 118                     | 0,27                          |                                                    |                                  | 0,33                      |
|                                                                                        |                                     |                                  | 2 004                     | 0,48                          | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES                       |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                        |                                     |                                  |                           |                               | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                         |                                  |                           |
| République du Panama                                                                   |                                     |                                  |                           |                               | Invesco U.S. CLO Ltd.                              |                                  |                           |
| 4,979 % éch. 01/04/2027                                                                |                                     | 1 500                            | 1 727                     | 0,41                          | 4,831 % éch. 20/07/2037                            |                                  | 2 700                     |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                  |                           |
| GS Mortgage-Backed Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           |                               | GSG Bidco Ltd.                                     |                                  |                           |
| 3,133 % éch. 24/11/2067                                                                |                                     | 500                              | 573                       | 0,14                          | 5,375 % éch. 15/06/2036                            | €                                | 300                       |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           |                               | Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                 |                                  |                           |
| Avenir Issuer Ireland DAC                                                              |                                     |                                  |                           |                               | KAZAKHSTAN                                         |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/10/2027                                                                | \$                                  | 306                              | 302                       | 0,07                          | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                  |                           |
| Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC                                       |                                     |                                  |                           |                               | KazMunayGas National Co. JSC                       |                                  |                           |
| 10,750 % éch. 05/02/2029                                                               |                                     | 361                              | 371                       | 0,09                          | 5,375 % éch. 24/04/2030                            | \$                               | 200                       |
|                                                                                        |                                     |                                  | 673                       | 0,16                          | ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                  |                           |
| Total Irlande                                                                          |                                     |                                  | 22 274                    | 5,31                          | Baïterek National Investment Holding JSC           |                                  |                           |
| ÎLE DE MAN                                                                             |                                     |                                  |                           |                               | 16,950 % éch. 02/04/2029 KZT                       |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           |                               | 16,950 % éch. 02/04/2031                           |                                  |                           |
| Playtech PLC                                                                           |                                     |                                  |                           |                               | Development Bank of Kazakhstan JSC                 |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 28/06/2028                                                                | €                                   | 700                              | 815                       | 0,19                          | 18,400 % éch. 16/10/2028                           |                                  | 100 000</                 |



## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>             |                                     |                                  |                           |                                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>PÉROU</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| Albion Financing SARL                              |                                     |                                  |                           | NE Property BV                                                                                  |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 04/04/2038                              | PYG                                 | 1 638 000                        | 259                       |
| 5,204 % éch. 21/05/2031                            | € 1 000                             | \$ 1 154                         | 0,28                      | 3,875 % éch. 30/09/2033                                                                         | € 300                               | \$ 340                           | 0,08                      | Total Paraguay                                       |                                     | 690                              | 0,16                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | Sandoz Finance BV                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Eagle Funding Luxco SARL                           |                                     |                                  |                           | 4,220 % éch. 17/04/2030                                                                         | 400                                 | 472                              | 0,11                      | Banco Internacional del Peru SAA Interbank           |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                            | \$ 1 850                            | 1 860                            | 0,44                      | Universal Music Group NV                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 15/07/2031                              | \$ 400                              | 393                              | 0,09                      |
| Total Luxembourg                                   |                                     | 11 400                           | 2,72                      | 4,125 % éch. 16/06/2036                                                                         | 400                                 | 464                              | 0,11                      | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.         |                                     |                                  |                           |
| <b>MEXIQUE</b>                                     |                                     |                                  |                           | Urenco Finance NV                                                                               |                                     |                                  |                           | 9,700 % éch. 05/03/2045                              | PEN 500                             | 157                              | 0,04                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 18/06/2035                                                                         | 300                                 | 341                              | 0,08                      | 10,100 % éch. 15/12/2043                             | 3 835                               | 1 238                            | 0,30                      |
| Banco Actinver S.A. Institucion de Banca Multiple  |                                     |                                  |                           | Veon Midco BV                                                                                   |                                     |                                  |                           | Petroleos del Peru S.A.                              |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 31/01/2041                            | 297                                 | 302                              | 0,07                      | 7,450 % éch. 01/06/2033                                                                         | \$ 400                              | 399                              | 0,10                      | 5,625 % éch. 19/06/2047                              | \$ 850                              | 608                              | 0,14                      |
| Banco Nacional de Mexico S.A.                      |                                     |                                  |                           | VZ Secured Financing BV                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 2 396                            | 0,57                      |
| 6,697 % éch. 07/08/2036 (i)(j)                     | 400                                 | 394                              | 0,09                      | 7,500 % éch. 15/01/2033                                                                         | 1 300                               | 1 245                            | 0,30                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| COX Asset Mexico S.A. de C.V.                      |                                     |                                  |                           | Yinson Berenia Production BV                                                                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien   |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 08/01/2032                            | 400                                 | 406                              | 0,10                      | 8,498 % éch. 31/01/2045                                                                         | 395                                 | 422                              | 0,10                      | 5,500 % éch. 30/03/2036                              | 1 000                               | 1 011                            | 0,24                      |
| Esentia Energy Development S.A.B. de C.V.          |                                     |                                  |                           | Yinson Boronia Production BV                                                                    |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 12/08/2032                              | PEN 4 300                           | 1 366                            | 0,32                      |
| 6,125 % éch. 30/07/2033                            | 500                                 | 499                              | 0,12                      | 8,947 % éch. 31/07/2042                                                                         | 486                                 | 535                              | 0,13                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                              | 1 000                               | 328                              | 0,08                      |
| Petroleos Mexicanos                                |                                     |                                  |                           | ZF Europe Finance BV                                                                            |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 21/11/2033                              | \$ 475                              | 581                              | 0,14                      |
| 5,625 % éch. 23/01/2046                            | 2 066                               | 1 654                            | 0,40                      | 5,500 % éch. 17/02/2032                                                                         | € 700                               | 793                              | 0,19                      |                                                      |                                     | 3 286                            | 0,78                      |
| 6,750 % éch. 21/09/2047                            | 2 025                               | 1 735                            | 0,41                      |                                                                                                 |                                     | 8 708                            | 2,08                      | Total Pérou                                          |                                     | 5 682                            | 1,35                      |
| 7,690 % éch. 23/01/2050                            | 934                                 | 872                              | 0,21                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     | 5 862                            | 1,40                      | <b>TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | Veon Amsterdam                                                                                  |                                     |                                  |                           | ORLEN S.A.                                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain |                                     |                                  |                           | 7,924 % éch. 25/03/2027                                                                         | \$ 250                              | 250                              | 0,06                      | 6,000 % éch. 30/01/2035                              | 200                                 | 207                              | 0,05                      |
| 3,771 % éch. 24/05/2061                            | 1 600                               | 963                              | 0,23                      | <b>NIGERIA</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| 4,490 % éch. 25/05/2032                            | € 400                               | 465                              | 0,11                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                            |                                     |                                  |                           | Bank Gospodarstwa Krajowego                          |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 31/01/2050                            | \$ 350                              | 260                              | 0,06                      | Domini BV                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 13/03/2032                              | € 600                               | 710                              | 0,17                      |
| 5,125 % éch. 19/03/2038                            | € 600                               | 683                              | 0,16                      | 3,081 % éch. 15/06/2056                                                                         | € 336                               | 384                              | 0,09                      | 5,750 % éch. 09/07/2034                              | \$ 200                              | 208                              | 0,05                      |
| 5,375 % éch. 22/03/2033                            | \$ 400                              | 392                              | 0,09                      | Total Pays-Bas                                                                                  |                                     | 9 342                            | 2,23                      | Obligation internationale du gouvernement polonais   |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 09/02/2034                            | 300                                 | 296                              | 0,07                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 14/04/2036                              | 500                                 | 505                              | 0,12                      |
| 5,850 % éch. 02/07/2032                            | 1 851                               | 1 872                            | 0,45                      | Dangote Fertiliser Ltd.                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 18/03/2054                              | 275                                 | 260                              | 0,06                      |
| 6,000 % éch. 07/05/2036                            | 1 300                               | 1 299                            | 0,31                      | 7,750 % éch. 05/05/2031                                                                         | \$ 200                              | 201                              | 0,05                      |                                                      |                                     | 1 683                            | 0,40                      |
| 6,875 % éch. 13/05/2037                            | 400                                 | 420                              | 0,10                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | Total Pologne                                        |                                     | 1 890                            | 0,45                      |
|                                                    |                                     | 6 650                            | 1,58                      | Obligation internationale du gouvernement nigérian                                              |                                     |                                  |                           | <b>QATAR</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| Total Mexique                                      |                                     | 12 512                           | 2,98                      | 7,875 % éch. 16/02/2032                                                                         | 1 150                               | 1 202                            | 0,29                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| <b>MAROC</b>                                       |                                     |                                  |                           | 8,631 % éch. 13/01/2036                                                                         | 200                                 | 217                              | 0,05                      | QatarEnergy                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 9,130 % éch. 13/01/2046                                                                         | 200                                 | 222                              | 0,05                      | 4,625 % éch. 23/06/2029                              | 300                                 | 298                              | 0,07                      |
| OCP S.A.                                           |                                     |                                  |                           |                                                                                                 |                                     | 1 641                            | 0,39                      | <b>ROUMANIE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,700 % éch. 01/03/2036                            | 275                                 | 287                              | 0,07                      | Total Nigeria                                                                                   |                                     | 1 842                            | 0,44                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| <b>MULTINATIONALES</b>                             |                                     |                                  |                           | <b>NORVÈGE</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                            |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 14/04/2033                              | € 400                               | 376                              | 0,09                      |
| JetBlue Airways Corp.                              |                                     |                                  |                           | PPI Public Property Invest AB                                                                   |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 27/09/2026                              | 440                                 | 506                              | 0,12                      |
| 9,875 % éch. 20/09/2031                            | 425                                 | 385                              | 0,09                      | 4,125 % éch. 21/04/2033                                                                         | € 400                               | 451                              | 0,11                      | 5,250 % éch. 30/05/2032                              | 100                                 | 117                              | 0,03                      |
| Stonepeak Motion Holdco Ltd.                       |                                     |                                  |                           | <b>OMAN</b>                                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 22/03/2031                              | 600                                 | 711                              | 0,17                      |
| 6,125 % éch. 15/07/2033 (a)                        | 400                                 | 401                              | 0,09                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 07/06/2033                              | 600                                 | 693                              | 0,16                      |
| Toucan FinCo Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement omanais                                               |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 18/09/2033                              | 300                                 | 366                              | 0,09                      |
| 9,500 % éch. 15/05/2030                            | 300                                 | 283                              | 0,07                      | 6,750 % éch. 17/01/2048                                                                         | \$ 700                              | 769                              | 0,18                      | Total Roumanie                                       |                                     | 2 769                            | 0,66                      |
| VistaJet Malta Finance PLC                         |                                     |                                  |                           | <b>PAKISTAN</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                               |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 15/01/2032 (k)                        | 500                                 | 496                              | 0,12                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Total Multinationales                              |                                     | 1 565                            | 0,37                      | Obligation internationale du gouvernement pakistanais                                           |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement saoudien   |                                     |                                  |                           |
| <b>PAYS-BAS</b>                                    |                                     |                                  |                           | 6,975 % éch. 24/04/2029                                                                         | 700                                 | 702                              | 0,17                      | 3,375 % éch. 05/03/2032                              | 800                                 | 903                              | 0,22                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 08/04/2031                                                                         | 200                                 | 202                              | 0,05                      | 3,450 % éch. 02/02/2061                              | \$ 1 400                            | 889                              | 0,21                      |
| ASR Nederland NV                                   |                                     |                                  |                           | Total Pakistan                                                                                  |                                     | 904                              | 0,22                      | 4,125 % éch. 12/01/2029                              | 600                                 | 592                              | 0,14                      |
| 7,000 % éch. 07/12/2043                            | € 100                               | 134                              | 0,03                      | <b>PANAMA</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 26/10/2046                              | 625                                 | 520                              | 0,12                      |
| Davide Campari-Milano NV                           |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                            |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 18/07/2033                              | 725                                 | 722                              | 0,17                      |
| 4,250 % éch. 17/06/2033                            | 300                                 | 349                              | 0,08                      | Generadora de Gatun S.A.                                                                        |                                     |                                  |                           | Total Arabie saoudite                                |                                     | 3 626                            | 0,86                      |
| Digital Dutch Finco BV                             |                                     |                                  |                           | 6,874 % éch. 30/09/2044                                                                         | 400                                 | 414                              | 0,10                      | <b>SÉNÉGAL</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/07/2034                            | 500                                 | 564                              | 0,14                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| ENEL Finance International NV                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement panaméen                                              |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sénégalais |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 14/10/2032                            | \$ 1 000                            | 1 121                            | 0,27                      | 6,400 % éch. 14/02/2035                                                                         | 600                                 | 635                              | 0,15                      | 4,750 % éch. 13/03/2028                              | € 133                               | 85                               | 0,02                      |
| Flora Food Management BV                           |                                     |                                  |                           | Total Panama                                                                                    |                                     | 1 049                            | 0,25                      | 5,375 % éch. 08/06/2037                              | 400                                 | 244                              | 0,06                      |
| 6,875 % éch. 02/07/2029                            | € 300                               | 335                              | 0,08                      | <b>PARAGUAY</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 10/06/2031                              | \$ 400                              | 216                              | 0,05                      |
| 7,500 % éch. 31/10/2030 (j)                        | 300                                 | 342                              | 0,08                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | Total Sénégal                                        |                                     | 545                              | 0,13                      |
| IPD BV                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement paraguayen                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,776 % éch. 15/06/2031                            | 450                                 | 512                              | 0,12                      | 6,650 % éch. 04/03/2055                                                                         | 400                                 | 431                              | 0,10                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Magnum Icc Finance BV                              |                                     |                                  |                           |                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 26/02/2029                            | 300                                 | 340                              | 0,08                      |                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>SERBIE</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>              |                                     |                                  |                           |
| Telecommunications Co. Telekom Srbija AD Belgrade |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 18/05/2031                           | \$ 400                              | \$ 399                           | 0,10                      |

|                                                 |       |       |      |
|-------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                    |       |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement serbe |       |       |      |
| 6,500 % éch. 26/09/2033 (k)                     | 1 000 | 1 058 | 0,25 |
| Total Serbie                                    |       | 1 457 | 0,35 |

|                                                |     |     |      |
|------------------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>SINGAPOUR</b>                               |     |     |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |     |     |      |
| Seagate Data Storage Technology Pte. Ltd.      |     |     |      |
| 9,625 % éch. 01/12/2032                        | 460 | 507 | 0,12 |
| Yinson Production Financial Services Pte. Ltd. |     |     |      |
| 9,625 % éch. 03/05/2029                        | 300 | 318 | 0,08 |
| Total Singapour                                |     | 825 | 0,20 |

|                                      |     |     |      |
|--------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>                |     |     |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |     |     |      |
| Sasol Financing USA LLC              |     |     |      |
| 8,750 % éch. 10/04/2033              | 400 | 414 | 0,10 |

|                                        |            |     |      |
|----------------------------------------|------------|-----|------|
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |            |     |      |
| Transnet SOC Ltd.                      |            |     |      |
| 10,658 % éch. 02/03/2028               | ZAR 10 857 | 662 | 0,16 |

|                                                        |            |       |      |
|--------------------------------------------------------|------------|-------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |            |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |            |       |      |
| 5,650 % éch. 27/09/2047                                | \$ 550     | 467   | 0,11 |
| 7,250 % éch. 11/12/2055                                | 400        | 400   | 0,10 |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                | ZAR 38 200 | 2 322 | 0,55 |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 26 400     | 1 629 | 0,39 |

|                      |  |       |      |
|----------------------|--|-------|------|
| Total Afrique du Sud |  | 4 818 | 1,15 |
|                      |  | 5 894 | 1,41 |

|                                    |         |       |      |
|------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>ESPAGNE</b>                     |         |       |      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b> |         |       |      |
| BBVA Consumer Auto                 |         |       |      |
| 2,819 % éch. 25/02/2042            | € 1 300 | 1 487 | 0,35 |

|                                      |        |       |      |
|--------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |       |      |
| Amadeus IT Group S.A.                |        |       |      |
| 3,750 % éch. 20/05/2031              | 300    | 347   | 0,08 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. |        |       |      |
| 4,968 % éch. 08/05/2031              | \$ 600 | 599   | 0,14 |
| CaixaBank S.A.                       |        |       |      |
| 6,037 % éch. 15/06/2035              | 300    | 313   | 0,08 |
| Cellnex Finance Co. S.A.             |        |       |      |
| 3,875 % éch. 07/07/2041              | 700    | 550   | 0,13 |
| EnfraGen Energia Sur S.A.U.          |        |       |      |
| 8,499 % éch. 30/06/2032              | 400    | 418   | 0,10 |
| Molins Finance S.A.                  |        |       |      |
| 5,500 % éch. 15/06/2033              | € 400  | 479   | 0,12 |
|                                      |        | 2 706 | 0,65 |

|                                                                                                |     |       |      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-------|------|
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |     |       |      |
| Santander Residential FT                                                                       |     |       |      |
| 3,088 % éch. 18/10/2068                                                                        | 946 | 1 084 | 0,26 |
| Total Espagne                                                                                  |     | 5 277 | 1,26 |

|                                                       |       |     |      |
|-------------------------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>SRI LANKA</b>                                      |       |     |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |       |     |      |
| Obligation internationale du gouvernement sri-lankais |       |     |      |
| 3,100 % éch. 15/01/2030                               | \$ 96 | 98  | 0,02 |
| 3,350 % éch. 15/03/2033                               | 188   | 181 | 0,04 |
| 3,600 % éch. 15/06/2035                               | 127   | 106 | 0,03 |
| 3,600 % éch. 15/05/2036                               | 88    | 89  | 0,02 |
| 3,600 % éch. 15/02/2038                               | 176   | 178 | 0,04 |
| 4,000 % éch. 15/04/2028                               | 67    | 65  | 0,02 |
| Total Sri Lanka                                       |       | 717 | 0,17 |

| DESCRIPTION                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------|
| <b>SUPRANATIONALES</b>       |                                     |                                  |                        |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b> |                                     |                                  |                        |
| Union européenne             |                                     |                                  |                        |
| 3,000 % éch. 04/12/2034      | € 2 100                             | \$ 2 384                         | 0,57                   |
| 3,375 % éch. 04/10/2039      | 900                                 | 1 009                            | 0,24                   |
| Total Supranationales        |                                     | 3 393                            | 0,81                   |

|                                      |     |       |      |
|--------------------------------------|-----|-------|------|
| <b>SUEDE</b>                         |     |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |     |       |      |
| Fastighets AB Balder                 |     |       |      |
| 3,625 % éch. 25/08/2031              | 325 | 365   | 0,08 |
| Sagax AB                             |     |       |      |
| 3,375 % éch. 26/01/2031              | 400 | 451   | 0,11 |
| Verisure Holding AB                  |     |       |      |
| 4,125 % éch. 02/01/2032 (a)          | 400 | 461   | 0,11 |
| Total Suède                          |     | 1 277 | 0,30 |

|                                      |        |     |      |
|--------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>TURQUIE</b>                       |        |     |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |     |      |
| QNB Bank A/S                         |        |     |      |
| 5,875 % éch. 11/02/2031              | \$ 400 | 389 | 0,09 |
| Türkiye Varlık Fonu Yonetimi A/S     |        |     |      |
| 8,250 % éch. 14/02/2029              | 300    | 314 | 0,08 |
|                                      |        | 703 | 0,17 |

|                                                |            |       |      |
|------------------------------------------------|------------|-------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                   |            |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement turc |            |       |      |
| 4,875 % éch. 16/04/2043                        | 1 700      | 1 294 | 0,31 |
| 5,750 % éch. 11/05/2047 (k)                    | 1 550      | 1 258 | 0,30 |
| 36,000 % éch. 12/08/2026                       | TRY 14 200 | 304   | 0,07 |
| 40,305 % éch. 06/09/2028                       | 12 000     | 258   | 0,06 |
|                                                |            | 3 114 | 0,74 |
| Total Turquie                                  |            | 3 817 | 0,91 |

|                                      |        |     |      |
|--------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>UKRAINE</b>                       |        |     |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |     |      |
| NPC Ukrenergo                        |        |     |      |
| 6,875 % éch. 09/11/2028              | \$ 200 | 195 | 0,05 |

|                                                     |     |       |      |
|-----------------------------------------------------|-----|-------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |     |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien |     |       |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2030                             | 98  | 71    | 0,02 |
| 0,000 % éch. 01/02/2034                             | 366 | 208   | 0,05 |
| 0,000 % éch. 01/02/2035                             | 125 | 75    | 0,02 |
| 4,500 % éch. 01/02/2029                             | 60  | 50    | 0,01 |
| 4,500 % éch. 01/02/2034                             | 484 | 341   | 0,08 |
| 4,500 % éch. 01/02/2035                             | 618 | 429   | 0,10 |
| 4,500 % éch. 01/02/2036                             | 632 | 434   | 0,10 |
|                                                     |     | 1 608 | 0,38 |
| Total Ukraine                                       |     | 1 803 | 0,43 |

|                                      |        |       |      |
|--------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>           |        |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |       |      |
| Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC           |        |       |      |
| 5,794 % éch. 30/06/2053              | 300    | 298   | 0,07 |
| Emirates NBD Bank PJSC               |        |       |      |
| 5,125 % éch. 29/06/2031              | 400    | 400   | 0,10 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC            |        |       |      |
| 3,530 % éch. 24/12/2029              | € 400  | 459   | 0,11 |
| 4,789 % éch. 03/06/2031              | \$ 600 | 601   | 0,14 |
|                                      |        | 1 758 | 0,42 |

|                                                                   |       |       |      |
|-------------------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |       |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |       |       |      |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 1 500 | 1 495 | 0,36 |
| Total Émirats arabes unis                                         |       | 3 253 | 0,78 |

|                                    |         |       |      |
|------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>ROYAUME-UNI</b>                 |         |       |      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b> |         |       |      |
| Curzon Mortgages PLC               |         |       |      |
| 4,592 % éch. 28/07/2049            | £ 1 000 | 1 328 | 0,32 |

| DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           |
| Allwyn Entertainment Financing UK PLC          |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 30/04/2029                        | \$ 291                              | \$ 299                           | 0,07                      |
| Amber Finco PLC                                |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 15/07/2029                        | € 200                               | 237                              | 0,06                      |
| Anglian Water Services Financing PLC           |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 23/06/2036                        | 700                                 | 801                              | 0,19                      |
| 5,875 % éch. 20/06/2031                        | £ 300                               | 405                              | 0,10                      |
| Anglo American Capital PLC                     |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 19/03/2031                        | \$ 400                              | 394                              | 0,09                      |
| Azule Energy Finance PLC                       |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 22/01/2031                        | 400                                 | 401                              | 0,10                      |
| Barclays PLC                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,219 % éch. 24/05/2030                        | 300                                 | 295                              | 0,07                      |
| Belron UK Finance PLC                          |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/10/2029                        | 100                                 | 101                              | 0,02                      |
| Gatwick Airport Finance PLC                    |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 21/11/2030                        | £ 300                               | 396                              | 0,09                      |
| Greene King Finance PLC                        |                                     |                                  |                           |
| 5,106 % éch. 15/03/2034                        | 205                                 | 268                              | 0,06                      |
| ICBC Standard Bank PLC                         |                                     |                                  |                           |
| 20,000 % éch. 13/12/2029                       | UZS 3 503 000                       | 292                              | 0,07                      |
| IHG Finance LLC                                |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 10/09/2030                        | € 300                               | 341                              | 0,08                      |
| Imperial Brands Finance PLC                    |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 12/02/2034                        | 400                                 | 451                              | 0,11                      |
| INEOS Finance PLC                              |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 15/08/2030 (k)                    | 400                                 | 428                              | 0,10                      |
| Informa PLC                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 09/06/2031                        | 300                                 | 340                              | 0,08                      |
| 3,750 % éch. 29/04/2032                        | 300                                 | 344                              | 0,08                      |
| John Lewis PLC                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 18/12/2034                        | £ 275                               | 310                              | 0,07                      |
| Mitchells & Butlers Finance PLC                |                                     |                                  |                           |
| 4,316 % éch. 15/12/2030                        | 94                                  | 122                              | 0,03                      |
| 4,350 % éch. 15/12/2030                        | \$ 375                              | 362                              | 0,09                      |
| 6,469 % éch. 15/09/2032                        | £ 332                               | 444                              | 0,11                      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                    | \$ 578                              | 471                              | 0,11                      |
| South West Water Finance PLC                   |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/09/2031                        | £ 300                               | 395                              | 0,09                      |
| SSE PLC                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 18/03/2032                        | € 375                               | 430                              | 0,10                      |
| SW Finance PLC                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 19/11/2033                        | £ 300                               | 382                              | 0,09                      |
| 6,875 % éch. 07/08/2032                        | 250                                 | 334                              | 0,08                      |
| 6,875 % éch. 14/11/2034                        | 300                                 | 399                              | 0,10                      |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC           |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                        | 69                                  | 98                               | 0,02                      |
| Vedanta Resources Finance PLC                  |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 13/07/2032 (a)                    | \$ 400                              | 398                              | 0,10                      |
| Virgin Media Secured Finance PLC               |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/01/2030                        | £ 1 600                             | 1 875                            | 0,45                      |
| Vmed O2 UK Financing PLC                       |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 31/01/2029                        | 400                                 | 503                              | 0,12                      |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                        | € 700                               | 705                              | 0,17                      |
|                                                |                                     | 13 021                           | 3,10                      |

|                                                                                                |       |        |      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |       |        |      |
| Harvest Funding PLC                                                                            |       |        |      |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                        | £ 500 | 664    | 0,16 |
| 5,043 % éch. 15/11/2069                                                                        | 500   | 661    | 0,16 |
| Hawksmoor Mortgage Funding PLC                                                                 |       |        |      |
| 4,587 % éch. 25/02/2057                                                                        | 1 000 | 1 329  | 0,32 |
| Stratton Mortgage Funding PLC                                                                  |       |        |      |
| 4,721 % éch. 25/06/2049                                                                        | 441   | 585    | 0,14 |
| Trinity Square PLC                                                                             |       |        |      |
| 4,647 % éch. 15/07/2059                                                                        | 325   | 432    | 0,10 |
|                                                                                                |       | 3 671  | 0,88 |
| Total Royaume-Uni                                                                              |       | 18 020 | 4,30 |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉTATS-UNIS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                                     |                                  |                           | <b>Aviation Capital Group LLC</b>                 |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>5,563 % éch. 25/12/2034 \$ 258 \$ 257 0,06</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>3,500 % éch. 01/11/2027 \$ 400 \$ 394 0,09</b> |                                     |                                  |                           |
| Aames Mortgage Investment Trust                                            |                                     |                                  |                           | Renaissance Home Equity Loan Trust                                        |                                     |                                  |                           | Axon Enterprise, Inc.                             |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch. 25/10/2035 \$ 16 \$ 16 0,00                                   |                                     |                                  |                           | 5,340 % éch. 25/01/2037 1 336 393 0,09                                    |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/03/2030 600 613 0,15              |                                     |                                  |                           |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | Residential Asset Securities Corp. Trust                                  |                                     |                                  |                           | Bank of America Corp.                             |                                     |                                  |                           |
| 4,503 % éch. 25/02/2037 2 162 887 0,21                                     |                                     |                                  |                           | 4,468 % éch. 25/09/2035 416 392 0,09                                      |                                     |                                  |                           | 3,261 % éch. 28/01/2031 € 700 800 0,19            |                                     |                                  |                           |
| Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | Saxon Asset Securities Trust                                              |                                     |                                  |                           | 4,571 % éch. 27/04/2033 \$ 500 490 0,12           |                                     |                                  |                           |
| 4,468 % éch. 25/11/2035 9 9 0,00                                           |                                     |                                  |                           | 4,228 % éch. 25/03/2036 128 129 0,03                                      |                                     |                                  |                           | 5,288 % éch. 25/04/2034 250 253 0,06              |                                     |                                  |                           |
| 7,138 % éch. 25/11/2032 316 343 0,08                                       |                                     |                                  |                           | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                            |                                     |                                  |                           | Beacon Mobility Corp.                             |                                     |                                  |                           |
| Argent Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 3,943 % éch. 25/07/2036 80 26 0,01                                        |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 01/08/2030 325 339 0,08              |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/05/2036 530 125 0,03                                       |                                     |                                  |                           | 4,438 % éch. 25/01/2035 14 13 0,00                                        |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC                              |                                     |                                  |                           |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                 |                                     |                                  |                           | SLAM Ltd.                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,581 % éch. 30/05/2049 1 690 1 725 0,41          |                                     |                                  |                           |
| 4,768 % éch. 25/06/2035 82 81 0,02                                         |                                     |                                  |                           | 5,547 % éch. 15/07/2051 996 995 0,24                                      |                                     |                                  |                           | BKV Upstream Midstream LLC                        |                                     |                                  |                           |
| 5,563 % éch. 25/07/2034 20 23 0,01                                         |                                     |                                  |                           | Soundview Home Loan Trust                                                 |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/10/2030 75 75 0,02                |                                     |                                  |                           |
| Blackrock DLF CLO LLC                                                      |                                     |                                  |                           | 4,228 % éch. 25/06/2036 4 812 4 345 1,04                                  |                                     |                                  |                           | Black Pearl Compute LLC                           |                                     |                                  |                           |
| 5,253 % éch. 25/07/2034 1 900 1 900 0,45                                   |                                     |                                  |                           | Structured Asset Investment Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/02/2031 350 355 0,08              |                                     |                                  |                           |
| Carrington Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           | 4,393 % éch. 25/11/2035 143 141 0,03                                      |                                     |                                  |                           | Block, Inc.                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,023 % éch. 25/02/2037 498 479 0,11                                       |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                     |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/06/2031 450 414 0,10              |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/05/2035 133 129 0,03                                       |                                     |                                  |                           | 4,453 % éch. 25/09/2035 126 121 0,03                                      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/08/2030 300 301 0,07              |                                     |                                  |                           |
| Castlelake Aircraft Structured Trust                                       |                                     |                                  |                           | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/05/2032 675 689 0,16              |                                     |                                  |                           |
| 5,073 % éch. 15/03/2051 1 958 1 927 0,46                                   |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/01/2037 139 122 0,03                                      |                                     |                                  |                           | Blue Owl Capital Corp.                            |                                     |                                  |                           |
| 5,087 % éch. 15/11/2050 954 942 0,23                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,450 % éch. 15/09/2028 375 380 0,09              |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Boeing Co.                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,107 % éch. 25/03/2036 6 6 0,00                                           |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 01/08/2059 500 358 0,09              |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/11/2047 399 386 0,09                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,705 % éch. 01/05/2040 500 509 0,12              |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/02/2037 1 580 1 526 0,36                                   |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,298 % éch. 01/05/2029 400 417 0,10              |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/04/2034 176 168 0,04                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Booz Allen Hamilton, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,603 % éch. 25/10/2047 1 097 1 072 0,26                                   |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/09/2028 500 488 0,12              |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/11/2034 1 1 0,00                                           |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Broadcom, Inc.                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,863 % éch. 25/05/2047 626 578 0,14                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,187 % éch. 15/11/2036 1 015 851 0,20            |                                     |                                  |                           |
| 5,338 % éch. 25/11/2034 79 79 0,02                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Brown & Brown, Inc.                               |                                     |                                  |                           |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 23/06/2030 200 200 0,05              |                                     |                                  |                           |
| 4,049 % éch. 25/01/2032 2 2 0,00                                           |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Builders FirstSource, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                           |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 01/02/2032 750 699 0,17              |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/05/2037 198 194 0,05                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Burford Capital Global Finance LLC                |                                     |                                  |                           |
| Fremont Home Loan Trust                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/07/2033 350 297 0,07              |                                     |                                  |                           |
| 4,303 % éch. 25/04/2036 243 222 0,05                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Cantor Fitzgerald LP                              |                                     |                                  |                           |
| 4,693 % éch. 25/06/2035 677 635 0,15                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 12/12/2028 400 415 0,10              |                                     |                                  |                           |
| GSA Home Equity Trust                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Capital One Financial Corp.                       |                                     |                                  |                           |
| 3,883 % éch. 25/11/2036 70 16 0,00                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,722 % éch. 30/01/2032 300 296 0,07              |                                     |                                  |                           |
| GSAMP Trust                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Carvana Co.                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,853 % éch. 25/01/2037 35 22 0,01                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 01/06/2030 325 336 0,08              |                                     |                                  |                           |
| 3,863 % éch. 25/12/2046 21 10 0,00                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | CCO Holdings LLC                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/06/2036 165 89 0,02                                        |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 01/02/2033 400 393 0,09              |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/08/2036 457 397 0,10                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | CDW LLC                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,498 % éch. 25/09/2035 43 43 0,01                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,100 % éch. 01/03/2030 450 449 0,11              |                                     |                                  |                           |
| Home Equity Asset Trust                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Centene Corp.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,858 % éch. 25/05/2035 1 1 0,00                                           |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 01/08/2031 625 545 0,13              |                                     |                                  |                           |
| Invesco Commercial Real Estate Finance Trust LLC                           |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/12/2029 300 291 0,07              |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 19/01/2044 1 400 1 401 0,33                                   |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Chord Energy Corp.                                |                                     |                                  |                           |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                        |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/03/2033 200 203 0,05              |                                     |                                  |                           |
| 3,945 % éch. 25/07/2036 19 19 0,01                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Citadel Finance LLC                               |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/07/2036 575 270 0,06                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 14/02/2031 500 489 0,12              |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/03/2037 400 389 0,09                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Citadel Securities Global Holdings LLC            |                                     |                                  |                           |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 27/03/2036 250 248 0,06              |                                     |                                  |                           |
| 4,303 % éch. 25/05/2046 511 150 0,04                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Citizens Financial Group, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/02/2036 797 716 0,17                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,253 % éch. 05/03/2031 300 303 0,07              |                                     |                                  |                           |
| LRECS LLC                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| 5,139 % éch. 19/08/2043 500 500 0,12                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/04/2032 400 389 0,09              |                                     |                                  |                           |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                                        |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/01/2030 350 349 0,08              |                                     |                                  |                           |
| 3,963 % éch. 25/08/2036 3 379 936 0,22                                     |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Cogent Communications Group LLC                   |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/03/2036 761 719 0,17                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2032 300 270 0,06              |                                     |                                  |                           |
| 4,513 % éch. 25/12/2034 745 774 0,19                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/06/2027 400 398 0,10              |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch. 25/02/2034 335 362 0,09                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Columbus McKinnon Corp.                           |                                     |                                  |                           |
| 4,663 % éch. 25/04/2034 48 49 0,01                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 01/02/2033 100 100 0,02              |                                     |                                  |                           |
| MF1 LLC                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | CommonSpirit Health                               |                                     |                                  |                           |
| 5,087 % éch. 18/02/2043 1 000 1 002 0,24                                   |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,975 % éch. 01/09/2035 300 291 0,07              |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                     |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Community Health Systems, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| 3,903 % éch. 25/05/2037 159 122 0,03                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/05/2030 350 331 0,08              |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/09/2036 211 88 0,02                                        |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | CoreWeave, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,468 % éch. 25/01/2035 290 288 0,07                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/07/2032 € 400 451 0,11            |                                     |                                  |                           |
| 7,563 % éch. 25/02/2047 83 68 0,02                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 01/02/2031 \$ 600 594 0,14           |                                     |                                  |                           |
| New Century Home Equity Loan Trust                                         |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | CoStar Group, Inc.                                |                                     |                                  |                           |
| 6,763 % éch. 25/01/2033 127 108 0,03                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 2,800 % éch. 15/07/2030 400 360 0,09              |                                     |                                  |                           |
| Option One Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | CQP Holdco LP                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,203 % éch. 25/01/2037 213 124 0,03                                       |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/06/2031 700 687 0,16              |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| CRC Insurance Group LLC                     | \$ 500                              | \$ 499                           | 0,12                      | Jane Street Group                                  | \$ 325                              | \$ 334                           | 0,08                      | Paramount Global                         | \$ 400                              | \$ 255                           | 0,06                      |
| 7,125 % éch. 01/06/2031                     |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/05/2033                            | 650                                 | 672                              | 0,16                      | 4,600 % éch. 15/01/2045                  | 300                                 | 198                              | 0,05                      |
| Crowdstrike Holdings, Inc.                  | 500                                 | 477                              | 0,11                      | 7,125 % éch. 30/04/2031                            |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 15/08/2044                  |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/02/2029                     |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                               | 1 000                               | 985                              | 0,24                      | Pioneer Opco LLC                         | 525                                 | 535                              | 0,13                      |
| Crown Castle, Inc.                          | 500                                 | 445                              | 0,11                      | 4,586 % éch. 26/04/2033                            | 625                                 | 632                              | 0,15                      | 7,000 % éch. 15/05/2033                  |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 15/01/2031                     |                                     |                                  |                           | 5,294 % éch. 22/07/2035                            |                                     |                                  |                           | Post Holdings, Inc.                      | 775                                 | 767                              | 0,18                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.             | 275                                 | 247                              | 0,06                      | Kilroy Realty LP                                   | 300                                 | 297                              | 0,07                      | 6,500 % éch. 15/03/2036                  | 350                                 | 350                              | 0,08                      |
| 4,279 % éch. 15/03/2032                     | 350                                 | 257                              | 0,06                      | 5,875 % éch. 15/10/2035                            | 200                                 | 224                              | 0,05                      | PR RNO Property Owner LLC                |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 15/03/2042                     |                                     |                                  |                           | Kinder Morgan Energy Partners LP                   | 400                                 | 404                              | 0,10                      | 6,500 % éch. 01/05/2031                  |                                     |                                  |                           |
| EchoStar Corp.                              | 175                                 | 189                              | 0,05                      | 6,950 % éch. 15/01/2038                            | 325                                 | 328                              | 0,08                      | Prime Security Services Borrower LLC     | 1 100                               | 1 078                            | 0,26                      |
| 10,750 % éch. 30/11/2029                    |                                     |                                  |                           | Ladder Capital Finance Holdings LLLP               | 300                                 | 290                              | 0,07                      | 3,375 % éch. 31/08/2027                  |                                     |                                  |                           |
| Edison International                        | 100                                 | 101                              | 0,02                      | 5,500 % éch. 01/08/2030                            | 400                                 | 399                              | 0,10                      | Qnity Electronics, Inc.                  | 400                                 | 403                              | 0,10                      |
| 5,450 % éch. 15/06/2029                     |                                     |                                  |                           | Las Vegas Sands Corp.                              | 300                                 | 304                              | 0,07                      | 5,750 % éch. 15/08/2032                  | 400                                 | 409                              | 0,10                      |
| ELK Grove Village Property LLC              | 300                                 | 302                              | 0,07                      | 3,900 % éch. 08/08/2029                            | 400                                 | 399                              | 0,10                      | Quikrete Holdings, Inc.                  |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/06/2031                     |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/05/2031                            | 325                                 | 328                              | 0,08                      | 6,375 % éch. 01/03/2032                  | 300                                 | 306                              | 0,07                      |
| Encore Capital Group, Inc.                  | 400                                 | 405                              | 0,10                      | Lseg U.S. Fin Corp.                                | 325                                 | 327                              | 0,08                      | 6,750 % éch. 30/04/2032                  | 625                                 | 646                              | 0,15                      |
| 6,625 % éch. 15/04/2031                     |                                     |                                  |                           | 5,297 % éch. 28/03/2034                            |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC           | 1 075                               | 1 072                            | 0,26                      |
| Energy Transfer LP                          | 1 325                               | 1 532                            | 0,37                      | Mars, Inc.                                         | 325                                 | 327                              | 0,08                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                  |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 01/07/2038                     |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/03/2032                            | 300                                 | 304                              | 0,07                      | Rio Oil Finance Trust                    | 236                                 | 243                              | 0,06                      |
| EQT Corp.                                   | 400                                 | 375                              | 0,09                      | Marvell Technology, Inc.                           | 500                                 | 498                              | 0,12                      | 8,200 % éch. 06/04/2028                  |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/05/2031                     |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 15/07/2035                            |                                     |                                  |                           | Rocket Cos., Inc.                        | 300                                 | 305                              | 0,07                      |
| Equinix Europe Financing Corp. LLC          | 700                                 | 692                              | 0,17                      | Matador Resources Co.                              | 300                                 | 342                              | 0,08                      | 6,125 % éch. 01/08/2030                  | 400                                 | 411                              | 0,10                      |
| 4,600 % éch. 15/11/2030                     |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/04/2033                            | 300                                 | 305                              | 0,07                      | 6,500 % éch. 15/06/2034                  | 250                                 | 260                              | 0,06                      |
| Fedex Freight Holding Co., Inc.             | 400                                 | 392                              | 0,09                      | McDonald's Corp.                                   | 300                                 | 305                              | 0,07                      | 7,125 % éch. 01/02/2032                  | 200                                 | 198                              | 0,05                      |
| 4,950 % éch. 15/03/2033                     |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/05/2033                            | 400                                 | 401                              | 0,10                      | Rockies Express Pipeline LLC             |                                     |                                  |                           |
| FMC Corp.                                   | 400                                 | 417                              | 0,10                      | Mercury General Corp.                              | 300                                 | 305                              | 0,07                      | 4,950 % éch. 15/07/2029                  |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 01/06/2031                     |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/06/2036                            | 400                                 | 401                              | 0,10                      | Rollins, Inc.                            | 400                                 | 400                              | 0,10                      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                   | 800                                 | 806                              | 0,19                      | Meridian Arc Holdco LLC                            | 500                                 | 479                              | 0,11                      | 5,250 % éch. 24/02/2035                  |                                     |                                  |                           |
| 5,850 % éch. 17/05/2027                     | 600                                 | 607                              | 0,14                      | 6,250 % éch. 30/04/2031                            |                                     |                                  |                           | Sammons Financial Group, Inc.            | 500                                 | 535                              | 0,13                      |
| 5,875 % éch. 07/11/2029                     |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley                                     | 300                                 | 305                              | 0,07                      | 6,875 % éch. 15/04/2034                  |                                     |                                  |                           |
| Freedom Mortgage Corp.                      | 1 100                               | 1 101                            | 0,26                      | 3,622 % éch. 01/04/2031                            | 600                                 | 581                              | 0,14                      | SBA Communications Corp.                 | 400                                 | 398                              | 0,10                      |
| 6,625 % éch. 15/01/2027                     |                                     |                                  |                           | MSCI, Inc.                                         | 300                                 | 305                              | 0,07                      | 3,875 % éch. 15/02/2027                  | 300                                 | 311                              | 0,07                      |
| FS KKR Capital Corp.                        | 200                                 | 188                              | 0,04                      | 5,150 % éch. 15/03/2036                            | 300                                 | 305                              | 0,07                      | Selective Insurance Group, Inc.          | 300                                 | 311                              | 0,07                      |
| 3,125 % éch. 12/10/2028                     | 275                                 | 265                              | 0,06                      | National Fuel Gas Co.                              | 300                                 | 341                              | 0,08                      | 5,900 % éch. 15/04/2035                  |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/01/2031                     |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/05/2029                            | 300                                 | 305                              | 0,07                      | Sirius XM Radio LLC                      | 350                                 | 330                              | 0,08                      |
| FTAI Aviation Investors LLC                 | 425                                 | 441                              | 0,11                      | National Grid North America, Inc.                  | 300                                 | 341                              | 0,08                      | 4,125 % éch. 01/07/2030                  |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 01/05/2031                     |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 03/06/2030                            | 400                                 | 396                              | 0,09                      | Sixth Street Lending Partners            | 400                                 | 402                              | 0,10                      |
| Gaia Purchaser, Inc.                        | 350                                 | 354                              | 0,08                      | National Health Investors, Inc.                    | 400                                 | 396                              | 0,09                      | 6,125 % éch. 15/07/2030                  |                                     |                                  |                           |
| 7,625 % éch. 15/07/2033 (a)                 |                                     |                                  |                           | 5,350 % éch. 01/02/2033                            | 200                                 | 211                              | 0,05                      | SLM Corp.                                | 675                                 | 685                              | 0,16                      |
| Gartner, Inc.                               | 125                                 | 114                              | 0,03                      | National Mentor Holdings, Inc.                     | 400                                 | 401                              | 0,10                      | 6,500 % éch. 31/01/2030                  | 200                                 | 219                              | 0,05                      |
| 3,750 % éch. 01/10/2030                     | 500                                 | 474                              | 0,11                      | 10,500 % éch. 15/12/2030                           |                                     |                                  |                           | SM Energy Co.                            |                                     |                                  |                           |
| 5,600 % éch. 20/11/2035                     |                                     |                                  |                           | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. | 250                                 | 253                              | 0,06                      | 9,625 % éch. 15/06/2033                  | 500                                 | 484                              | 0,12                      |
| Genesis Energy LP                           | 475                                 | 472                              | 0,11                      | 4,189 % éch. 03/12/2027                            | 400                                 | 399                              | 0,10                      | Snap, Inc.                               |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 15/03/2034                     | 200                                 | 207                              | 0,05                      | Neptune Bidco U.S., Inc.                           | 400                                 | 419                              | 0,10                      | 6,875 % éch. 15/03/2034                  |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/01/2029                     |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 15/02/2033                            |                                     |                                  |                           | Southern California Edison Co.           | 200                                 | 149                              | 0,04                      |
| Global Atlantic Fin Co.                     | 500                                 | 485                              | 0,12                      | Newmark Group, Inc.                                | 400                                 | 399                              | 0,10                      | 4,000 % éch. 01/04/2047                  | 700                                 | 699                              | 0,17                      |
| 4,400 % éch. 15/10/2029                     |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 12/01/2029                            | 393                                 | 407                              | 0,10                      | 4,950 % éch. 15/09/2031                  | 600                                 | 606                              | 0,14                      |
| GLP Capital LP                              | 475                                 | 472                              | 0,11                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                    | 400                                 | 399                              | 0,10                      | 5,150 % éch. 01/06/2029                  |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 15/09/2034                     | 400                                 | 394                              | 0,09                      | 5,625 % éch. 29/09/2028                            |                                     |                                  |                           | Spirit Airlines Pass-Through Trust       | 403                                 | 371                              | 0,09                      |
| 5,750 % éch. 01/11/2037                     |                                     |                                  |                           | Noble Finance LLC                                  | 400                                 | 393                              | 0,09                      | 3,375 % éch. 15/08/2031                  |                                     |                                  |                           |
| Goat Holdco LLC                             | 300                                 | 308                              | 0,07                      | 8,000 % éch. 15/04/2030                            | 400                                 | 393                              | 0,09                      | Starwood Property Trust, Inc.            | 325                                 | 324                              | 0,08                      |
| 6,750 % éch. 01/02/2032                     |                                     |                                  |                           | NRG Energy, Inc.                                   | 100                                 | 106                              | 0,03                      | 5,250 % éch. 15/10/2028                  | 600                                 | 604                              | 0,14                      |
| Goldman Sachs Group, Inc.                   | 950                                 | 954                              | 0,23                      | 5,407 % éch. 15/10/2035                            |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/06/2031                  | 350                                 | 349                              | 0,08                      |
| 5,330 % éch. 23/07/2035                     | 100                                 | 103                              | 0,02                      | OAK-Eagle Acquireco, Inc.                          | 500                                 | 489                              | 0,12                      | Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                     |                                  |                           |
| 5,727 % éch. 25/04/2030                     |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 01/07/2034                            | 300                                 | 343                              | 0,08                      | 5,400 % éch. 15/06/2029                  | 300                                 | 311                              | 0,07                      |
| Gray Media, Inc.                            | 400                                 | 386                              | 0,09                      | Olympus Water U.S. Holding Corp.                   | 300                                 | 275                              | 0,07                      | Stonepeak Nile Parent LLC                |                                     |                                  |                           |
| 9,625 % éch. 15/07/2032                     |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/08/2032                            | 500                                 | 489                              | 0,12                      | 7,250 % éch. 15/03/2032                  |                                     |                                  |                           |
| HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. | 325                                 | 332                              | 0,08                      | Oncor Electric Delivery Co. LLC                    | 300                                 | 343                              | 0,08                      | Store Capital LLC                        | 375                                 | 378                              | 0,09                      |
| 6,375 % éch. 01/07/2034                     |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 15/06/2034                            | 500                                 | 500                              | 0,12                      | 5,400 % éch. 30/04/2030                  | 400                                 | 397                              | 0,09                      |
| HCA, Inc.                                   | 400                                 | 390                              | 0,09                      | OneMain Finance Corp.                              | 300                                 | 305                              | 0,07                      | Sumisho Air Lease Corp.                  |                                     |                                  |                           |
| 4,600 % éch. 15/11/2032                     | 675                                 | 690                              | 0,16                      | 6,125 % éch. 15/05/2030                            | 300                                 | 306                              | 0,07                      | 4,500 % éch. 24/03/2029                  | 400                                 | 397                              | 0,09                      |
| 5,500 % éch. 01/06/2033                     |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/01/2028                            | 250                                 | 258                              | 0,06                      | Sunoco LP                                |                                     |                                  |                           |
| Host Hotels & Resorts LP                    | 300                                 | 301                              | 0,07                      | 6,625 % éch. 15/05/2029                            |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/03/2031                  | 400                                 | 397                              | 0,09                      |
| 5,500 % éch. 15/04/2035                     |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/05/2031                            | 400                                 | 407                              | 0,10                      | SV RNO Property Owner LLC                | 400                                 | 395                              | 0,09                      |
| HPS Corporate Lending Fund                  | 400                                 | 399                              | 0,10                      | ONEOK, Inc.                                        | 300                                 | 275                              | 0,07                      | 5,875 % éch. 01/03/2031                  |                                     |                                  |                           |
| 6,300 % éch. 19/08/2031                     |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 01/06/2029                            | 300                                 | 275                              | 0,07                      | System Energy Resources, Inc.            | 400                                 | 399                              | 0,10                      |
| IHG Finance LLC                             | 300                                 | 343                              | 0,08                      | Oracle Corp.                                       | 300                                 | 275                              | 0,07                      | 5,300 % éch. 15/12/2034                  |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 27/09/2031                     | \$ 350                              | 339                              | 0,08                      | 4,700 % éch. 27/09/2034                            | 1 800                               | 1 351                            | 0,32                      | T-Mobile USA, Inc.                       | 400                                 | 363                              | 0,09                      |
| Ingevity Corp.                              |                                     |                                  |                           | Pacific Gas & Electric Co.                         | 200                                 | 197                              | 0,05                      | 2,550 % éch. 15/02/2031                  | 750                                 | 724                              | 0,17                      |
| 3,875 % éch. 01/11/2028                     |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 01/08/2040                            | 200                                 | 167                              | 0,04                      | 4,700 % éch. 15/01/2035                  |                                     |                                  |                           |
| ION Platform Finance U.S., Inc.             | 750                                 | 544                              | 0,13                      | 3,750 % éch. 01/07/2028                            | 300                                 | 299                              | 0,07                      | Topaz Solar Farms LLC                    | 269                                 | 265                              | 0,06                      |
| 7,875 % éch. 30/09/2032 (k)                 | 150                                 | 134                              | 0,03                      | 4,600 % éch. 15/06/2043                            | 500                                 | 511                              | 0,12                      | 5,750 % éch. 30/09/2039                  |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 01/08/2029                     |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 01/08/2028                            |                                     |                                  |                           | TopBuild Corp.                           | 100                                 | 100                              | 0,02                      |
| IQVIA, Inc.                                 | 500                                 | 509                              | 0,12                      | 5,800 % éch. 15/05/2034                            | 400                                 | 398                              | 0,10                      | 3,625 % éch. 15/03/2029                  |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 01/06/2032                     |                                     |                                  |                           | PacifiCorp                                         |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
|                                             |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/08/2056                            |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,125 % éch. 15/02/2032            | \$ 425                              |                                  |                           | Fortress Intermediate, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 4,234 % éch. 19/06/2035                                        | \$ 1                                | \$ 1                             | 0,00                      |
| TransDigm, Inc.                    |                                     |                                  |                           | 6,624 % éch. 27/06/2031                              | \$ 394                              | \$ 393                           | 0,09                      | 4,294 % éch. 20/10/2045                                        | 191                                 | 180                              | 0,04                      |
| 6,000 % éch. 15/01/2033            | 300                                 | 303                              | 0,07                      | Hudson River Trading LLC                             |                                     |                                  |                           | 4,374 % éch. 19/11/2035                                        | 3                                   | 2                                | 0,00                      |
| 6,375 % éch. 31/05/2033            | 175                                 | 177                              | 0,04                      | 6,139 % éch. 18/03/2030                              | 399                                 | 397                              | 0,09                      | IndyMac Mortgage Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 31/01/2034            | 125                                 | 128                              | 0,03                      | INEOS U.S. Finance LLC                               |                                     |                                  |                           | 3,077 % éch. 25/06/2037                                        | 9                                   | 8                                | 0,00                      |
| Twilio, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 6,894 % éch. 18/02/2030                              | 149                                 | 137                              | 0,03                      | 3,822 % éch. 25/12/2036                                        | 2                                   | 1                                | 0,00                      |
| 3,875 % éch. 15/03/2031            | 400                                 | 377                              | 0,09                      | Jane Street Group LLC                                |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/07/2047                                        | 44                                  | 29                               | 0,01                      |
| Uber Technologies, Inc.            |                                     |                                  |                           | 5,666 % éch. 15/12/2031                              | 199                                 | 197                              | 0,05                      | Lehman Mortgage Trust                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 15/09/2034            | 300                                 | 295                              | 0,07                      | Kaseya, Inc.                                         |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/09/2037                                        | 58                                  | 57                               | 0,01                      |
| UKG, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 6,913 % éch. 22/03/2032                              | 197                                 | 153                              | 0,04                      | Luminent Mortgage Trust                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 01/02/2031            | 1 000                               | 972                              | 0,23                      | Level 3 Financing, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/10/2046                                        | 480                                 | 447                              | 0,11                      |
| United Airlines Pass-Through Trust |                                     |                                  |                           | 6,394 % éch. 29/03/2032                              | 500                                 | 501                              | 0,12                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                         |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 01/11/2029            | 70                                  | 67                               | 0,02                      | LifePoint Health, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/11/2029                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 3,450 % éch. 01/06/2029            | 103                                 | 101                              | 0,02                      | 7,423 % éch. 19/05/2031                              | 97                                  | 96                               | 0,02                      | 4,938 % éch. 25/05/2036                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 3,450 % éch. 07/01/2030            | 110                                 | 107                              | 0,03                      | Newfold Digital Holdings Group, Inc.                 |                                     |                                  |                           | Mill City Mortgage Loan Trust                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/09/2031            | 186                                 | 180                              | 0,04                      | 7,214 % éch. 30/04/2029                              | 461                                 | 341                              | 0,08                      | 3,810 % éch. 25/11/2058                                        | 1 000                               | 904                              | 0,22                      |
| Univision Communications, Inc.     |                                     |                                  |                           | 9,364 % éch. 30/04/2029                              | 25                                  | 20                               | 0,00                      | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 15/04/2033            | 200                                 | 197                              | 0,05                      | Paradigm Parent LLC                                  |                                     |                                  |                           | 4,459 % éch. 25/03/2036                                        | 26                                  | 13                               | 0,00                      |
| 9,375 % éch. 01/08/2032            | 525                                 | 534                              | 0,13                      | 8,232 % éch. 16/04/2032                              | 422                                 | 363                              | 0,09                      | Residential Accredit Loans, Inc. Trust                         |                                     |                                  |                           |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC  |                                     |                                  |                           | QualityTech LP                                       |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/05/2047                                        | 49                                  | 46                               | 0,01                      |
| 6,250 % éch. 15/01/2030            | 750                                 | 769                              | 0,18                      | 7,114 % éch. 30/10/2031                              | 296                                 | 298                              | 0,07                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                 |                                     |                                  |                           |
| Venture Global LNG, Inc.           |                                     |                                  |                           | GuidelOrtho Corp.                                    |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/06/2037                                        | 134                                 | 128                              | 0,03                      |
| 6,375 % éch. 15/12/2034            | 500                                 | 492                              | 0,12                      | 7,644 % éch. 20/08/2032                              | 398                                 | 392                              | 0,09                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                    |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 15/06/2036            | 600                                 | 592                              | 0,14                      | Quikrete Holdings, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/05/2036                                        | 336                                 | 283                              | 0,07                      |
| 7,000 % éch. 15/01/2030            | 850                                 | 867                              | 0,21                      | 5,894 % éch. 19/03/2029                              | 295                                 | 296                              | 0,07                      | 4,183 % éch. 25/09/2047                                        | 374                                 | 350                              | 0,08                      |
| 9,500 % éch. 01/02/2029            | 300                                 | 323                              | 0,08                      | 5,894 % éch. 10/02/2032                              | 296                                 | 296                              | 0,07                      | SunTrust Alternative Loan Trust                                |                                     |                                  |                           |
| Venture Global Plaquemines LNG LLC |                                     |                                  |                           | Rockpoint Gas Storage Partners LP                    |                                     |                                  |                           | 4,413 % éch. 25/12/2035                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 6,125 % éch. 15/12/2030            | 325                                 | 333                              | 0,08                      | 5,982 % éch. 18/09/2031                              | 295                                 | 296                              | 0,07                      | Thornburg Mortgage Securities Trust                            |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/01/2034            | 175                                 | 182                              | 0,04                      | Standard Industries, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 5,013 % éch. 25/06/2037                                        | 6                                   | 5                                | 0,00                      |
| 6,750 % éch. 15/01/2036            | 600                                 | 636                              | 0,15                      | 5,389 % éch. 22/09/2028                              | 173                                 | 173                              | 0,04                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                  |                                     |                                  |                           |
| Verizon Communications, Inc.       |                                     |                                  |                           | Stepstone Group Midco GmbH                           |                                     |                                  |                           | 4,944 % éch. 25/11/2042                                        | 4                                   | 3                                | 0,00                      |
| 2,355 % éch. 15/03/2032            | 750                                 | 656                              | 0,16                      | 8,176 % - 8,179 % éch.                               |                                     |                                  |                           | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust     |                                     |                                  |                           |
| Versant Media Group, Inc.          |                                     |                                  |                           | 19/12/2031                                           | 495                                 | 401                              | 0,10                      | 3,808 % éch. 25/09/2036                                        | 117                                 | 30                               | 0,01                      |
| 7,250 % éch. 30/01/2031            | 500                                 | 518                              | 0,12                      | TransDigm, Inc.                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     | 4 961                            | 1,18                      |
| VFH Parent LLC                     |                                     |                                  |                           | 6,144 % éch. 19/01/2032                              | 199                                 | 200                              | 0,05                      | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                              |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/06/2031            | 200                                 | 209                              | 0,05                      | 6,144 % éch. 19/08/2032                              | 398                                 | 399                              | 0,10                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |
| Viacom, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 6,144 % éch. 13/02/2033                              | 400                                 | 400                              | 0,10                      | 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 9 500                               | 8 880                            | 2,12                      |
| 4,375 % éch. 15/03/2043            | 250                                 | 162                              | 0,04                      | U.S. Renal Care, Inc.                                |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| VICI Properties LP                 |                                     |                                  |                           | 8,758 % éch. 28/06/2028                              | 295                                 | 291                              | 0,07                      | 01/08/2056                                                     | 8 175                               | 7 831                            | 1,86                      |
| 3,875 % éch. 15/02/2029            | 250                                 | 243                              | 0,06                      | TITRES ADOSSÉS A DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/08/2056                                        | 10 675                              | 10 478                           | 2,50                      |
| 4,500 % éch. 15/01/2028            | 250                                 | 248                              | 0,06                      | EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX              |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/07/2056                                        | 2 250                               | 2 258                            | 0,54                      |
| 5,625 % éch. 01/04/2035            | 500                                 | 500                              | 0,12                      |                                                      |                                     | 10 227                           | 2,44                      | 6,000 % éch. 01/08/2056                                        | 10 200                              | 10 395                           | 2,48                      |
| Viper Energy Partners LLC          |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     | 39 842                           | 9,50                      |
| 4,900 % éch. 01/08/2030            | 300                                 | 299                              | 0,07                      | Banc of America Alternative Loan Trust               |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                |                                     |                                  |                           |
| Vornado Realty LP                  |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/01/2037                              | 56                                  | 47                               | 0,01                      | Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 01/06/2031            | 500                                 | 459                              | 0,11                      | Banc of America Funding Trust                        |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/05/2043                                        | 4 100                               | 3 625                            | 0,87                      |
| Wells Fargo & Co.                  |                                     |                                  |                           | 4,727 % éch. 20/01/2047                              | 28                                  | 25                               | 0,01                      | 4,125 % éch. 15/08/2044                                        | 1 100                               | 995                              | 0,24                      |
| 5,499 % éch. 23/01/2035            | 325                                 | 331                              | 0,08                      | BCAP LLC Trust                                       |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/08/2043                                        | 2 900                               | 2 728                            | 0,65                      |
| Windstream Services LLC            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 26/08/2036                              | 1 841                               | 621                              | 0,15                      | 4,625 % éch. 15/05/2044                                        | 3 000                               | 2 899                            | 0,69                      |
| 8,250 % éch. 01/10/2031            | 525                                 | 554                              | 0,13                      | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust          |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/11/2043                                        | 3 000                               | 2 952                            | 0,70                      |
| WS Escrow LLC                      |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 25/02/2036                              | 64                                  | 58                               | 0,01                      |                                                                |                                     | 13 199                           | 3,15                      |
| 7,750 % éch. 01/06/2033            | 400                                 | 411                              | 0,10                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                  |                                     |                                  |                           | ACTIONS                                                        |                                     |                                  |                           |
| Wynn Resorts Finance LLC           |                                     |                                  |                           | 3,817 % éch. 25/10/2046                              | 14                                  | 13                               | 0,00                      | BONS DE SOUSCRIPTION                                           |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/03/2033            | 400                                 | 402                              | 0,10                      | 6,480 % éch. 25/10/2035                              | 38                                  | 38                               | 0,01                      | Spirit Aviation Holdings, Inc. - Exp.                          |                                     |                                  |                           |
| ZF North America Capital, Inc.     |                                     |                                  |                           | Countrywide Alternative Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | 11/03/2035                                                     | 2 178                               | 0                                | 0,00                      |
| 7,500 % éch. 24/03/2031            | 450                                 | 453                              | 0,11                      | 4,163 % éch. 25/07/2036                              | 3                                   | 1                                | 0,00                      | Total États-Unis                                               |                                     |                                  |                           |
| ZoomInfo Technologies LLC          |                                     |                                  |                           | 4,174 % éch. 20/05/2046                              | 219                                 | 199                              | 0,05                      |                                                                |                                     | 190 219                          | 45,36                     |
| 3,875 % éch. 01/02/2029            | 500                                 | 407                              | 0,10                      | 4,263 % éch. 25/04/2036                              | 504                                 | 165                              | 0,04                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     | 94 663                           | 22,57                     | 5,224 % éch. 25/01/2036                              | 7                                   | 6                                | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS    |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/05/2036                              | 128                                 | 61                               | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| AIT Worldwide Logistics, Inc.      |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/02/2037                              | 851                                 | 294                              | 0,07                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,913 % éch. 29/04/2033            | 400                                 | 401                              | 0,10                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                              | 183                                 | 86                               | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Alliant Holdings Intermediate LLC  |                                     |                                  |                           | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust    |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 19/09/2031            | 500                                 | 494                              | 0,12                      | 4,050 % éch. 25/03/2037                              | 6                                   | 6                                | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Amentum Holdings, Inc.             |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/04/2046                              | 1 715                               | 471                              | 0,11                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 5,394 % - 7,500 % éch.             |                                     |                                  |                           | 4,704 % éch. 25/04/2046                              | 17                                  | 4                                | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 29/09/2031                         | 184                                 | 184                              | 0,04                      | 6,000 % éch. 25/12/2036                              | 333                                 | 144                              | 0,03                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Columbus McKinnon Corp.            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2037                              | 65                                  | 20                               | 0,01                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,232 % éch. 03/02/2033            | 264                                 | 264                              | 0,06                      | 6,500 % éch. 25/11/2036                              | 99                                  | 24                               | 0,01                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Cotiviti Corp.                     |                                     |                                  |                           | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,370 % éch. 01/05/2031            | 884                                 | 811                              | 0,19                      | 6,500 % éch. 25/04/2033                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Discovery Global Holdings, Inc.    |                                     |                                  |                           | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates          |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 03/06/2033            | 1 569                               | 1 572                            | 0,38                      | 3,500 % éch. 26/04/2038                              | 18                                  | 17                               | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Finastra USA, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 4,972 % éch. 27/09/2035                              | 56                                  | 50                               | 0,01                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,746 % éch. 15/09/2032            | 499                                 | 461                              | 0,11                      | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust            |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 6,060 % éch. 25/09/2035                              | 8                                   | 8                                | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | HarborView Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                    |                                     |                                  |                           | 4,194 % éch. 19/05/2035                              | 116                                 | 113                              | 0,03                      |                                                                |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>      |                                     |                                  |                           | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                    |           |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien |                                     |                                  |                           | 21,625 % éch.                       |                                     |                                  |                           | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>         |           |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 09/12/2020 ^                             | \$ 241                              | \$ 103                           | 0,02                      | 11/08/2026 (d)(e)                   | NGN 144 400                         | \$ 103                           | 0,02                      | PIMCO Funds: Global Investors                    |           |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 31/03/2038 ^                             | 550                                 | 242                              | 0,06                      | 21,690 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Series plc - Fonds US Short-Term Fund (h)        | 1 332 152 | \$ 13 681                        | 3,26                      |
| 7,750 % éch. 13/10/2019 ^                             | 1 900                               | 845                              | 0,20                      | 07/07/2026 (d)(e)                   | 72 200                              | 52                               | 0,01                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds                   |           |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 13/10/2024 ^                             | 74                                  | 34                               | 0,01                      | 21,699 % éch.                       |                                     |                                  |                           | PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | 396 994   | 3 959                            | 0,95                      |
| 9,250 % éch. 15/09/2027 ^                             | 179                                 | 88                               | 0,02                      | 25/08/2026 (d)(e)                   | 43 300                              | 31                               | 0,01                      |                                                  |           |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 07/05/2028 ^                             | 226                                 | 109                              | 0,03                      | 21,704 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                                  |           |                                  |                           |
| 11,750 % éch. 21/10/2026 ^                            | 50                                  | 28                               | 0,01                      | 01/09/2026 (d)(e)                   | 43 300                              | 30                               | 0,01                      |                                                  |           |                                  |                           |
| 11,950 % éch. 05/08/2031 ^                            | 181                                 | 99                               | 0,02                      | 21,883 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                                  |           |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 30/06/2026 (d)(e)                   | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Total des Fonds d'investissement                 |           | \$ 17 640                        | 4,21                      |
|                                                       |                                     | 1 548                            | 0,37                      |                                     |                                     | 216                              | 0,05                      |                                                  |           |                                  |                           |
| Total Venezuela                                       |                                     | 2 863                            | 0,68                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                                  |           |                                  |                           |
| <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                      |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN</b>  |                                     |                                  |                           |                                                  |           |                                  |                           |
| <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                        |                                     |                                  |                           | 7,304 % éch. 19/08/2026 (d)(e)      | ZAR 9 000                           | 545                              | 0,13                      |                                                  |           |                                  |                           |
| 23,650 % éch. 13/10/2026 (d)(e)                       | EGP 1 300                           | 25                               | 0,01                      | Total des Instruments à court terme |                                     | 826                              | 0,20                      |                                                  |           |                                  |                           |
| 24,000 % éch. 13/10/2026 (d)(e)                       | 1 700                               | 32                               | 0,01                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                                  |           |                                  |                           |
| 24,060 % éch. 20/10/2026 (d)(e)                       | 400                                 | 8                                | 0,00                      | Total des Valeurs mobilières        |                                     | \$ 417 507                       | 99,55                     |                                                  |           |                                  |                           |
|                                                       |                                     | 65                               | 0,02                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                                  |           |                                  |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026              | 23                    | \$ 25                                   | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Long  | 09/2026              | 74                    | 48                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 29                    | 42                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 6                     | 15                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 19                    | (10)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026              | 41                    | 4                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 268                   | (77)                                    | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Court | 09/2026              | 28                    | (7)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 379                   | 280                                     | 0,07                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 260                   | 346                                     | 0,08                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 125                   | 377                                     | 0,09                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026              | 45                    | 97                                      | 0,02                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ 1 140                                | 0,27                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                        |       |                      |                       | \$ 1 140                                | 0,27                   |

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence             | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| AT&T, Inc.                      | 1,000 %                 | 20/06/2028         | \$ 300                              | \$ 5                                    | 0,00                   |
| Boeing Co.                      | 1,000                   | 20/12/2026         | 500                                 | 0                                       | 0,00                   |
| Carnival Corp.                  | 1,000                   | 20/12/2028         | 400                                 | 96                                      | 0,02                   |
| Charter Communications, Inc.    | 5,000                   | 20/12/2030         | 300                                 | (4)                                     | 0,00                   |
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000                   | 20/12/2026         | 100                                 | 1                                       | 0,00                   |
| Glencore Finance Europe Ltd.    | 5,000                   | 20/06/2031         | € 500                               | (1)                                     | 0,00                   |
| Venture Global LNG, Inc.        | 5,000                   | 20/06/2031         | \$ 700                              | 2                                       | 0,00                   |
|                                 |                         |                    |                                     | \$ 99                                   | 0,02                   |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/12/2030         | \$ 1 825                            | \$ 34                                   | 0,01                   |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 9 850                               | 118                                     | 0,03                   |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 3 357                               | 5                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/06/2031         | 19 206                              | 338                                     | 0,08                   |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2030         | 4 960                               | (2)                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 30 045                              | 68                                      | 0,01                   |
|                                |                         |                    |                                     | \$ 561                                  | 0,13                   |

# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %   | 18/03/2028      | £ 1 900           | \$ 3                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 870               | 22                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500     | 18/03/2056      | 450               | 23                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,000     | 15/06/2027      | \$ 33 300         | (2 707)                           | (0,65)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,000     | 16/12/2030      | 22 300            | 2 812                             | 0,67                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 21/06/2028      | 66 800            | (610)                             | (0,14)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 18/06/2030      | 82 550            | 688                               | 0,16                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 19/03/2035      | 68 875            | 202                               | 0,05                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 18/06/2055      | 7 275             | (23)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,551     | 17/09/2035      | 600               | 24                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,715     | 15/08/2035      | 3 687             | 68                                | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2029      | 5 000             | 175                               | 0,04                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/09/2035      | 4 200             | 81                                | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/12/2035      | 9 800             | 206                               | 0,05                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,842     | 04/03/2030      | 400               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,870     | 05/03/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,874     | 05/03/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,884     | 25/03/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,890     | 03/03/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,899     | 11/03/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,905     | 12/03/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,908     | 04/03/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,930     | 24/03/2035      | 3 050             | 86                                | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,975     | 21/03/2035      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000     | 26/02/2035      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000     | 15/02/2036      | 13 500            | 58                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000     | 18/03/2036      | 8 775             | 98                                | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,221     | 15/11/2052      | 38 325            | (86)                              | (0,02)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 12,820    | 02/01/2029      | BRL 4 600         | (22)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 12,867    | 02/01/2031      | 6 700             | (42)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 12,905    | 02/01/2029      | 900               | (4)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,015    | 02/01/2031      | 3 900             | (20)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an                | 13,245    | 02/01/2031      | 700               | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an                | 13,255    | 02/01/2031      | 5 200             | (18)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,258    | 02/01/2029      | 10 200            | (34)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,291    | 02/01/2029      | 8 200             | (36)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,320    | 02/01/2029      | 8 900             | (32)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,435    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,440    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an                | 13,560    | 02/01/2031      | 600               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,681    | 02/01/2031      | 4 500             | (6)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,725    | 02/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,926    | 04/01/2027      | 1 600             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                | 13,927    | 04/01/2027      | 12 400            | (20)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | JIBAR ZAR à 3 mois             | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR 4 100         | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois          | 4,250     | 18/03/2036      | AUD 3 900         | (131)                             | (0,03)              |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | BBR-BBSW AUD à 6 mois          | 4,750     | 20/12/2033      | 7 000             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,365     | 28/11/2029      | CZK 17 800        | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,575     | 03/07/2030      | 15 973            | (11)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,250     | 16/09/2028      | € 11 550          | 119                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,350     | 29/04/2030      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,400     | 09/04/2030      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,450     | 05/05/2035      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,500     | 16/09/2031      | 23 200            | (40)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,520     | 09/04/2035      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,550     | 16/04/2035      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,750     | 16/09/2036      | 6 200             | (26)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois           | 3,000     | 16/09/2056      | 3 490             | (1)                               | 0,00                |
|                                                    |                                |           |                 |                   | \$ 816                            | 0,20                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                |           |                 |                   | \$ 1 476                          | 0,35                |

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

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

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

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

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

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| MYI          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | HUF 378,000     | 26/11/2026        | 363                              | \$ (5) | \$ (3)       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                    | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement brésilien    | 1,000 %              | 20/12/2028      | \$ 400                           | \$ (8)                 | \$ 11                            | \$ 3         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen     | 1,000                | 20/12/2030      | 400                              | (6)                    | 9                                | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/06/2028      | 500                              | (44)                   | 49                               | 5            | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement brésilien    | 1,000                | 20/12/2028      | 1 300                            | (25)                   | 34                               | 9            | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/12/2026      | 325                              | 7                      | 0                                | 7            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement indonésien   | 1,000                | 20/06/2031      | 2 200                            | (94)                   | 105                              | 11           | 0,00                |
| GST          | ADLER Real Estate AG                                   | 5,000                | 20/12/2026      | € 700                            | (4)                    | 17                               | 13           | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/06/2027      | \$ 200                           | 3                      | 4                                | 7            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien   | 5,000                | 20/06/2027      | 400                              | 13                     | 2                                | 15           | 0,01                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                                  | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 4 000                          | (2)                    | 1                                | (1)          | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/12/2026      | \$ 200                           | 4                      | 0                                | 4            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/06/2027      | 200                              | 2                      | 5                                | 7            | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                                  | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 6 000                          | (4)                    | 1                                | (3)          | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                    | 1,000                | 20/06/2027      | \$ 400                           | (5)                    | 5                                | 0            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/06/2028      | 2 200                            | (128)                  | 151                              | 23           | 0,01                |
|              |                                                        |                      |                 |                                  | \$ (291)               | \$ 394                           | \$ 103       | 0,02                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 1 300                          | \$ 296                 | \$ (18)                          | \$ 278       | 0,07                |

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 4 114             | \$ 2 942           | \$ 92                 | \$ 0                                    | 0,02                |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 271               | 40                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 363             | 805                | 30                    | 0                                       | 0,01                |      |
|              | 07/2026           | \$              | 25                | CAD 35             | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 691               | NZD 1 223          | 5                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | CAD             | 35                | \$ 25              | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
| BOA          | 08/2026           | NZD             | 1 223             | 692                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | BRL             | 52                | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | £               | 69                | 93                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | KRW             | 18 842            | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | \$              | 208               | CNH 1 406          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 10                | ¥ 1 532            | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 11                | NOK 105            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 24                | PLN 91             | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 283               | \$ 95              | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | ZAR             | 8 711             | 500                | 0                     | (29)                                    | (0,01)              |      |
|              | 09/2026           | KZT             | 4 566             | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | MXN             | 423               | 24                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | \$              | 101               | INR 9 608          | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | BPS               | 07/2026         | BRL               | 3 114              | \$ 611                | 9                                       | 0                   | 9    |
| 07/2026      |                   | CAD             | 596               | 431                | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,00 |
| 07/2026      |                   | CHF             | 184               | 234                | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | CNH             | 1 271             | 188                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | CZK             | 156               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | €               | 1 236             | 1 410              | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | £               | 1 002             | 1 333              | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | IDR             | 23 812 699        | 1 329              | 1                     | (1)                                     | 0                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | ILS             | 409               | 139                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
| 07/2026      |                   | INR             | 43 221            | 450                | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00 |



# Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | KRW             | 102 189   | \$ 67             | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 6 298     | 192               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 285       | BRL 1 473         | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 568       | £ 423             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 271     | INR 120 551       | 2                  | (2)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 33        | ¥ 5 182           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 328       | KRW 503 070       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 36        | KWD 11            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 163       | TWD 5 139         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 4 378     | \$ 267            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 84        | 28                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 1 249 775 | 343               | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 2 497 170 | 138               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 5 431     | 167               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 783       | IDR 13 866 125    | 1                  | (15)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 56        | INR 5 306         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 30        | THB 982           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 89        | IDR 1 618 740     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 05/2030           | KWD             | 163       | \$ 560            | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,01                |
|              | 06/2031           |                 | 13        | 43                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ILS             | 501       | 169               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 979     | 1 171             | 45                 | 0                     | 45                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 676       | TRY 32 179        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ZAR             | 21 623    | \$ 1 331          | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 542       | 632               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 272       | € 234             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 173       | ¥ 27 458          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 197     | NZD 2 119         | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 2 119     | \$ 1 198          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| CBK          | 09/2026           | \$              | 4 345     | BRL 22 288        | 0                  | (104)                 | (104)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | ILS             | 456       | \$ 157            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 27 373    | 290               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 579     | € 1 362           | 0                  | (22)                  | (22)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 105       | HUF 32 150        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 256       | IDR 4 591 514     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 282       | INR 27 373        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 30        | KRW 44 805        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7         | KZT 3 501         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 45        | PLN 165           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 58        | TWD 1 841         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 215     | \$ 425            | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 71        | ILS 211           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 9 410 920 | \$ 521            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 2 896     | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 5 425     | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 6 617     | 200               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 176       | IDR 3 141 548     | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 4         | PEN 15            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 5 252     | \$ 1 503          | 0                  | (28)                  | (28)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | \$              | 265       | IDR 4 825 027     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 01/2027           | PEN             | 2 190     | \$ 643            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 629 695   | 35                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 7 995     | 85                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 56        | INR 5 450         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 264       | KZT 141 729       | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 28        | NOK 260           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 45        | PLN 168           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 10 055    | \$ 621            | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 23        | KZT 12 282        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 5 847 845 | \$ 325            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 108       | IDR 1 963 405     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 85        | INR 8 049         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2         | PEN 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | UZS             | 742 726   | \$ 58             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 3 973     | 1 164             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 1 449 196 | 114               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 972 342   | 75                | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 1 264     | 187               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 7 017     | 9 436             | 124                | 0                     | 124                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | INR             | 18 580    | 197               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 200 454   | 1 239             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 4 283     | 3 357             | 46                 | 0                     | 46                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 521       | CNH 3 545         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 195       | INR 18 580        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 533       | PLN 1 950         | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 14 324    | \$ 868            | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 3 537     | 521               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 900       | 314               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 239     | ¥ 199 930         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 95        | INR 9 116         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | BRL             | 8         | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 106 567   | 69                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 205     | BRL 6 080         | 0                  | (30)                  | (30)                                    | (0,01)              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |     |      |     |       |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|-----|------|-----|-------|--------|
| JPM          | 07/2026           | \$              | 2 370             | CAD                | 3 372                 | \$                                      | 7                   | \$  | 0    | \$  | 7     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 245               | IDR                | 4 388 511             |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 69                | KRW                | 106 552               |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 139               | KZT                | 75 017                |                                         | 17                  |     | 0    |     | 17    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 268               | TRY                | 12 716                |                                         | 3                   |     | 0    |     | 3     | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 3 368             | \$                 | 2 370                 |                                         | 0                   |     | (7)  |     | (7)   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 44                | INR                | 4 248                 |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 4 414 211         | \$                 | 245                   |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 15 449            |                    | 479                   |                                         | 11                  |     | 0    |     | 11    | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 504               | IDR                | 9 054 731             |                                         | 1                   |     | (3)  |     | (2)   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 225               | INR                | 21 692                |                                         | 2                   |     | 0    |     | 2     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 100               | MXN                | 1 741                 |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 238               | COP                | 925 641               |                                         | 21                  |     | 0    |     | 21    | 0,01   |
|              | 07/2026           | AUD             | 16 385            | \$                 | 11 679                |                                         | 329                 |     | 0    |     | 329   | 0,08   |
|              | 07/2026           | BRL             | 5 823             |                    | 1 132                 |                                         | 7                   |     | 0    |     | 7     | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 10                |                    | 14                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 283             |                    | 430                   |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 7 263             |                    | 77                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 32 931            |                    | 21                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 737               |                    | 74                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 188             | HUF                | 359 660               |                                         | 0                   |     | (33) |     | (33)  | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 37                | IDR                | 672 936               |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 77                | INR                | 7 263                 |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 21                | KRW                | 32 927                |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 056             | PLN                | 3 851                 |                                         | 0                   |     | (32) |     | (32)  | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 139               | THB                | 4 630                 |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 6 444             | \$                 | 397                   |                                         | 4                   |     | 0    |     | 4     | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 375             |                    | 821                   |                                         | 23                  |     | 0    |     | 23    | 0,01   |
|              | 08/2026           | \$              | 74                | NOK                | 737                   |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 676 675           | \$                 | 37                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | KZT             | 47 199            |                    | 93                    |                                         | 0                   |     | (3)  |     | (3)   | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 423               |                    | 24                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 12 622            |                    | 386                   |                                         | 5                   |     | (1)  |     | 4     | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 572               | INR                | 54 544                |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 3 671             | MXN                | 63 822                |                                         | 0                   |     | (41) |     | (41)  | (0,01) |
|              | 10/2026           |                 | 1 132             | BRL                | 5 952                 |                                         | 0                   |     | (7)  |     | (7)   | 0,00   |
|              | 10/2026           | UZS             | 272 069           | \$                 | 21                    |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 12/2026           | MXN             | 214               |                    | 12                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 06/2027           | UZS             | 104 035           |                    | 8                     |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | MBC               | 07/2026         | AUD               | 74                 |                       | 53                                      |                     | 2   |      | 0   |       | 2      |
| 07/2026      |                   | CHF             | 1 479             |                    | 1 878                 |                                         | 46                  |     | (2)  |     | 44    | 0,01   |
| 07/2026      |                   | €               | 4 415             |                    | 5 114                 |                                         | 66                  |     | 0    |     | 66    | 0,02   |
| 07/2026      |                   | IDR             | 60 410            |                    | 3                     |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | INR             | 8 026             |                    | 85                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | KRW             | 324 282           |                    | 214                   |                                         | 4                   |     | 0    |     | 4     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | NOK             | 238               |                    | 24                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | \$              | 8 053             | AUD                | 11 654                |                                         | 30                  |     | (9)  |     | 21    | 0,01   |
| 07/2026      |                   |                 | 755               | €                  | 658                   |                                         | 3                   |     | (6)  |     | (3)   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 131               | INR                | 12 631                |                                         | 2                   |     | 0    |     | 2     | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 626               | ¥                  | 99 685                |                                         | 0                   |     | (13) |     | (13)  | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 67                | NOK                | 618                   |                                         | 0                   |     | (4)  |     | (4)   | 0,00   |
| 08/2026      |                   | AUD             | 10 992            | \$                 | 7 580                 |                                         | 0                   |     | (31) |     | (31)  | (0,01) |
| 08/2026      |                   | \$              | 24                | NOK                | 238                   |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| 09/2026      |                   | THB             | 3 995             | \$                 | 120                   |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
| 09/2026      |                   | \$              | 301               | INR                | 28 766                |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | €               | 480               | \$                 | 548                   |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
| 07/2026      |                   | £               | 45                |                    | 60                    |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | \$              | 294               | £                  | 222                   |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
| NSL          |                   | 11/2026         | HUF               | 23 926             | €                     | 66                                      |                     | 0   |      | 0   |       | 0      |
|              | 07/2026           | \$              | 228               | IDR                | 4 062 098             |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 133               | INR                | 12 749                |                                         | 2                   |     | 0    |     | 2     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 161               | TRY                | 7 572                 |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| SCX          | 09/2026           | IDR             | 4 084 879         | \$                 | 228                   |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 108               | IDR                | 1 917 980             |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 278               | \$                 | 317                   |                                         | 0                   |     | (1)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 87                | IDR                | 1 560 838             |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
| SOG          | 07/2026           |                 | 174               | INR                | 16 717                |                                         | 2                   |     | 0    |     | 2     | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 110               |                    | 10 552                |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 7                 | KZT                | 3 746                 |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 63                | NGN                | 92 744                |                                         | 3                   |     | 0    |     | 3     | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 4 618 921         | \$                 | 256                   |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | KZT             | 1 559             |                    | 3                     |                                         | 0                   |     | 0    |     | 0     | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 5 495             |                    | 170                   |                                         | 4                   |     | 0    |     | 4     | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 275               | IDR                | 4 933 093             |                                         | 1                   |     | (2)  |     | (1)   | 0,00   |
|              | 11/2026           |                 | 250               | NGN                | 373 397               |                                         | 7                   |     | 0    |     | 7     | 0,00   |
|              | 02/2027           |                 | 264               |                    | 397 849               |                                         | 2                   |     | 0    |     | 2     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 2 145             | \$                 | 317                   |                                         | 1                   |     | 0    |     | 1     | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 65 220            |                    | 76 081                |                                         | 1 516               |     | 0    |     | 1 516 | 0,36   |
| 07/2026      | \$                | 6 154           | AUD               | 8 918              |                       | 25                                      |                     | 0   |      | 25  | 0,01  |        |
| 07/2026      |                   | 2 131           | CHF               | 1 724              |                       | 6                                       |                     | 0   |      | 6   | 0,00  |        |
| 07/2026      |                   | 78 615          | €                 | 69 112             |                       | 402                                     |                     | 0   |      | 402 | 0,10  |        |
| 07/2026      |                   | 419             | ¥                 | 66 623             |                       | 0                                       |                     | (9) |      | (9) | 0,00  |        |
| 07/2026      |                   | 3 312           | SGD               | 4 290              |                       | 4                                       |                     | 0   |      | 4   | 0,00  |        |

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SSB          | 08/2026           | AUD             | 8 918             | \$ 6 150           | \$ 0                  | \$ (25)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CHF             | 1 718             | 2 131              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 69 112            | 78 722             | 0                     | (401)                                   | (0,10)              |
|              | 08/2026           | KZT             | 17 424            | 36                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 4 280             | 3 312              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 2 870             | 2 081              | 58                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF             | 61                | 77                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 225               | 1 146              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 22                | CAD 31             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 146            | £ 7 676            | 41                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD             | 31                | \$ 22              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 12 135 061        | 3 181              | 0                     | (302)                                   | (0,07)              |
|              | 08/2026           | €               | 278               | 317                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 7 676             | 10 146             | 0                     | (41)                                    | (0,01)              |
| UAG          | 07/2026           | \$              | 46                | PLN 168            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 522               | \$ 30              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 760               | 23                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | 8 295 803         | 2 126              | 0                     | (189)                                   | (0,04)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 226           | \$ (1 528)            | \$ 1 698                                | 0,40                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 688               | € 591              | \$ 0                  | \$ (12)                                 | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | €               | 5 703             | \$ 6 490           | 0                     | (30)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 60 341            | € 51 808           | 3                     | (1 110)                                 | (0,26)              |
| BSH          | 07/2026           |                 | 56 818            | 48 736             | 0                     | (1 098)                                 | (0,26)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 1 845             | 1 582              | 0                     | (36)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | €               | 48 569            | \$ 55 393          | 0                     | (136)                                   | (0,03)              |
| MBC          | 08/2026           | \$              | 55 468            | € 48 569           | 136                   | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | €               | 54 268            | \$ 61 664          | 9                     | (390)                                   | (0,09)              |
|              | 07/2026           | \$              | 3 854             | € 3 326            | 0                     | (51)                                    | (0,01)              |
| SOG          | 08/2026           |                 | 60 222            | 52 946             | 391                   | 0                                       | 0,09                |
|              | 07/2026           | €               | 51 979            | \$ 59 126          | 0                     | (302)                                   | (0,07)              |
|              | 07/2026           | \$              | 59 700            | € 51 177           | 0                     | (1 189)                                 | (0,28)              |
| SSB          | 08/2026           |                 | 59 206            | 51 979             | 301                   | 0                                       | 0,07                |
|              | 07/2026           |                 | 3 762             | 3 299              | 10                    | 10                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 3 299             | \$ 3 767           | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 850             | \$ (4 365)            | \$ (3 515)                              | (0,83)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$              | 38 058            | £ 28 348           | \$ 0                  | \$ (433)                                | (0,10)              |
| BOA                                                | 07/2026           |                 | 33                | 25                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | £               | 26 902            | \$ 35 480          | 1                     | (227)                                   | (0,05)              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 44 447            | £ 33 174           | 5                     | (422)                                   | (0,10)              |
|                                                    | 08/2026           |                 | 35 439            | 26 873             | 227                   | 0                                       | 0,05                |
| BRC                                                | 07/2026           |                 | 274               | 208                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK                                                | 07/2026           | £               | 18                | \$ 24              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 180               | £ 134              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | £               | 14                | \$ 18              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 2 200             | £ 1 636            | 0                     | (29)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           |                 | 18                | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           |                 | 42 082            | 31 361             | 0                     | (458)                                   | (0,11)              |
| MBC                                                | 07/2026           |                 | 223               | 167                | 1                     | (2)                                     | 0,00                |
| MYI                                                | 07/2026           |                 | 346               | 257                | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £               | 5 765             | \$ 7 587           | 0                     | (65)                                    | (0,02)              |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 7 586             | £ 5 765            | 65                    | 0                                       | 0,02                |
| SCX                                                | 07/2026           | £               | 30 965            | \$ 40 986          | 0                     | (113)                                   | (0,03)              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 227               | £ 170              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           |                 | 40 984            | 30 965             | 114                   | 0                                       | 0,03                |
| SOG                                                | 07/2026           | £               | 30 953            | \$ 40 889          | 0                     | (193)                                   | (0,05)              |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 40 887            | £ 30 953           | 194                   | 0                                       | 0,05                |
| SSB                                                | 07/2026           | £               | 841               | \$ 1 111           | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 1 111             | £ 841              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 612             | \$ (1 956)            | \$ (1 344)                              | (0,32)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (2 783)                              | (0,66)              |

| DESCRIPTION                                                                              | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                                          |                                  |                                  |                           |
| ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC<br>2,700 % éch. 11/06/2023 <sup>^</sup> | € 2 800                          | \$ 192                           | 0,05                      |
| <b>Total des Autres actifs financiers</b>                                                |                                  | <b>\$ 192</b>                    | <b>0,05</b>               |
| <b>Total des Investissements</b>                                                         |                                  | <b>\$ 435 172</b>                | <b>103,77</b>             |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b>                                            |                                  | <b>\$ (15 793)</b>               | <b>(3,77)</b>             |
| <b>Actif net</b>                                                                         |                                  | <b>\$ 419 379</b>                | <b>100,00</b>             |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- <sup>^</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (d) Titre à coupon zéro.
- (e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (f) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (g) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (h) Affilié au Fonds.
- (i) Titre convertible conditionnel.
- (j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,38 %) :

| Description de l'émetteur                                                   | Date d'achat | Coût            | Juste valeur    | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|---------------------|
| Banco Nacional de Mexico S.A, 6,697 % éch. 07/08/2036                       | 30/04/2026   | \$ 400          | \$ 394          | 0,09                |
| Corestate Capital Holding S.A.                                              | 22/08/2023   | 0               | 0               | 0,00                |
| DrillCo Holding Lux S.A.                                                    | 08/06/2023   | 1 233           | 1 413           | 0,34                |
| Flora Food Management BV 7,500 % éch. 31/10/2030                            | 20/01/2026   | 352             | 342             | 0,08                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït 4,804 % éch. 20/04/2033 | 13/04/2026   | 1 400           | 1 398           | 0,33                |
| Mahle GmbH 7,125 % éch. 15/07/2032                                          | 10/06/2026   | 483             | 483             | 0,12                |
|                                                                             |              | <b>\$ 3 868</b> | <b>\$ 4 030</b> | <b>0,96</b>         |

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 3 325 \$ (31 décembre 2025 : 2 080 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 16 902 \$ (31 décembre 2025 : 14 345 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 4 000 \$ (31 décembre 2025 : 320 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 29                                                                             | \$ 412 428                                           | \$ 5 050                                          | \$ 417 507        |
| Fonds d'investissement                        | 17 640                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 17 640            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 221                                                                               | (388)                                                | 0                                                 | (167)             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 192                                                  | 0                                                 | 192               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 17 890</b>                                                                  | <b>\$ 412 232</b>                                    | <b>\$ 5 050</b>                                   | <b>\$ 435 172</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 386 037                                           | \$ 4 795                                          | \$ 390 832        |
| Fonds d'investissement                        | 33 413                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 33 413            |
| Contrats de mise en pension                   | (56)                                                                              | 4 630                                                | 3                                                 | 4 577             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 493                                                  | 0                                                 | 493               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 33 357</b>                                                                  | <b>\$ 391 160</b>                                    | <b>\$ 4 798</b>                                   | <b>\$ 429 315</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 1,850 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (204)          | \$ (234)                                 | (0,06)              |
| BRC                                           | 3,450          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (544)         | (554)                                    | (0,13)              |
| MYI                                           | 1,250          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (379)          | (434)                                    | (0,10)              |
|                                               | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (315)            | (360)                                    | (0,09)              |
|                                               | 2,150          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (501)         | (502)                                    | (0,12)              |
|                                               | 3,470          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (517)            | (517)                                    | (0,12)              |
|                                               | 3,490          | 10/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (255)            | (257)                                    | (0,06)              |
| RCE                                           | 1,950          | 26/01/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (301)            | (303)                                    | (0,07)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (3 161)</b>                        | <b>(0,75)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (311)                                                   | \$ 430                  | \$ 119                            | \$ 911                                                     | \$ (1 000)              | \$ (89)                           |
| BOA          | 247                                                        | (270)                   | (23)                              | 276                                                        | (330)                   | (54)                              |
| BPS          | (1 529)                                                    | 1 690                   | 161                               | (14)                                                       | 0                       | (14)                              |
| BRC          | 83                                                         | 0                       | 83                                | 1 596                                                      | (1 820)                 | (224)                             |
| BSH          | (1 199)                                                    | 1 420                   | 221                               | 4                                                          | 60                      | 64                                |
| CBK          | (61)                                                       | 0                       | (61)                              | 52                                                         | 0                       | 52                                |
| DUB          | 32                                                         | 0                       | 32                                | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| FAR          | 139                                                        | 0                       | 139                               | (297)                                                      | 260                     | (37)                              |
| GLM          | 22                                                         | 0                       | 22                                | (17)                                                       | 0                       | (17)                              |
| GST          | 13                                                         | 0                       | 13                                | 18                                                         | 0                       | 18                                |
| JPM          | (188)                                                      | 170                     | (18)                              | (6)                                                        | 0                       | (6)                               |
| MBC          | 46                                                         | 0                       | 46                                | 537                                                        | (580)                   | (43)                              |
| MYC          | 31                                                         | 0                       | 31                                | 19                                                         | 0                       | 19                                |
| MYI          | (7)                                                        | (10)                    | (17)                              | 1                                                          | (10)                    | (9)                               |
| NSL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| SCX          | 17                                                         | 0                       | 17                                | 14                                                         | 0                       | 14                                |
| SOG          | 320                                                        | (260)                   | 60                                | 685                                                        | (800)                   | (115)                             |
| SSB          | (249)                                                      | 290                     | 41                                | 80                                                         | 0                       | 80                                |
| UAG          | (190)                                                      | 0                       | (190)                             | (106)                                                      | 0                       | (106)                             |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 37,17            | 33,45                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 40,89            | 37,73                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,58             | 0,75                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,32             | 6,15                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,23             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 1,01             | 0,95                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,96             | 1,02                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,04             | 0,09                 |
| Autres actifs                                                    | 15,80            | 19,85                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Angola                            | 0,29             | 0,14                 |
| Argentine                         | 1,05             | 1,15                 |
| Australie                         | 3,45             | 1,80                 |
| Autriche                          | 0,19             | 0,19                 |
| Azerbaïdjan                       | S/O              | 0,21                 |
| Bahrein                           | 0,19             | S/O                  |
| Belgique                          | 0,16             | 0,18                 |
| Bénin                             | 0,16             | S/O                  |
| Bermudes                          | 0,94             | 0,56                 |
| Brésil                            | 0,36             | 0,62                 |
| Bulgarie                          | 0,15             | 0,17                 |
| Cameroun                          | 0,20             | 0,12                 |
| Canada                            | 0,75             | 1,08                 |
| Îles Caïmans                      | 2,27             | 1,69                 |
| Chili                             | 0,25             | 0,28                 |
| Chine                             | 0,01             | 0,02                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Colombie                                                                                                 | 1,74             | 1,61                 |
| Congo                                                                                                    | 0,19             | S/O                  |
| Congo, République démocratique du                                                                        | 0,10             | S/O                  |
| Costa Rica                                                                                               | 0,30             | 0,25                 |
| République tchèque                                                                                       | 0,17             | 0,19                 |
| République dominicaine                                                                                   | 0,52             | 0,42                 |
| Équateur                                                                                                 | 0,40             | 0,40                 |
| Égypte                                                                                                   | 0,89             | 0,88                 |
| Salvador                                                                                                 | 0,21             | 0,23                 |
| Finlande                                                                                                 | S/O              | 0,06                 |
| France                                                                                                   | 1,01             | 1,98                 |
| Gabon                                                                                                    | 0,10             | 0,10                 |
| Allemagne                                                                                                | 0,99             | 0,97                 |
| Ghana                                                                                                    | 0,24             | 0,29                 |
| Guatemala                                                                                                | 0,30             | 0,23                 |
| Guernesey, Îles Anglo-Normandes                                                                          | 0,11             | 0,12                 |
| Hongrie                                                                                                  | 0,45             | 0,69                 |
| Inde                                                                                                     | 0,24             | S/O                  |
| Indonésie                                                                                                | 0,95             | 0,71                 |
| Irlande                                                                                                  | 5,31             | 4,92                 |
| Île de Man                                                                                               | 0,19             | 0,27                 |
| Israël                                                                                                   | 0,19             | 0,13                 |
| Italie                                                                                                   | 1,26             | 1,48                 |
| Côte d'Ivoire                                                                                            | 0,54             | 0,39                 |
| Japon                                                                                                    | 0,33             | 0,29                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                             | 0,73             | S/O                  |
| Kazakhstan                                                                                               | 0,20             | 0,11                 |
| Kenya                                                                                                    | 0,28             | 0,31                 |
| Koweït                                                                                                   | 0,33             | S/O                  |
| Lettonie                                                                                                 | 0,11             | 0,12                 |
| Liban                                                                                                    | 0,07             | 0,07                 |
| Liberia                                                                                                  | 0,19             | 0,21                 |
| Luxembourg                                                                                               | 2,72             | 2,69                 |
| Mexique                                                                                                  | 2,98             | 2,73                 |
| Maroc                                                                                                    | 0,07             | 0,08                 |
| Multinationales                                                                                          | 0,37             | 0,24                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 2,23             | 2,03                 |
| Nigeria                                                                                                  | 0,44             | 0,43                 |
| Norvège                                                                                                  | 0,11             | 0,14                 |
| Oman                                                                                                     | 0,18             | 0,20                 |
| Pakistan                                                                                                 | 0,22             | 0,16                 |
| Panama                                                                                                   | 0,25             | 0,52                 |
| Paraguay                                                                                                 | 0,16             | S/O                  |
| Pérou                                                                                                    | 1,35             | 1,25                 |
| Pologne                                                                                                  | 0,45             | 0,37                 |
| Qatar                                                                                                    | 0,07             | S/O                  |
| Roumanie                                                                                                 | 0,66             | 0,75                 |
| Arabie saoudite                                                                                          | 0,86             | 0,82                 |
| Sénégal                                                                                                  | 0,13             | 0,17                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,35             | 0,28                 |
| Singapour                                                                                                | 0,20             | 0,22                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 1,41             | 1,37                 |
| Espagne                                                                                                  | 1,26             | 1,35                 |
| Sri Lanka                                                                                                | 0,17             | 0,18                 |
| Supranationales                                                                                          | 0,81             | 0,92                 |
| Suède                                                                                                    | 0,30             | S/O                  |
| Turquie                                                                                                  | 0,91             | 0,82                 |
| Ukraine                                                                                                  | 0,43             | 0,41                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,78             | 0,24                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 4,30             | 4,30                 |
| États-Unis                                                                                               | 45,36            | 53,56                |
| Ouzbékistan                                                                                              | 0,08             | 0,09                 |
| Venezuela                                                                                                | 0,68             | 0,37                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,20             | 0,34                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 4,21             | 8,78                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,27             | (0,05)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | 0,03                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,13             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,20             | 0,21                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | 0,02                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,07             | 0,08                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,40             | (0,39)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,15)           | 1,28                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,05             | 0,13                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (3,77)           | (12,78)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Diversified Income ESG Fund

| DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUITE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                      |                                     |                                  |                           | CHILI                                                               |                                     |                                  |                           | Vilmorin & Cie S.A.                                   |                                     |                                  |                           |      |
| ARGENTINE                                                                               |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch. 26/03/2028                               |                                     |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement chilien                   |                                     |                                  |                           | € 100                                                 |                                     |                                  |                           |      |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                                                                 | \$ 72                               | \$ 64                            | 0,14                      | 3,100 % éch. 07/05/2041 (h)                                         | \$ 300                              | \$ 230                           | 0,49                      | 781                                                   |                                     |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 09/07/2041                                                                 | 675                                 | 506                              | 1,08                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Total Argentine                                                                         |                                     | 570                              | 1,22                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| AUSTRALIE                                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                       |                                     |                                  |                           |      |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | Altice France S.A.                                    |                                     |                                  |                           |      |
| Allied Credit ABS Trust                                                                 | AUD                                 | 360                              | 249                       | 0,53                                                                | 5,750 % éch. 26/11/2034             | € 100                            | 116                       | 0,25                                                  | 10,548 % éch. 31/05/2031            | \$ 98                            | 100                       | 0,22 |
| 5,173 % éch. 17/09/2033                                                                 |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 02/02/2034                                             | \$ 100                              | 107                              | 0,23                      | Total France                                          |                                     | 881                              | 1,89                      |      |
| FirstMac Asset Funding Trust                                                            |                                     |                                  |                           | TES colombien                                                       |                                     |                                  |                           | ALLEMAGNE                                             |                                     |                                  |                           |      |
| 5,208 % éch. 19/09/2033                                                                 | 333                                 | 231                              | 0,50                      | 2,250 % éch. 18/04/2029 (c)                                         | COP 47 694                          | 13                               | 0,03                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                     |                                  |                           |      |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust                                             |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 25/03/2033 (c)                                         | 41 473                              | 10                               | 0,02                      | Amprion GmbH                                          |                                     |                                  |                           |      |
| 5,450 % éch. 22/11/2037                                                                 | 500                                 | 347                              | 0,74                      | 6,500 % éch. 22/01/2031 (c)                                         | 222 297                             | 64                               | 0,13                      | 3,875 % éch. 05/06/2036                               | € 100                               | 114                              | 0,24                      |      |
| Plenti PL & Green ABS Trust                                                             |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 26/03/2031                                             | 218 000                             | 52                               | 0,11                      | DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH |                                     |                                  |                           |      |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                                                                 | 372                                 | 258                              | 0,55                      | 11,000 % éch. 22/08/2029                                            | 683 500                             | 192                              | 0,41                      | 4,875 % éch. 21/08/2030                               | 100                                 | 117                              | 0,25                      |      |
|                                                                                         |                                     | 1 085                            | 2,32                      | 11,500 % éch. 25/07/2046                                            | 27 400                              | 8                                | 0,02                      | Mahle GmbH                                            |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 11,750 % éch. 24/01/2035                                            | 732 800                             | 209                              | 0,45                      | 7,125 % éch. 15/07/2032 (g)                           | 100                                 | 121                              | 0,26                      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 28/11/2040                                            | 367 900                             | 111                              | 0,24                      | Nidda Healthcare Holding GmbH                         |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 13,250 % éch. 09/02/2033                                            | 183 000                             | 56                               | 0,12                      | 5,625 % éch. 21/02/2030                               | 100                                 | 116                              | 0,25                      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Total Colombie                                                      |                                     | 938                              | 2,01                      | Volkswagen Bank GmbH                                  |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 26/11/2028                               |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | Total Allemagne                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | 583                                                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | 1,25                                                  |                                     |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | COSTA RICA                                                          |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                                                     |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 4,250 % éch. 03/05/2030                                                                 | € 125                               | 147                              | 0,32                      | Obligation internationale du gouvernement costaricain               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/04/2043                                             | \$ 150                              | 145                              | 0,31                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust                                                | AUD                                 | 480                              | 332                       | 0,71                                                                | 5,950 % éch. 27/04/2033             | € 250                            | 305                       | 0,65                                                  |                                     |                                  |                           |      |
| 5,300 % éch. 15/08/2057                                                                 |                                     |                                  |                           | Total Costa Rica                                                    |                                     | 450                              | 0,96                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Total Australie                                                                         |                                     | 1 564                            | 3,35                      | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE                                                  |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| AUTRICHE                                                                                |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | EPH Financing International A/S                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| ams-OSRAM AG                                                                            | €                                   | 100                              | 118                       | 0,25                                                                | 5,875 % éch. 30/11/2029             | 100                              | 122                       | 0,26                                                  |                                     |                                  |                           |      |
| 7,250 % éch. 31/05/2032                                                                 |                                     |                                  |                           | RÉPUBLIQUE DOMINICAINE                                              |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| BAHREÏN                                                                                 |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni                                      | \$ 200                              | 198                              | 0,42                      | 4,500 % éch. 30/01/2030                                             | \$ 100                              | 97                               | 0,21                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 7,125 % éch. 10/06/2036                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/02/2048                                             | 200                                 | 199                              | 0,42                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 6,600 % éch. 01/06/2036                                             | 250                                 | 261                              | 0,56                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Total République dominicaine                                        |                                     | 557                              | 1,19                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| BERMUDES                                                                                |                                     |                                  |                           | ÉQUATEUR                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| VOC Escrow Ltd.                                                                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement équatorien                |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 15/02/2028                                                                 | 100                                 | 100                              | 0,21                      | 6,900 % éch. 31/07/2035                                             | 304                                 | 280                              | 0,60                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| BRÉSIL                                                                                  |                                     |                                  |                           | ÉGYPTE                                                              |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                  |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 7,250 % éch. 12/01/2056                                                                 | 200                                 | 201                              | 0,43                      | 6,375 % éch. 11/04/2031                                             | € 400                               | 467                              | 1,00                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| BULGARIE                                                                                |                                     |                                  |                           | 19,698 % éch. 14/10/2030                                            | EGP 3 300                           | 64                               | 0,14                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | 21,954 % éch. 04/03/2028                                            | 6 400                               | 126                              | 0,27                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare                                       | € 50                                | 56                               | 0,12                      | Total Égypte                                                        |                                     | 657                              | 1,41                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 3,375 % éch. 18/07/2035                                                                 | 50                                  | 57                               | 0,12                      | SALVADOR                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 4,125 % éch. 07/05/2038                                                                 |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Total Bulgarie                                                                          |                                     | 113                              | 0,24                      | Obligation internationale du gouvernement salvadorien               |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 9,650 % éch. 21/11/2054                                             | \$ 125                              | 144                              | 0,31                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| CANADA                                                                                  |                                     |                                  |                           | FRANCE                                                              |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Air Canada Pass-Through Trust                                                           |                                     |                                  |                           | ARGAN S.A.                                                          |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 5,250 % éch. 01/10/2030                                                                 | \$ 241                              | 243                              | 0,52                      | 3,779 % éch. 30/10/2029                                             | € 100                               | 115                              | 0,25                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| ÎLES CAÏMANS                                                                            |                                     |                                  |                           | AXA S.A.                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 11/07/2043                                             |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                                                            | 100                                 | 98                               | 0,21                      | 9,250 % éch. 17/11/2027 (d)(f)                                      | \$ 200                              | 210                              | 0,45                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 4,950 % éch. 15/10/2032                                                                 |                                     |                                  |                           | 7,003 % éch. 19/10/2034                                             | 150                                 | 163                              | 0,35                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| QNB Finance Ltd.                                                                        | € 100                               | 111                              | 0,24                      | Électricité de France S.A.                                          |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| 3,000 % éch. 30/09/2030                                                                 |                                     |                                  |                           | 9,125 % éch. 15/03/2033 (d)                                         | 50                                  | 58                               | 0,12                      |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| Total Îles Caïmans                                                                      |                                     | 209                              | 0,45                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |      |



| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>CÔTE D'IVOIRE</b>                                                |                                     |                                  |                           | <b>MULTINATIONALES</b>                               |                                     |                                  |                           | <b>ROUMANIE</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement ivoirien                  |                                     |                                  |                           | JetBlue Airways Corp.                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/06/2033                                             | \$                                  | 100                              | \$ 99                     | 9,875 % éch. 20/09/2031                              | \$                                  | 50                               | \$ 45                     | 1,750 % éch. 13/07/2030                                | €                                   | 100                              | \$ 104                    |
| 7,625 % éch. 30/01/2033                                             |                                     | 200                              | 214                       |                                                      |                                     |                                  | 0,10                      | 5,250 % éch. 30/05/2032                                |                                     | 50                               | 58                        |
| Total Côte d'Ivoire                                                 |                                     |                                  | 313                       |                                                      |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 07/06/2033                                |                                     | 50                               | 58                        |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,67                      |                                                      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 22/02/2036                                |                                     | 200                              | 230                       |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/05/2037                                |                                     | 75                               | 85                        |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 16/09/2030                                | \$                                  | 100                              | 101                       |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Total Roumanie                                         |                                     | 636                              | 1,36                      |
| <b>JAPON</b>                                                        |                                     |                                  |                           | <b>PAYS-BAS</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>SÉNÉGAL</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Nissan Motor Co. Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | Cooperatieve Rabobank UA                             |                                     | 50                               | 47                        | Obligation internationale du gouvernement sénégalais   |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 17/07/2030                                             | 100                                 | 103                              | 0,22                      | Digital Dutch Finco BV                               | €                                   | 200                              | 198                       | 4,750 % éch. 13/03/2028                                | €                                   | 67                               | 43                        |
| Norinchukin Bank                                                    |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/01/2032                              |                                     |                                  | 0,42                      | 5,375 % éch. 08/06/2037                                |                                     | 100                              | 61                        |
| 5,094 % éch. 16/10/2029                                             | 100                                 | 101                              | 0,22                      | ENEL Finance International NV                        | \$                                  | 350                              | 312                       | Total Sénégal                                          |                                     | 104                              | 0,22                      |
| SoftBank Group Corp.                                                |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 12/07/2031                              |                                     |                                  | 0,67                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 10/07/2031                                             | €                                   | 100                              | 115                       | Flora Food Management BV                             | €                                   | 100                              | 114                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
| Total Japon                                                         |                                     |                                  | 319                       | 7,500 % éch. 31/10/2030 (g)                          | €                                   | 100                              | 114                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,68                      | IPD BV                                               |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,776 % éch. 15/06/2031                              |                                     | 125                              | 142                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | JDE Peet's NV                                        |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 24/09/2031                              | \$                                  | 50                               | 43                        |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                                 |                                     |                                  |                           | NE Property BV                                       | €                                   | 100                              | 113                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 30/09/2033                              |                                     |                                  | 0,24                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
| Aston Martin Capital Holdings Ltd.                                  | \$                                  | 25                               | 19                        | Universal Music Group NV                             |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 31/03/2029                                            |                                     |                                  | 0,04                      | 4,000 % éch. 13/06/2031                              |                                     | 100                              | 118                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
| Heathrow Funding Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | VZ Secured Financing BV                              | \$                                  | 150                              | 132                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 16/01/2038                                             | €                                   | 150                              | 170                       | 5,000 % éch. 15/01/2032                              |                                     |                                  | 0,28                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                                  |                                     |                                  | 189                       | ZF Europe Finance BV                                 | €                                   | 200                              | 227                       |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,40                      | 5,500 % éch. 17/02/2032                              |                                     |                                  | 0,49                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | Total Pays-Bas                                       |                                     | 1 446                            | 3,10                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>KAZAKHSTAN</b>                                                   |                                     |                                  |                           | <b>OMAN</b>                                          |                                     |                                  |                           | <b>SERBIE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement kazakh                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement omanais    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement serbe        |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 21/07/2045 (h)                                         | \$                                  | 200                              | 217                       | 6,750 % éch. 17/01/2048                              | \$                                  | 200                              | 220                       | 1,650 % éch. 03/03/2033                                |                                     | 200                              | 194                       |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,47                      |                                                      |                                     |                                  | 0,47                      | Total Serbie                                           |                                     | 194                              | 0,41                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>KENYA</b>                                                        |                                     |                                  |                           | <b>PANAMA</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>SINGAPOUR</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République du Kenya |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement panaméen   |                                     |                                  |                           | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.               |                                     |                                  |                           |
| 9,500 % éch. 05/03/2036                                             |                                     | 200                              | 213                       | 6,700 % éch. 26/01/2036                              |                                     | 325                              | 350                       | 5,026 % éch. 11/04/2043                                | \$                                  | 177                              | 177                       |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,46                      |                                                      |                                     |                                  | 0,75                      | Total Singapour                                        |                                     | 274                              | 0,59                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>KOWEÏT</b>                                                       |                                     |                                  |                           | <b>PARAGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït                 |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement paraguayen |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (g)                                         |                                     | 200                              | 200                       | 5,400 % éch. 30/03/2050                              |                                     | 100                              | 93                        | 4,850 % éch. 30/09/2029                                |                                     | 260                              | 258                       |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,43                      |                                                      |                                     |                                  | 0,20                      | 5,650 % éch. 27/09/2047                                |                                     | 60                               | 51                        |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 30/09/2049                                |                                     | 240                              | 204                       |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/02/2031                                | ZAR                                 | 100                              | 6                         |
| <b>LETTONIE</b>                                                     |                                     |                                  |                           | <b>PÉROU</b>                                         |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 31/01/2030                                |                                     | 700                              | 43                        |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 31/01/2037                                |                                     | 1 600                            | 97                        |
| Latvenergo A/S                                                      | €                                   | 100                              | 114                       | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.         |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 28/02/2035                                |                                     | 4 500                            | 285                       |
| 3,612 % éch. 13/11/2030                                             |                                     | 100                              | 115                       | 9,700 % éch. 05/03/2045                              | PEN                                 | 500                              | 157                       | 9,000 % éch. 31/01/2040                                |                                     | 200                              | 12                        |
| 4,162 % éch. 25/06/2033                                             |                                     | 100                              | 229                       |                                                      |                                     |                                  | 0,34                      | Total Afrique du Sud                                   |                                     | 956                              | 2,05                      |
| Total Lettonie                                                      |                                     |                                  | 0,49                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                                   |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>ESPAGNE</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| AXA Logistics Europe Master S.C.A.                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais   |                                     |                                  |                           | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                   |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 13/05/2031                                             | 100                                 | 113                              | 0,24                      | 4,875 % éch. 04/10/2033                              | \$                                  | 125                              | 125                       | 4,968 % éch. 08/05/2031                                | \$                                  | 75                               | 75                        |
| CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF                     |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 14/04/2036                              |                                     | 200                              | 202                       | 6,840 % éch. 13/09/2034                                |                                     | 100                              | 109                       |
| 3,500 % éch. 22/09/2032                                             | 100                                 | 112                              | 0,24                      | 5,500 % éch. 18/03/2054                              |                                     | 200                              | 189                       | Cellnex Finance Co. S.A.                               | €                                   | 100                              | 112                       |
| 3,875 % éch. 28/05/2031                                             | 100                                 | 115                              | 0,24                      | Total Pologne                                        |                                     |                                  | 1,11                      | 3,000 % éch. 19/01/2031                                |                                     | 100                              | 120                       |
| Froneri Lux FinCo SARL                                              |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Molins Finance S.A.                                    |                                     | 100                              | 120                       |
| 4,750 % éch. 01/08/2032                                             | 100                                 | 112                              | 0,24                      |                                                      |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/06/2033                                |                                     |                                  | 0,26                      |
| P3 Group SARL                                                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Total Espagne                                          |                                     | 416                              | 0,89                      |
| 4,000 % éch. 19/04/2032                                             | 100                                 | 115                              | 0,25                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| Total Luxembourg                                                    |                                     |                                  | 567                       |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  | 1,21                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>MEXIQUE</b>                                                      |                                     |                                  |                           | <b>PORTUGAL</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>SRI LANKA</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                   |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |                                     |                                  |                           | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A.    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sri-lankais  |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 12/10/2110                                             | \$                                  | 175                              | 143                       | 3,158 % éch. 23/12/2036                              | €                                   | 200                              | 229                       | 3,100 % éch. 15/01/2030                                | \$                                  | 41                               | 42                        |
| 6,400 % éch. 07/05/2054                                             |                                     | 75                               | 71                        |                                                      |                                     |                                  | 0,49                      | 3,350 % éch. 15/03/2033                                |                                     | 81                               | 78                        |
| Total Mexique                                                       |                                     |                                  | 214                       |                                                      |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/06/2035                                |                                     | 55                               | 46                        |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,46                      |                                                      |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/04/2028                                |                                     | 32                               | 31                        |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Total Sri Lanka                                        |                                     | 197                              | 0,42                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>MAROC</b>                                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | <b>SUPRANATIONALES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement marocain                  |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Union européenne                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/12/2032                                             |                                     | 200                              | 176                       |                                                      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 04/10/2039                                | €                                   | 100                              | 112                       |
|                                                                     |                                     |                                  | 0,38                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     | 112                              | 0,24                      |

# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |      |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|------|
| SUÈDE                                                                                   |                                     |                                  |                           | ÉTATS-UNIS                         |                                       |                                  |                           | Equinix Europe Financing Corp. LLC          |                                     |                                  |                           |      |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS        |                                       |                                  |                           | 4,600 % éch. 15/11/2030                     |                                     |                                  |                           |      |      |
| EQT AB                                                                                  |                                     |                                  |                           | Option One Mortgage Loan Trust     |                                       |                                  |                           | Ford Motor Co.                              |                                     |                                  |                           |      |      |
| 0,875 % éch. 14/05/2031                                                                 | €                                   | 300                              | \$ 301                    | 0,65                               | 4,263 % éch. 25/07/2036               | \$                               | 223                       | \$ 132                                      | 0,28                                | 3,250 % éch. 12/02/2032          | 75                        | 66   | 0,14 |
| PPI Public Property Invest AB                                                           |                                     |                                  |                           |                                    |                                       |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC                   |                                     |                                  |                           |      |      |
| 3,250 % éch. 21/04/2029                                                                 |                                     | 100                              | 114                       | 0,24                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS         |                                  |                           |                                             | 4,970 % éch. 06/04/2029             | 200                              | 198                       | 0,42 |      |
| Sagax AB                                                                                |                                     |                                  |                           | ADI Escrow Issuer LLC              |                                       |                                  |                           | FS KKR Capital Corp.                        |                                     |                                  |                           |      |      |
| 3,375 % éch. 26/01/2031                                                                 |                                     | 100                              | 113                       | 0,24                               | 7,125 % éch. 15/07/2034               | 50                               | 51                        | 0,11                                        | 6,125 % éch. 15/01/2031             | 25                               | 24                        | 0,05 |      |
| Total Suède                                                                             |                                     |                                  | 528                       | 1,13                               | AES Corp.                             |                                  |                           | Gartner, Inc.                               |                                     |                                  |                           |      |      |
| SUISSE                                                                                  |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/01/2031            | 50                                    | 45                               | 0,10                      | 3,750 % éch. 01/10/2030                     | 75                                  | 69                               | 0,15                      |      |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | Ally Financial, Inc.               |                                       |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           |      |      |
| UBS Group AG                                                                            |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/11/2031            | 115                                   | 128                              | 0,27                      | 5,330 % éch. 23/07/2035                     | 75                                  | 75                               | 0,16                      |      |      |
| 3,091 % éch. 14/05/2032                                                                 | \$                                  | 250                              | 229                       | 0,49                               | Antares Holdings LP                   |                                  |                           | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           |      |      |
| TURQUIE                                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 08/02/2029            | 50                                    | 50                               | 0,11                      | 6,375 % éch. 01/07/2034                     | 75                                  | 76                               | 0,16                      |      |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | APLD ComputeCo LLC                 |                                       |                                  |                           | Haleon U.S. Capital LLC                     |                                     |                                  |                           |      |      |
| Obligation internationale du gouvernement turc                                          |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/06/2031            | 75                                    | 75                               | 0,16                      | 3,375 % éch. 24/03/2029                     | 100                                 | 97                               | 0,21                      |      |      |
| 9,125 % éch. 13/07/2030                                                                 |                                     | 400                              | 441                       | 0,95                               | Ball Corp.                            |                                  |                           | HCA, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |      |      |
| 36,000 % éch. 12/08/2026                                                                | TRY                                 | 2 000                            | 43                        | 0,09                               | 2,875 % éch. 15/08/2030               | 50                               | 46                        | 0,10                                        | 4,600 % éch. 15/11/2032             | 100                              | 97                        | 0,21 |      |
| Total Turquie                                                                           |                                     |                                  | 484                       | 1,04                               | Bank of America Corp.                 |                                  |                           | Hilton Domestic Operating Co., Inc.         |                                     |                                  |                           |      |      |
| UKRAINE                                                                                 |                                     |                                  |                           | 5,288 % éch. 25/04/2034            | 50                                    | 51                               | 0,11                      | 3,625 % éch. 15/02/2032                     | 50                                  | 46                               | 0,10                      |      |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC               |                                       |                                  |                           | Host Hotels & Resorts LP                    |                                     |                                  |                           |      |      |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien                                     |                                     |                                  |                           | 6,581 % éch. 30/05/2049            | 180                                   | 184                              | 0,39                      | 2,900 % éch. 15/12/2031                     | 250                                 | 224                              | 0,48                      |      |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2030                                                                 | \$                                  | 13                               | 9                         | 0,02                               | Block, Inc.                           |                                  |                           | IHG Finance LLC                             |                                     |                                  |                           |      |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2034                                                                 |                                     | 49                               | 28                        | 0,06                               | 3,500 % éch. 01/06/2031               | 100                              | 92                        | 0,20                                        | 3,625 % éch. 27/09/2031             | €                                | 100                       | 114  | 0,24 |
| 0,000 % éch. 01/02/2035                                                                 |                                     | 41                               | 25                        | 0,05                               | 6,500 % éch. 15/05/2032               | 125                              | 128                       | 0,27                                        | Ingevity Corp.                      |                                  |                           |      |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2036                                                                 |                                     | 34                               | 21                        | 0,05                               | Blue Owl Capital Corp.                |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/11/2028                     | \$                                  | 50                               | 48                        | 0,10 |      |
| 4,000 % éch. 01/02/2032                                                                 |                                     | 64                               | 53                        | 0,11                               | 6,300 % éch. 15/08/2031               | 50                               | 50                        | 0,11                                        | JPMorgan Chase & Co.                |                                  |                           |      |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2034                                                                 |                                     | 79                               | 56                        | 0,12                               | Brown & Brown, Inc.                   |                                  |                           | 2,580 % éch. 22/04/2032                     | 200                                 | 180                              | 0,39                      |      |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2035                                                                 |                                     | 84                               | 58                        | 0,13                               | 5,250 % éch. 23/06/2032               | 50                               | 50                        | 0,11                                        | Kilroy Realty LP                    |                                  |                           |      |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2036                                                                 |                                     | 76                               | 52                        | 0,11                               | Builders FirstSource, Inc.            |                                  |                           | 2,650 % éch. 15/11/2033                     | 100                                 | 81                               | 0,17                      |      |      |
| Total Ukraine                                                                           |                                     |                                  | 302                       | 0,65                               | 4,250 % éch. 01/02/2032               | 100                              | 93                        | 0,20                                        | Kraft Heinz Foods Co.               |                                  |                           |      |      |
| ÉMIRATS ARABES UNIS                                                                     |                                     |                                  |                           | Burford Capital Global Finance LLC |                                       |                                  |                           | 6,500 % éch. 09/02/2040                     | 75                                  | 79                               | 0,17                      |      |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/01/2034            | 50                                    | 44                               | 0,09                      | Ladder Capital Finance Holdings LLLP        |                                     |                                  |                           |      |      |
| Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC                                                              |                                     |                                  |                           | Capital One Financial Corp.        |                                       |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/08/2030                     | 75                                  | 76                               | 0,16                      |      |      |
| 5,794 % éch. 30/06/2053                                                                 |                                     | 200                              | 198                       | 0,42                               | 4,722 % éch. 30/01/2032               | 50                               | 49                        | 0,10                                        | Lamar Media Corp.                   |                                  |                           |      |      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                                               |                                     |                                  |                           | Carvana Co.                        |                                       |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/02/2030                     | 50                                  | 48                               | 0,10                      |      |      |
| 3,120 % éch. 20/02/2031                                                                 | €                                   | 100                              | 112                       | 0,24                               | 9,000 % éch. 01/06/2031               | 50                               | 55                        | 0,12                                        | Level 3 Financing, Inc.             |                                  |                           |      |      |
| Total Émirats arabes unis                                                               |                                     |                                  | 310                       | 0,66                               | CBS Corp.                             |                                  |                           | 7,000 % éch. 31/03/2034                     | 50                                  | 52                               | 0,11                      |      |      |
| ROYAUME-UNI                                                                             |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 01/07/2042            | 57                                    | 39                               | 0,08                      | LPL Holdings, Inc.                          |                                     |                                  |                           |      |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | CCO Holdings LLC                   |                                       |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/03/2029                     | 50                                  | 49                               | 0,10                      |      |      |
| Anglian Water Services Financing PLC                                                    |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/05/2032            | 75                                    | 66                               | 0,14                      | Mausser Packaging Solutions Holding Co.     |                                     |                                  |                           |      |      |
| 4,250 % éch. 23/06/2036                                                                 |                                     | 100                              | 114                       | 0,25                               | Centene Corp.                         |                                  |                           | 7,875 % éch. 15/04/2030                     | 25                                  | 26                               | 0,06                      |      |      |
| Berkeley Group PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/03/2031            | 100                                   | 87                               | 0,19                      | Morgan Stanley                              |                                     |                                  |                           |      |      |
| 2,500 % éch. 11/08/2031                                                                 | £                                   | 100                              | 114                       | 0,24                               | Chobani LLC                           |                                  |                           | 5,831 % éch. 19/04/2035                     | 175                                 | 182                              | 0,39                      |      |      |
| HSBC Holdings PLC                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/11/2028            | 75                                    | 74                               | 0,16                      | MSCI, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |      |      |
| 5,733 % éch. 17/05/2032                                                                 | \$                                  | 50                               | 52                        | 0,11                               | Cipher Compute LLC                    |                                  |                           | 3,625 % éch. 01/09/2030                     | 50                                  | 47                               | 0,10                      |      |      |
| Informa PLC                                                                             |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/11/2030            | 37                                    | 38                               | 0,08                      | 3,875 % éch. 15/02/2031                     | 75                                  | 71                               | 0,15                      |      |      |
| 3,750 % éch. 29/04/2032                                                                 | €                                   | 100                              | 115                       | 0,25                               | Clearway Energy Operating LLC         |                                  |                           | National Health Investors, Inc.             |                                     |                                  |                           |      |      |
| Land Securities Capital Markets PLC                                                     |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/02/2031            | 275                                   | 255                              | 0,55                      | 5,350 % éch. 01/02/2033                     | 50                                  | 49                               | 0,10                      |      |      |
| 4,875 % éch. 15/09/2034                                                                 | £                                   | 100                              | 132                       | 0,28                               | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. |                                  |                           | Nexstar Media, Inc.                         |                                     |                                  |                           |      |      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                                          |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/04/2032            | 75                                    | 73                               | 0,16                      | 6,500 % éch. 15/09/2033                     | 100                                 | 100                              | 0,21                      |      |      |
| 0,000 % éch. 05/04/2032 (a)                                                             | \$                                  | 125                              | 102                       | 0,22                               | Cogent Communications Group LLC       |                                  |                           | Nissan Motor Acceptance Co. LLC             |                                     |                                  |                           |      |      |
| South West Water Finance PLC                                                            |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/06/2027            | 75                                    | 75                               | 0,16                      | 5,688 % éch. 13/09/2027                     | 75                                  | 75                               | 0,16                      |      |      |
| 5,250 % éch. 15/09/2031                                                                 | £                                   | 100                              | 132                       | 0,28                               | Columbus McKinnon Corp.               |                                  |                           | OneMain Finance Corp.                       |                                     |                                  |                           |      |      |
| SW Finance PLC                                                                          |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 01/02/2033            | 50                                    | 50                               | 0,11                      | 3,500 % éch. 15/01/2027                     | 50                                  | 50                               | 0,11                      |      |      |
| 6,875 % éch. 14/11/2034                                                                 |                                     | 100                              | 133                       | 0,29                               | CommonSpirit Health                   |                                  |                           | Open Text Holdings, Inc.                    |                                     |                                  |                           |      |      |
| Virgin Media Secured Finance PLC                                                        |                                     |                                  |                           | 4,975 % éch. 01/09/2035            | 50                                    | 49                               | 0,10                      | 4,125 % éch. 15/02/2030                     | 100                                 | 92                               | 0,20                      |      |      |
| 4,125 % éch. 15/08/2030                                                                 |                                     | 100                              | 114                       | 0,24                               | CoreWeave, Inc.                       |                                  |                           | Oracle Corp.                                |                                     |                                  |                           |      |      |
| Vmed Q2 UK Financing PLC                                                                |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 01/02/2031            | 50                                    | 49                               | 0,10                      | 4,700 % éch. 27/09/2034                     | 50                                  | 46                               | 0,10                      |      |      |
| 4,500 % éch. 15/07/2031                                                                 |                                     | 200                              | 219                       | 0,47                               | CRC Insurance Group LLC               |                                  |                           | Pacific Gas & Electric Co.                  |                                     |                                  |                           |      |      |
| Vodafone Group PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 01/06/2031            | 50                                    | 50                               | 0,11                      | 6,700 % éch. 01/04/2053                     | 225                                 | 234                              | 0,50                      |      |      |
| 5,125 % éch. 04/06/2081                                                                 | \$                                  | 200                              | 156                       | 0,33                               | Crown Castle, Inc.                    |                                  |                           | Paramount Global                            |                                     |                                  |                           |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  | 1 383                     | 2,96                               | 2,500 % éch. 15/07/2031               | 50                               | 44                        | 0,09                                        | 4,600 % éch. 15/01/2045             | 75                               | 48                        | 0,10 |      |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | Discovery Communications LLC       |                                       |                                  |                           | 4,900 % éch. 15/08/2044                     | 25                                  | 17                               | 0,04                      |      |      |
| Newgate Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 15/05/2030            | 125                                   | 116                              | 0,25                      | 5,850 % éch. 01/09/2043                     | 45                                  | 34                               | 0,07                      |      |      |
| 4,026 % éch. 01/12/2050                                                                 | £                                   | 82                               | 108                       | 0,23                               | Discovery Global Holdings, Inc.       |                                  |                           | Post Holdings, Inc.                         |                                     |                                  |                           |      |      |
| Total Royaume-Uni                                                                       |                                     |                                  | 1 491                     | 3,19                               | 4,279 % éch. 15/03/2032               | 50                               | 45                        | 0,10                                        | 6,500 % éch. 15/03/2036             | 75                               | 74                        | 0,16 |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    | 5,050 % éch. 15/03/2042               | 50                               | 37                        | 0,08                                        | PR RNO Property Owner LLC           |                                  |                           |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    | ELK Grove Village Property LLC        |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/05/2031                     | 50                                  | 50                               | 0,11                      |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    | 7,500 % éch. 15/06/2031               | 50                               | 50                        | 0,11                                        | QXO Building Products, Inc.         |                                  |                           |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    | Encore Capital Group, Inc.            |                                  |                           | 6,750 % éch. 30/04/2032                     | 50                                  | 52                               | 0,11                      |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    | 6,625 % éch. 15/04/2031               | 200                              | 202                       | 0,43                                        | RD Michigan Property Owner LLC      |                                  |                           |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    |                                       |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                     | 75                                  | 75                               | 0,16                      |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    |                                       |                                  |                           | Rocket Cos., Inc.                           |                                     |                                  |                           |      |      |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                    |                                       |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/08/2030                     | 100                                 | 102                              | 0,22                      |      |      |

| DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Sammons Financial Group, Inc.<br>5,950 % éch. 15/06/2036           | \$ 50                               | \$ 50                            | 0,11                      | Yum! Brands, Inc.<br>4,625 % éch. 31/01/2032                                                   | \$ 75                               | \$ 72                            | 0,15                      | <b>URUGUAY</b>                                                                      |                                     |                                  |                           |
| SBA Tower Trust<br>1,840 % éch. 15/04/2027                         | 500                                 | 489                              | 1,05                      | ZoomInfo Technologies LLC<br>3,875 % éch. 01/02/2029                                           | 75                                  | 61                               | 0,13                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,831 % éch. 15/10/2054                                            | 200                                 | 200                              | 0,43                      |                                                                                                |                                     | 9 799                            | 20,98                     | Obligation internationale du gouvernement uruguayen<br>5,100 % éch. 18/06/2050      | \$ 300                              | \$ 282                           | 0,60                      |
| Sirius XM Radio LLC<br>3,875 % éch. 01/09/2031                     | 50                                  | 45                               | 0,10                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                                                         |                                     |                                  |                           | <b>OUZBÉKISTAN</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 01/07/2030                                            | 75                                  | 71                               | 0,15                      | Discovery Global Holdings, Inc.<br>6,144 % éch. 03/06/2033                                     | 172                                 | 172                              | 0,37                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| SLM Corp.<br>6,495 % éch. 15/05/2032                               | 50                                  | 50                               | 0,11                      | Finastra USA, Inc.<br>7,746 % éch. 15/09/2032                                                  | 50                                  | 46                               | 0,10                      | Obligation internationale de la République d'Ouzbékistan<br>5,375 % éch. 29/05/2027 | € 100                               | 116                              | 0,25                      |
| Snap, Inc.<br>6,875 % éch. 01/03/2033                              | 100                                 | 98                               | 0,21                      | GBT U.S. LLC<br>5,667 % éch. 25/07/2031                                                        | 99                                  | 99                               | 0,21                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Solar Star Funding LLC<br>5,375 % éch. 30/06/2035                  | 222                                 | 221                              | 0,47                      | Jane Street Group LLC<br>5,666 % éch. 15/12/2031                                               | 99                                  | 99                               | 0,21                      | <b>BILLET À COURT TERME</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| Southern California Edison Co.<br>2,500 % éch. 01/06/2031          | 500                                 | 447                              | 0,96                      | LifePoint Health, Inc.<br>7,423 % éch. 19/05/2031                                              | 49                                  | 48                               | 0,10                      | Federal Home Loan Bank<br>3,635 % éch. 26/08/2026 (a)(b)                            | \$ 500                              | 497                              | 1,07                      |
| Sprint Capital Corp.<br>8,750 % éch. 15/03/2032                    | 150                                 | 177                              | 0,38                      | Qnity Electronics, Inc.<br>5,666 % éch. 01/11/2032                                             | 100                                 | 100                              | 0,21                      | 3,710 % éch. 23/09/2026 (a)(b)                                                      | 600                                 | 595                              | 1,27                      |
| Standard Industries, Inc.<br>4,375 % éch. 15/07/2030               | 200                                 | 190                              | 0,41                      | QuidelOrtho Corp.<br>7,644 % éch. 20/08/2032                                                   | 50                                  | 49                               | 0,11                      |                                                                                     |                                     | 1 092                            | 2,34                      |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>6,500 % éch. 15/10/2030           | 100                                 | 102                              | 0,22                      | TreeHouse Foods, Inc.<br>7,894 % éch. 11/02/2033                                               | 50                                  | 50                               | 0,11                      | <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 01/04/2029                                            | 50                                  | 52                               | 0,11                      |                                                                                                |                                     | 663                              | 1,42                      | 23,650 % éch.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Topaz Solar Farms LLC<br>5,750 % éch. 30/09/2039                   | 90                                  | 89                               | 0,19                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (a)(b)                                                                   | EGP 150                             | 3                                | 0,01                      |
| TopBuild Corp.<br>3,625 % éch. 15/03/2029                          | 250                                 | 250                              | 0,54                      | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust<br>4,594 % éch. 19/09/2044               | 21                                  | 21                               | 0,04                      | 24,000 % éch.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Travel & Leisure Co.<br>4,625 % éch. 01/03/2030                    | 100                                 | 97                               | 0,21                      | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                       |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (a)(b)                                                                   | 200                                 | 4                                | 0,01                      |
| Twilio, Inc.<br>3,875 % éch. 15/03/2031                            | 125                                 | 118                              | 0,25                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>4,500 % éch. 01/09/2053           | 85                                  | 82                               | 0,18                      | 24,060 % éch.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| UKG, Inc.<br>6,875 % éch. 01/02/2031                               | 75                                  | 73                               | 0,16                      | 5,000 % éch. 01/10/2053                                                                        | 658                                 | 651                              | 1,40                      | 20/10/2026 (a)(b)                                                                   | 50                                  | 1                                | (0,01)                    |
| United Rentals North America, Inc.<br>3,875 % éch. 15/02/2031      | 200                                 | 189                              | 0,40                      | 5,500 % éch. 01/12/2053                                                                        | 360                                 | 363                              | 0,78                      |                                                                                     |                                     | 8                                | 0,01                      |
| Uniti Services LLC<br>7,500 % éch. 15/10/2033                      | 25                                  | 26                               | 0,06                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA<br>4,000 % éch. 01/07/2056      | 100                                 | 93                               | 0,20                      | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Univision Communications, Inc.<br>8,500 % éch. 31/07/2031          | 100                                 | 100                              | 0,21                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                           | 325                                 | 311                              | 0,67                      | 3,670 % éch.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Verizon Communications, Inc.<br>2,850 % éch. 03/09/2041            | 100                                 | 71                               | 0,15                      | 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                        | 500                                 | 491                              | 1,05                      | 15/09/2026 (a)(b)(i)                                                                | \$ 112                              | 111                              | 0,24                      |
| VMware LLC<br>2,200 % éch. 15/08/2031                              | 200                                 | 176                              | 0,38                      | 6,000 % éch. 01/08/2056                                                                        | 550                                 | 561                              | 1,20                      | 3,717 % éch.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,350 % éch. 27/03/2030 | 125                                 | 126                              | 0,27                      |                                                                                                |                                     | 2 552                            | 5,48                      | 17/09/2026 (a)(b)(i)                                                                | 700                                 | 694                              | 1,49                      |
| Vornado Realty LP<br>5,750 % éch. 01/02/2033                       | 50                                  | 50                               | 0,11                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                         |                                     |                                  |                           | 3,869 % éch. 27/10/2026 (a)(b)                                                      | 900                                 | 889                              | 1,90                      |
| Windstream Services LLC<br>8,250 % éch. 01/10/2031                 | 50                                  | 53                               | 0,11                      | Obligations du Trésor américain<br>3,875 % éch. 15/05/2043                                     | 500                                 | 442                              | 0,95                      |                                                                                     |                                     | 1 694                            | 3,63                      |
| Wisconsin Power & Light Co.<br>4,950 % éch. 01/04/2033             | 100                                 | 100                              | 0,21                      | 4,000 % éch. 15/11/2042                                                                        | 75                                  | 68                               | 0,14                      | Total des Instruments à court terme                                                 |                                     | 2 794                            | 5,98                      |
| WMG Acquisition Corp.<br>3,750 % éch. 01/12/2029                   | 100                                 | 96                               | 0,21                      | 4,125 % éch. 15/08/2044                                                                        | 800                                 | 724                              | 1,56                      | <b>TOTAL DES VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                 |                                     | \$ 42 316                        | 90,63                     |
|                                                                    |                                     |                                  |                           | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                         | 25                                  | 24                               | 0,06                      | <b>ACTIONS</b>                                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 1 258                            | 2,71                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                    |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                                                               |                                     | 14 425                           | 30,91                     | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                            |                                     |                                  |                           |

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026              | 1                     | \$ 1                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026              | 4                     | 3                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Long  | 09/2026              | 7                     | 4                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 3                     | (2)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026              | 2                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 30                    | (1)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Court | 09/2026              | 7                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 35                    | 23                                      | 0,05                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 33                    | 9                                       | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 11                    | 37                                      | 0,08                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026              | 5                     | 11                                      | 0,02                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ 86                                   | 0,18                   |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>                 |       |                      |                       | <b>\$ 86</b>                            | <b>0,18</b>            |

## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Worldline S.A.      | 5,000 %              | 20/12/2028      | € 100                            | \$ 8                              | 0,02                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 300                           | \$ 5                              | 0,01                |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 600                              | 5                                 | 0,01                |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                | 20/06/2031      | 4 430                            | 145                               | 0,31                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 300                              | 0                                 | 0,00                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 155                            | 0,33                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2028      | £ 200             | \$ 0                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2055      | \$ 600            | 17                                | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 2 500             | 15                                | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2029      | 850               | 14                                | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 1 400             | 31                                | 0,07                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 15/11/2053      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 1 300             | 6                                 | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,085     | 15/11/2053      | 82                | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 12,820    | 02/01/2029      | BRL 400           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 12,867    | 02/01/2031      | 900               | (6)                               | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 12,905    | 02/01/2029      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,015    | 02/01/2031      | 300               | (2)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                   | 13,245    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                   | 13,255    | 02/01/2031      | 700               | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,291    | 02/01/2029      | 1 300             | (6)                               | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,320    | 02/01/2029      | 1 300             | (5)                               | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                   | 13,560    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,681    | 02/01/2031      | 500               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,926    | 04/01/2027      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,927    | 04/01/2027      | 2 000             | (3)                               | (0,01)              |
| À payer                           | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 17/12/2030      | CAD 100           | (1)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>            | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR 500           | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | AUD 400           | (14)                              | (0,03)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,750     | 20/12/2033      | 1 200             | (11)                              | (0,03)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 1 575           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 175               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 200               | (3)                               | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 150               | 0                                 | 0,00                |
|                                   |                                   |           |                 |                   | \$ 28                             | 0,06                |
|                                   |                                   |           |                 |                   | \$ 191                            | 0,41                |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| MYI          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | HUF 378,000     | 26/11/2026        | 41                               | \$ (1) | \$ 0         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

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

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement brésilien  | 1,000 %              | 20/06/2028      | \$ 300                           | \$ (17)                | \$ 19                            | \$ 2         | 0,01                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000                | 20/06/2031      | 300                              | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 50                               | 1                      | 0                                | 1            | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement équatorien | 5,000                | 20/06/2027      | 50                               | 2                      | 0                                | 2            | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 100                              | 1                      | 3                                | 4            | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc       | 1,000                | 20/12/2029      | 100                              | (6)                    | 4                                | (2)          | 0,00                |
|              |                                                      |                      |                 |                                  | \$ (19)                | \$ 27                            | \$ 8         | 0,02                |

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | KRW 11 420      | \$ 7              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8            | INR 765           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4               | ¥ 682             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 770         | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 15           | INR 1 402         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL 305         | \$ 60             | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 6           | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 313           | 360               | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 2 327 212   | 130               | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 3 646       | 38                | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 855         | 26                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 29           | BRL 150           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 234             | € 206             | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 50              | £ 37              | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 87              | INR 8 273         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14              | ¥ 2 305           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 82              | KRW 125 836       | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 25              | TWD 794           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 493         | \$ 30             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 20           | BRL 104           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 447 986     | \$ 25             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 589         | 18                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 96           | IDR 1 708 540     | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 6               | INR 597           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 10              | THB 325           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 12/2026           | 15              | IDR 271 950       | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 05/2030           | KWD 27          | \$ 92             | 5                  | 0                     | 5                                      | 0,01                |
|              | 06/2031           | 1               | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 228 276     | 60                | 0                  | (6)                   | (6)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | NZD 540         | 319               | 12                 | 0                     | 12                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$ 66           | COP 228 276       | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 60              | TRY 2 833         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 2 435       | \$ 150            | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 228 276     | 65                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 11            | 13                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | INR 5 021       | 53                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 199         | 22                | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 48           | AUD 68            | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 12              | HUF 3 628         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 32              | IDR 567 787       | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 52              | INR 5 021         | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | KZT 5 581         | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7               | PLN 25            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9               | TWD 284           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 165         | \$ 10             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 548         | 162               | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 87 680      | 23                | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 1 457 146   | 81                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 1 845       | 57                | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 21           | IDR 380 471       | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 10              | INR 966           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 0               | PEN 0             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| DUB          | 10/2026           | PEN 849         | \$ 245            | 0                  | (3)                   | (3)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | 171             | 49                | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 49           | IDR 892 037       | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 89 944      | \$ 5              | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 1 123       | 12                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT 7 113       | 15                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8            | INR 765           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|--------|
| FAR          | 07/2026              | \$                 | 34                   | KZT 18 028            | \$ 4                     | \$ 0                                          | \$ 4                   | 0,01   |
|              | 07/2026              |                    | 5                    | NOK 45                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 7                    | PLN 26                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | ZAR                | 1 132                | \$ 70                 | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 3                    | KZT 1 497             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | IDR                | 584 792              | \$ 32                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 13                   | IDR 237 822           | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              |                    | 12                   | INR 1 130             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | £                  | 737                  | \$ 991                | 13                       | 0                                             | 13                     | 0,03   |
|              | 07/2026              | INR                | 1 955                | 21                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | ¥                  | 17 105               | 106                   | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | SGD                | 561                  | 440                   | 6                        | 0                                             | 6                      | 0,01   |
|              | 07/2026              | \$                 | 20                   | INR 1 955             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 73                   | PLN 265               | 0                        | (2)                                           | (2)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 12                   | SEK 118               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | ZAR                | 1 613                | \$ 98                 | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
| GLM          | 08/2026              | SEK                | 118                  | 12                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 106                  | ¥ 17 061              | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              |                    | 10                   | INR 959               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | KRW                | 18 529               | \$ 12                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 144                  | BRL 726               | 0                        | (4)                                           | (4)                    | (0,01) |
|              | 07/2026              |                    | 292                  | CAD 416               | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 11                   | IDR 205 675           | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 12                   | KRW 18 527            | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 18                   | KZT 9 800             | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,01   |
|              | 08/2026              | CAD                | 415                  | \$ 292                | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 375                  | BRL 1 915             | 0                        | (8)                                           | (8)                    | (0,02) |
|              | 08/2026              |                    | 5                    | INR 478               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | IDR                | 206 879              | \$ 11                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | THB                | 2 204                | 68                    | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 44                   | BRL 227               | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | JPM                  | 09/2026            |                      | 61                    | IDR 1 096 637            | 0                                             | 0                      | 0      |
| 09/2026      |                      |                    | 25                   | INR 2 391             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 12/2026      |                      |                    | 30                   | COP 115 672           | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,01   |
| 07/2026      |                      | AUD                | 2 041                | \$ 1 455              | 42                       | 0                                             | 42                     | 0,09   |
| 07/2026      |                      | BRL                | 573                  | 111                   | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      | INR                | 4 929                | 52                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      | NOK                | 113                  | 11                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      | \$                 | 132                  | HUF 39 964            | 0                        | (4)                                           | (4)                    | (0,01) |
| 07/2026      |                      |                    | 5                    | IDR 98 391            | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      |                    | 52                   | INR 4 929             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      |                    | 135                  | PLN 494               | 0                        | (4)                                           | (4)                    | (0,01) |
| 07/2026      |                      |                    | 16                   | THB 522               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      | ZAR                | 414                  | \$ 25                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 08/2026      |                      | \$                 | 11                   | NOK 113               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 09/2026      |                      | IDR                | 98 938               | \$ 5                  | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| MBC          |                      | 09/2026            | MXN                  | 174                   | 10                       | 0                                             | 0                      | 0      |
|              | 09/2026              | THB                | 1 668                | 51                    | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 107                  | INR 10 214            | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              |                    | 384                  | MXN 6 672             | 0                        | (4)                                           | (4)                    | (0,01) |
|              | 10/2026              |                    | 111                  | BRL 586               | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              | AUD                | 480                  | \$ 344                | 11                       | 0                                             | 11                     | 0,02   |
|              | 07/2026              | CHF                | 83                   | 106                   | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,01   |
|              | 07/2026              | €                  | 305                  | 353                   | 4                        | 0                                             | 4                      | 0,01   |
|              | 07/2026              | IDR                | 2 970                | 0                     | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | INR                | 1 127                | 12                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | KRW                | 196 562              | 130                   | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,01   |
|              | 07/2026              | \$                 | 960                  | AUD 1 388             | 4                        | (2)                                           | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 118                  | € 104                 | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 15                   | INR 1 411             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 31                   | ¥ 4 998               | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 11                   | NOK 106               | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
| MY1<br>NSL   | 07/2026              |                    | 7                    | SEK 72                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | AUD                | 1 313                | \$ 905                | 0                        | (4)                                           | (4)                    | (0,01) |
|              | 08/2026              | €                  | 41                   | 47                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | SEK                | 72                   | 7                     | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | THB                | 705                  | 21                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 36                   | INR 3 461             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 11/2026              | HUF                | 2 702                | € 7                   | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 11                   | IDR 190 364           | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 19                   | INR 1 791             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 93                   | TRY 4 381             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | IDR                | 191 431              | \$ 11                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 13                   | IDR 232 289           | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 323                  | € 278                 | 0                        | (6)                                           | (6)                    | (0,01) |
|              | 07/2026              |                    | 13                   | IDR 228 189           | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 24                   | INR 2 348             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | SCX                  | 08/2026            |                      | 12                    | 1 187                    | 0                                             | 0                      | 0      |
| 08/2026      |                      |                    | 2                    | KZT 960               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 08/2026      |                      |                    | 7                    | NGN 10 209            | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 09/2026      |                      | IDR                | 534 392              | \$ 30                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 09/2026      |                      | THB                | 788                  | 24                    | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
| 09/2026      |                      | \$                 | 33                   | IDR 597 461           | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 11/2026           | \$ 32           | NGN 47 916        | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
|              | 02/2027           | 35              | 52 864            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 8 800         | \$ 10 266         | 206                | 0                     | 206                                     | 0,44                |
|              | 07/2026           | \$ 735          | AUD 1 065         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | 10 057          | € 8 841           | 52                 | 0                     | 52                                      | 0,11                |
|              | 07/2026           | 57              | ¥ 9 122           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 434             | SGD 562           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 065       | \$ 735            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
| SSB          | 08/2026           | € 8 841         | 10 071            | 0                  | (52)                  | (52)                                    | (0,11)              |
|              | 08/2026           | SGD 560         | 434               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 428         | 310               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 3            | CAD 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 925             | £ 700             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 4           | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 1 624 946   | 426               | 0                  | (41)                  | (41)                                    | (0,09)              |
|              | 08/2026           | £ 700           | 925               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,01)              |
| UAG          | 09/2026           | COP 95 570      | 26                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 60           | COP 232 435       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | 7               | PLN 26            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 63          | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 933 197     | 239               | 0                  | (22)                  | (22)                                    | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 111          | CHF 89            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 89          | \$ 111            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 416             | \$ (186)              | \$ 230                                  | 0,49                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 71            | \$ 81             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12 353       | € 10 603          | 0                  | (230)                 | (230)                                   | (0,49)              |
| CBK          | 07/2026           | 327             | 280               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | € 9 831         | \$ 11 212         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | (0,06)              |
|              | 08/2026           | \$ 11 227       | € 9 831           | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,06                |
| MBC          | 07/2026           | € 10 811        | \$ 12 283         | 3                  | (80)                  | (77)                                    | (0,17)              |
|              | 08/2026           | \$ 12 086       | € 10 626          | 81                 | 0                     | 81                                      | 0,17                |
| SCX          | 07/2026           | 11 484          | 9 871             | 0                  | (199)                 | (199)                                   | (0,42)              |
| SOG          | 07/2026           | € 10 626        | \$ 12 087         | 0                  | (62)                  | (62)                                    | (0,13)              |
|              | 07/2026           | \$ 12 347       | € 10 584          | 0                  | (247)                 | (247)                                   | (0,53)              |
|              | 08/2026           | 12 104          | 10 626            | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,13                |
|              |                   |                 |                   | \$ 172             | \$ (852)              | \$ (680)                                | (1,45)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | £ 68            | \$ 89             | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 110          | £ 82              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 89              | 68                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 0             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 105          | £ 78              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 1               | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 107             | 80                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 2               | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 15            | \$ 20             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 20           | £ 15              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 79            | \$ 104            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 104          | £ 79              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 79            | \$ 104            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 104          | £ 79              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (4)                | \$ (3)                                  | (0,01)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (445) (0,95)

Total des Investissements

\$ 46 826 100,27

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (125) (0,27)

Actif net

\$ 46 701 100,00



## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

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

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

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (e) Affilié au Fonds.
- (f) Titre convertible conditionnel.
- (g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,01 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût          | Juste valeur  | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|---------------|---------------|---------------------|
| Flora Food Management BV                            | 7,500 % | 31/10/2030      | 20/01/2026   | \$ 117        | \$ 114        | 0,25                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804   | 20/04/2033      | 13/04/2026   | 200           | 200           | 0,43                |
| Mahle GmbH                                          | 7,125   | 15/07/2032      | 10/06/2026   | 121           | 121           | 0,26                |
|                                                     |         |                 |              | <b>\$ 438</b> | <b>\$ 435</b> | <b>0,94</b>         |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 371 \$ (31 décembre 2025 : 371 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 534 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 875 \$ (31 décembre 2025 : 757 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 41 902                                            | \$ 414                                            | \$ 42 316        |
| Fonds d'investissement                        | 4 678                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 4 678            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 18                                                                                | (186)                                                | 0                                                 | (168)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 4 696</b>                                                                   | <b>\$ 41 716</b>                                     | <b>\$ 414</b>                                     | <b>\$ 46 826</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 46 046                                            | \$ 464                                            | \$ 46 510        |
| Fonds d'investissement                        | 5 008                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 5 008            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (6)                                                                               | 311                                                  | 0                                                 | 305              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 5 002</b>                                                                   | <b>\$ 46 357</b>                                     | <b>\$ 464</b>                                     | <b>\$ 51 823</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| MYI                                           | 3,450 %        | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (154)         | \$ (157)                                 | (0,34)              |
|                                               | 3,470          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (201)            | (201)                                    | (0,43)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (358)</b>                          | <b>(0,77)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | \$ 2                                                       | \$ 0                    | \$ 2                              | \$ 2                                                       | \$ 0                    | \$ 2                              |
| BPS          | (224)                                                      | 282                     | 58                                | (5)                                                        | 0                       | (5)                               |
| BRC          | 9                                                          | 0                       | 9                                 | 154                                                        | (180)                   | (26)                              |
| CBK          | (7)                                                        | 0                       | (7)                               | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |
| DUB          | 5                                                          | 0                       | 5                                 | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| FAR          | 15                                                         | 0                       | 15                                | (47)                                                       | 0                       | (47)                              |
| GLM          | (6)                                                        | 0                       | (6)                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| GST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| JPM          | 32                                                         | 0                       | 32                                | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| MBC          | 22                                                         | 0                       | 22                                | 163                                                        | 0                       | 163                               |
| MYC          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | (2)                                                        | 0                       | (2)                               |
| MYI          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| NSL          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | (203)                                                      | 252                     | 49                                | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| SOG          | (43)                                                       | 0                       | (43)                              | 50                                                         | 0                       | 50                                |
| SSB          | (27)                                                       | 0                       | (27)                              | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| UAG          | (22)                                                       | 0                       | (22)                              | (12)                                                       | 0                       | (12)                              |
| WST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |

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

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 46,32            | 47,86                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 34,10            | 33,18                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,10             | 0,08                 |
| Fonds d'investissement                                           | 8,90             | 8,73                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,17             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,47             | 0,09                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,14             | 1,01                 |
| Autres actifs                                                    | 8,80             | 9,03                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Argentine                         | 1,22             | 1,07                 |
| Australie                         | 3,35             | 2,37                 |
| Autriche                          | 0,25             | 0,24                 |
| Bahreïn                           | 0,42             | S/O                  |
| Bermudes                          | 0,21             | S/O                  |
| Brésil                            | 0,43             | 1,41                 |
| Bulgarie                          | 0,24             | 0,23                 |
| Canada                            | 0,52             | 0,71                 |
| Îles Caïmans                      | 0,45             | 0,47                 |
| Chili                             | 0,49             | 0,67                 |
| Colombie                          | 2,01             | 2,09                 |
| Costa Rica                        | 0,96             | 0,29                 |
| République tchèque                | 0,26             | 0,25                 |
| République dominicaine            | 1,19             | 1,12                 |
| Équateur                          | 0,60             | 0,74                 |
| Égypte                            | 1,41             | 1,23                 |
| Salvador                          | 0,31             | 0,29                 |
| France                            | 1,89             | 1,98                 |
| Allemagne                         | 1,25             | 0,70                 |
| Ghana                             | 0,53             | 0,53                 |
| Hong Kong                         | 0,51             | 0,50                 |
| Hongrie                           | 0,84             | 1,07                 |
| Inde                              | 0,59             | 0,55                 |
| Irlande                           | 5,49             | 6,25                 |
| Italie                            | 0,50             | 0,70                 |
| Côte d'Ivoire                     | 0,67             | 0,63                 |
| Japon                             | 0,68             | 0,75                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,40             | 0,39                 |
| Kazakhstan                        | 0,47             | 0,44                 |
| Kenya                             | 0,46             | 0,43                 |
| Koweït                            | 0,43             | S/O                  |
| Lettonie                          | 0,49             | 0,23                 |
| Liberia                           | S/O              | 0,70                 |
| Luxembourg                        | 1,21             | 1,14                 |

## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Mexique                                                                                                  | 0,46             | 0,82                 |
| Maroc                                                                                                    | 0,38             | 0,35                 |
| Multinationales                                                                                          | 0,10             | 0,20                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 3,10             | 2,33                 |
| Norvège                                                                                                  | S/O              | 0,24                 |
| Oman                                                                                                     | 0,47             | 0,44                 |
| Panama                                                                                                   | 0,75             | 1,22                 |
| Paraguay                                                                                                 | 0,20             | 0,19                 |
| Pérou                                                                                                    | 1,76             | 1,66                 |
| Philippines                                                                                              | S/O              | 0,50                 |
| Pologne                                                                                                  | 1,11             | 0,64                 |
| Portugal                                                                                                 | 0,49             | S/O                  |
| Roumanie                                                                                                 | 1,36             | 1,28                 |
| Sénégal                                                                                                  | 0,22             | 0,29                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,41             | 0,39                 |
| Singapour                                                                                                | 0,59             | 0,92                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 2,05             | 1,67                 |
| Espagne                                                                                                  | 0,89             | 0,58                 |
| Sri Lanka                                                                                                | 0,42             | 0,39                 |
| Supranationales                                                                                          | 0,24             | 0,23                 |
| Suède                                                                                                    | 1,13             | 0,62                 |
| Suisse                                                                                                   | 0,49             | 0,46                 |
| Turquie                                                                                                  | 1,04             | 1,01                 |
| Ukraine                                                                                                  | 0,65             | 0,53                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,66             | 0,23                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 3,19             | 5,24                 |
| États-Unis                                                                                               | 30,91            | 36,99                |
| Uruguay                                                                                                  | 0,60             | 0,57                 |
| Ouzbékistan                                                                                              | 0,25             | 0,24                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 5,98             | 2,38                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 10,00            | 9,99                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,18             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,33             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,06             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | (0,01)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,49             | (0,42)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,46)           | 1,04                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (0,27)           | (3,38)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund

30 juin 2026

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                  |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                 |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS     |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                 |                                     |                                  |                           |
| American Airlines, Inc.             |                                     |                                  |                           | 12,050 % éch. 07/01/2032                                    | \$ 300                              | \$ 317                           | 0,01                      | CI Financial Corp.                              |                                     |                                  |                           |
| 5,925 % éch. 20/04/2028             | \$ 579                              | \$ 579                           | 0,01                      | 13,750 % éch. 07/05/2031                                    | 800                                 | 832                              | 0,02                      | 4,625 % éch. 12/12/2031                         | € 1 700                             | \$ 1 970                         | 0,04                      |
| BCP Modular Services Holdings Ltd.  |                                     |                                  |                           | Aroundtown S.A.                                             |                                     |                                  |                           | CIMA Finance DAC                                |                                     |                                  |                           |
| 6,716 % éch. 10/07/2031             | € 4 900                             | 4 835                            | 0,11                      | 0,375 % éch. 15/04/2027                                     | € 1 100                             | 1 232                            | 0,03                      | 2,950 % éch. 05/09/2029                         | \$ 1 456                            | 1 385                            | 0,03                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.     |                                     |                                  |                           | Athene Global Funding                                       |                                     |                                  |                           | Citadel Finance LLC                             |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 03/06/2033               | 4 400                               | 5 046                            | 0,11                      | 3,204 % éch. 23/02/2027                                     | 5 200                               | 5 957                            | 0,13                      | 4,750 % éch. 14/02/2029                         | 2 200                               | 2 166                            | 0,05                      |
| TBD % éch. 03/06/2033               | \$ 2 109                            | 2 112                            | 0,05                      | 3,716 % éch. 22/08/2032                                     | 2 100                               | 2 365                            | 0,05                      | Commonwealth RE Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| FPS Finance Co. LLC                 |                                     |                                  |                           | Aviation Capital Group LLC                                  |                                     |                                  |                           | 7,407 % éch. 08/07/2030                         | 300                                 | 300                              | 0,01                      |
| 6,590 % éch. 26/05/2028             | 1 000                               | 1 000                            | 0,02                      | 3,500 % éch. 01/11/2027                                     | \$ 3 600                            | 3 542                            | 0,08                      | Cooperative Rabobank UA                         |                                     |                                  |                           |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. |                                     |                                  |                           | Avolon Holdings Funding Ltd.                                |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 29/06/2027 (h)(j)                  | € 600                               | 691                              | 0,01                      |
| 5,398 % éch. 08/11/2030             | 4 774                               | 4 789                            | 0,10                      | 2,528 % éch. 18/11/2027                                     | 1 883                               | 1 828                            | 0,04                      | 4,875 % éch. 29/06/2029 (h)(j)                  | € 2 200                             | 2 561                            | 0,05                      |
| INEOS U.S. Finance LLC              |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 15/01/2028                                     | 5 100                               | 5 113                            | 0,11                      | 5,500 % éch. 05/10/2026                         | \$ 3 000                            | 3 012                            | 0,06                      |
| 6,894 % éch. 18/02/2030             | 2 149                               | 1 984                            | 0,04                      | 4,950 % éch. 15/10/2032                                     | 6 000                               | 5 857                            | 0,13                      | Coventry Building Society Charitable Foundation |                                     |                                  |                           |
| IRB Holding Corp.                   |                                     |                                  |                           | Balder Finland Oyj                                          |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 07/12/2026                         | € 1 100                             | 1 258                            | 0,03                      |
| 6,144 % éch. 16/12/2030             | 1 541                               | 1 543                            | 0,03                      | 1,000 % éch. 18/01/2027                                     | € 1 800                             | 2 038                            | 0,04                      | CPI Property Group S.A.                         |                                     |                                  |                           |
| LifePoint Health, Inc.              |                                     |                                  |                           | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                         |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 22/07/2030                         | 2 400                               | 2 621                            | 0,06                      |
| 7,177 % éch. 19/05/2031             | 2 260                               | 2 224                            | 0,05                      | 3,625 % éch. 27/11/2030                                     | 3 000                               | 3 467                            | 0,07                      | 6,875 % éch. 05/02/2033                         | £ 900                               | 1 115                            | 0,02                      |
| 7,423 % éch. 19/05/2031             | 4 117                               | 4 061                            | 0,09                      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                        |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole S.A.                            |                                     |                                  |                           |
| Modena Buyer LLC                    |                                     |                                  |                           | 4,968 % éch. 08/05/2031                                     | \$ 3 200                            | 3 196                            | 0,07                      | 5,186 % éch. 01/08/2032                         | \$ 10 200                           | 10 251                           | 0,22                      |
| 7,913 % éch. 01/07/2031             | 3 054                               | 2 829                            | 0,06                      | Banco Santander S.A.                                        | € 4 500                             | 5 160                            | 0,11                      | Crown Castle, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| Nouryon Finance BV                  |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 02/04/2029                                     | € 4 500                             | 5 160                            | 0,11                      | 3,100 % éch. 15/11/2029                         | 250                                 | 237                              | 0,01                      |
| 5,694 % - 5,785 % éch.              |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 15/04/2029                                     | \$ 2 400                            | 2 390                            | 0,05                      | 3,800 % éch. 15/02/2028                         | 2 250                               | 2 222                            | 0,05                      |
| 03/04/2028                          | € 4 176                             | 4 787                            | 0,10                      | Bank Leumi Le-Israel B.M.                                   |                                     |                                  |                           | CTP NV                                          |                                     |                                  |                           |
| Quikrete Holdings, Inc.             |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                     | 2 100                               | 2 109                            | 0,05                      | 0,625 % éch. 27/09/2026                         | € 366                               | 416                              | 0,01                      |
| 5,894 % éch. 10/02/2032             | \$ 1 580                            | 1 581                            | 0,04                      | Bank of America Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 21/06/2029                         | 5 100                               | 5 510                            | 0,12                      |
| Stepstone Group Midco GmbH          |                                     |                                  |                           | 2,687 % éch. 22/04/2032                                     | 200                                 | 181                              | 0,00                      | 1,500 % éch. 27/09/2031                         | 1 700                               | 1 738                            | 0,04                      |
| 6,885 % éch. 26/04/2032             | € 6 400                             | 6 007                            | 0,13                      | 4,456 % éch. 06/02/2032                                     | 7 600                               | 7 468                            | 0,16                      | Deutsche Bank AG                                |                                     |                                  |                           |
| Telecom Serbia                      |                                     |                                  |                           | 4,623 % éch. 09/05/2029                                     | 7 970                               | 7 968                            | 0,17                      | 3,035 % éch. 28/05/2032                         | \$ 800                              | 728                              | 0,02                      |
| 3,967 % éch. 11/06/2029             | 6 428                               | 7 249                            | 0,16                      | 4,695 % éch. 23/04/2032                                     | 9 000                               | 8 926                            | 0,19                      | Digital Dutch Finco BV                          |                                     |                                  |                           |
| Virgin Media Bristol LLC            |                                     |                                  |                           | Barclays PLC                                                |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 15/03/2030                         | € 1 100                             | 1 182                            | 0,02                      |
| 6,967 % éch. 31/03/2031             | \$ 600                              | 534                              | 0,01                      | 2,645 % éch. 24/06/2031                                     | 900                                 | 825                              | 0,02                      | 3,875 % éch. 15/07/2034                         | 4 200                               | 4 734                            | 0,10                      |
| 6,990 % éch. 31/01/2029             | 600                                 | 576                              | 0,01                      | 4,337 % éch. 10/01/2028                                     | 300                                 | 299                              | 0,01                      | East Lane Re Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | 4,521 % éch. 24/02/2032                                     | 2 720                               | 2 639                            | 0,06                      | 12,050 % éch. 31/03/2032                        | \$ 1 100                            | 1 105                            | 0,02                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | 4,972 % éch. 16/05/2029                                     | 300                                 | 301                              | 0,01                      | EQT AB                                          |                                     |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | 5,501 % éch. 09/08/2028                                     | 600                                 | 605                              | 0,01                      | 2,375 % éch. 06/04/2028                         | € 1 200                             | 1 354                            | 0,03                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | 7,385 % éch. 02/11/2028                                     | 2 500                               | 2 586                            | 0,06                      | Equinix, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | 7,437 % éch. 02/11/2033                                     | 2 700                               | 3 010                            | 0,06                      | 0,250 % éch. 15/03/2027                         | € 1 500                             | 1 684                            | 0,04                      |
|                                     |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 15/04/2032                         | \$ 300                              | 284                              | 0,01                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                 |                                     |                                  |                           |
| BANQUE ET FINANCE                   |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                 |                                     |                                  |                           |
| 123 Lights Re Ltd.                  |                                     |                                  |                           | Bayou Re Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 15/03/2027                         | € 1 500                             | 1 684                            | 0,04                      |
| 14,520 % éch. 14/09/2031            | 500                                 | 526                              | 0,01                      | 10,020 % éch. 09/05/2033                                    | 450                                 | 449                              | 0,01                      | 3,900 % éch. 15/04/2032                         | \$ 300                              | 284                              | 0,01                      |
| Acef Holding S.C.A.                 |                                     |                                  |                           | 22,020 % éch. 30/04/2031                                    | 600                                 | 646                              | 0,01                      | Everglades Re Ltd.                              |                                     |                                  |                           |
| 1,250 % éch. 26/04/2030             | € 2 000                             | 2 108                            | 0,05                      | Bevco Lux SARL                                              |                                     |                                  |                           | 10,289 % éch. 22/05/2033                        | 400                                 | 400                              | 0,01                      |
| AerCap Ireland Capital DAC          |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 16/01/2030                                     | € 4 400                             | 4 617                            | 0,10                      | 12,039 % éch. 22/05/2033                        | 500                                 | 499                              | 0,01                      |
| 2,450 % éch. 29/10/2026             | \$ 500                              | 497                              | 0,01                      | BGC Group, Inc.                                             |                                     |                                  |                           | Fairfax Financial Holdings Ltd.                 |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 29/10/2028             | 200                                 | 193                              | 0,00                      | 6,150 % éch. 02/04/2030                                     | \$ 2 380                            | 2 430                            | 0,05                      | 4,625 % éch. 29/04/2030                         | 2 500                               | 2 487                            | 0,05                      |
| 3,650 % éch. 21/07/2027             | 1 350                               | 1 340                            | 0,03                      | Blue Owl Capital Corp.                                      |                                     |                                  |                           | Fédération des Caisses Desjardins du Québec     |                                     |                                  |                           |
| AGFC Capital Trust                  |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 11/06/2028                                     | 1 900                               | 1 799                            | 0,04                      | 4,387 % éch. 30/11/2026                         | £ 1 700                             | 2 260                            | 0,05                      |
| 5,685 % éch. 15/01/2067             | 2 500                               | 1 562                            | 0,03                      | Blue Owl Finance LLC                                        |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                       |                                     |                                  |                           |
| Aircastle Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 10/06/2031                                     | 4 500                               | 3 958                            | 0,09                      | 3,530 % éch. 24/12/2029                         | € 5 500                             | 6 317                            | 0,14                      |
| 2,850 % éch. 26/01/2028             | 2 600                               | 2 522                            | 0,05                      | 6,250 % éch. 18/04/2034                                     | 1 500                               | 1 469                            | 0,03                      | 4,789 % éch. 03/06/2031                         | € 4 500                             | 4 507                            | 0,10                      |
| Akelius Residential Property AB     |                                     |                                  |                           | Blue Ridge Re Ltd.                                          |                                     |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC                       |                                     |                                  |                           |
| 3,950 % éch. 25/03/2031             | € 1 800                             | 2 060                            | 0,04                      | 7,020 % éch. 08/01/2029                                     | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 2,700 % éch. 10/08/2026                         | 3 900                               | 3 892                            | 0,08                      |
| Alamo Re Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 9,520 % éch. 08/01/2029                                     | 250                                 | 251                              | 0,01                      | 2,900 % éch. 16/02/2028                         | 1 800                               | 1 739                            | 0,04                      |
| 9,039 % éch. 07/06/2029             | \$ 300                              | 300                              | 0,01                      | 11,520 % éch. 08/01/2029                                    | 250                                 | 247                              | 0,01                      | 5,420 % éch. 09/04/2031                         | 5 800                               | 5 753                            | 0,12                      |
| 11,039 % éch. 07/06/2028            | 1 500                               | 1 498                            | 0,03                      | BNP Paribas S.A.                                            |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 05/03/2027                         | 4 600                               | 4 624                            | 0,10                      |
| Ally Financial, Inc.                |                                     |                                  |                           | 1,904 % éch. 30/09/2028                                     | 7 800                               | 7 547                            | 0,16                      | GA Global Funding Trust                         |                                     |                                  |                           |
| 5,737 % éch. 15/05/2029             | 2 950                               | 2 992                            | 0,06                      | 5,786 % éch. 13/01/2033                                     | 3 900                               | 4 030                            | 0,09                      | 5,414 % éch. 15/12/2032                         | € 1 800                             | 2 335                            | 0,05                      |
| 6,184 % éch. 26/07/2035             | 600                                 | 610                              | 0,01                      | BPCE S.A.                                                   |                                     |                                  |                           | Gaci First Investment Co.                       |                                     |                                  |                           |
| Altarea S.C.A.                      |                                     |                                  |                           | 4,760 % éch. 13/01/2032                                     | 2 100                               | 2 071                            | 0,04                      | 4,875 % éch. 14/05/2029                         | \$ 8 400                            | 8 374                            | 0,18                      |
| 1,750 % éch. 16/01/2030             | € 1 800                             | 1 924                            | 0,04                      | 5,184 % éch. 02/06/2032                                     | 4 600                               | 4 594                            | 0,10                      | 5,250 % éch. 14/05/2033                         | 2 600                               | 2 599                            | 0,06                      |
| 1,875 % éch. 17/01/2028             | 1 700                               | 1 897                            | 0,04                      | 6,612 % éch. 19/10/2027                                     | 3 550                               | 3 571                            | 0,08                      | Gateway Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| AMCO - Asset Management Co. SpA     |                                     |                                  |                           | Cape Lookout Re Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | 14,430 % éch. 08/07/2026                        | 250                                 | 250                              | 0,01                      |
| 2,250 % éch. 17/07/2027             | 728                                 | 826                              | 0,02                      | 8,770 % éch. 21/03/2033                                     | 900                                 | 891                              | 0,02                      | Golden Bear Re Ltd.                             |                                     |                                  |                           |
| American Honda Finance Corp.        |                                     |                                  |                           | 9,520 % éch. 21/03/2033                                     | 900                                 | 899                              | 0,02                      | 13,289 % éch. 08/03/2032                        | 900                                 | 908                              | 0,02                      |
| 4,358 % éch. 13/08/2027             | \$ 10 100                           | 10 110                           | 0,22                      | 10,420 % éch. 13/03/2032                                    | 1 800                               | 1 880                            | 0,04                      | 13,300 % éch. 08/01/2029                        | 2 000                               | 2 052                            | 0,04                      |
| American Tower Corp.                |                                     |                                  |                           | 12,226 % éch. 05/04/2027                                    | 3 500                               | 3 494                            | 0,08                      | Goldman Sachs Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 0,400 % éch. 15/02/2027             | € 3 100                             | 3 495                            | 0,08                      | Capital One Financial Corp.                                 |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 16/12/2030                         | £ 2 500                             | 2 935                            | 0,06                      |
| 2,300 % éch. 15/09/2031             | \$ 300                              | 265                              | 0,01                      | 5,399 % éch. 30/01/2037                                     | 5 600                               | 5 528                            | 0,12                      | 2,615 % éch. 22/04/2032                         | \$ 200                              | 180                              | 0,00                      |
| Amvest RCF Custodian BV             |                                     |                                  |                           | CapitaLand Ascendas REIT                                    |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 18/12/2029                         | € 2 600                             | 2 979                            | 0,06                      |
| 3,750 % éch. 11/06/2031             | € 800                               | 917                              | 0,02                      | 0,750 % éch. 23/06/2028                                     | € 3 200                             | 3 496                            | 0,08                      | 3,615 % éch. 15/03/2028                         | \$ 2 000                            | 1 987                            | 0,04                      |
| Antares Holdings LP                 |                                     |                                  |                           | Carmila S.A.                                                |                                     |                                  |                           | 3,691 % éch. 05/06/2028                         | 300                                 | 297                              | 0,01                      |
| 3,950 % éch. 15/07/2026             | \$ 1 600                            | 1 599                            | 0,03                      | 3,750 % éch. 13/01/2033                                     | 1 100                               | 1 239                            | 0,03                      | 4,369 % éch. 21/10/2031                         | 2 800                               | 2 739                            | 0,06                      |
| Armor RE Ltd.                       |                                     |                                  |                           | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF             |                                     |                                  |                           | 4,516 % éch. 21/01/2032                         | 8 900                               | 8 734                            | 0,19                      |
| 8,810 % éch. 07/06/2033             | 300                                 | 300                              | 0,01                      | 3,500 % éch. 22/09/2032                                     | 7 800                               | 8 728                            | 0,19                      | 4,594 % éch. 20/04/2030                         | 900                                 | 895                              | 0,02                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan |                                     |                                  |                           | 4,937 % éch. 23/04/2028                         | 6 200                               | 6 218                            | 0,13                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | European Core Fund                                          |                                     |                                  |                           | 5,218 % éch. 23/04/2031                         | 6 900                               | 6 970                            | 0,15                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 27/01/2028                                     | 2 000                               | 2 196                            | 0,05                      | 5,330 % éch. 23/07/2035                         | 3 400                               | 3 413                            | 0,07                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | 0,200 % éch. 01/04/2028                                     | 2 200                               | 2 200                            | 0,05                      | 5,727 % éch. 25/04/2030                         | 700                                 | 718                              | 0,01                      |

# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.<br>3,875 % éch. 29/04/2033  | € 1 400                             | \$ 1 602                         | 0,03                      | 9,014 % éch. 08/07/2030                                                             | \$ 250                              | \$ 250                           | 0,01                      | Sagax Euro MTN NL BV<br>0,750 % éch. 26/01/2028                                         | € 2 200                             | \$ 2 423                         | 0,05                      |
| 4,250 % éch. 03/05/2030                                         | 1 300                               | 1 528                            | 0,03                      | Luca RE Ltd.<br>10,800 % éch. 22/07/2031                                            | 1 800                               | 1 872                            | 0,04                      | 1,000 % éch. 17/05/2029                                                                 | 1 200                               | 1 286                            | 0,03                      |
| GSG Bidco Ltd.<br>4,700 % éch. 15/06/2031                       | 4 400                               | 4 990                            | 0,11                      | Mayflower Re Ltd.<br>8,565 % éch. 08/07/2030                                        | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Santander UK Group Holdings PLC<br>3,823 % éch. 03/11/2028                              | \$ 3 100                            | 3 065                            | 0,07                      |
| Hammerson PLC<br>3,875 % éch. 08/06/2031                        | 1 900                               | 2 181                            | 0,05                      | Merna Reinsurance Ltd.<br>13,991 % éch. 07/07/2030                                  | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 4,320 % éch. 22/09/2029                                                                 | 1 900                               | 1 880                            | 0,04                      |
| Handshake Re Ltd.<br>8,050 % éch. 08/01/2030                    | \$ 250                              | 246                              | 0,01                      | Mizuho Financial Group, Inc.<br>2,564 % éch. 13/09/2031                             | € 3 000                             | 3 242                            | 0,07                      | 5,694 % éch. 15/04/2031                                                                 | 400                                 | 410                              | 0,01                      |
| Hardwood Funding LLC<br>4,840 % éch. 07/06/2028 (k)             | 1 200                               | 1 197                            | 0,03                      | 0,470 % éch. 06/09/2029                                                             | \$ 1 600                            | 1 414                            | 0,03                      | 7,482 % éch. 29/08/2029                                                                 | £ 5 400                             | 7 530                            | 0,16                      |
| 4,980 % éch. 07/06/2030 (k)                                     | 1 600                               | 1 593                            | 0,03                      | MMIFS Re Ltd.<br>5,161 % éch. 10/01/2033                                            | CAD 600                             | 427                              | 0,01                      | SELP Finance SARL<br>3,750 % éch. 10/08/2027                                            | € 3 300                             | 3 797                            | 0,08                      |
| 5,160 % éch. 07/06/2032 (k)                                     | 1 400                               | 1 399                            | 0,03                      | Morgan Stanley<br>0,000 % éch. 02/04/2032 (k)                                       | \$ 3 600                            | 2 686                            | 0,06                      | 4,000 % éch. 29/06/2033                                                                 | 1 800                               | 2 068                            | 0,04                      |
| 5,430 % éch. 07/06/2037 (k)                                     | 1 500                               | 1 509                            | 0,03                      | 3,485 % éch. 11/06/2030                                                             | € 6 700                             | 7 703                            | 0,17                      | Simon Global Development BV<br>3,650 % éch. 15/06/2031                                  | 1 500                               | 1 729                            | 0,04                      |
| Herbie Re Ltd.<br>7,760 % éch. 07/01/2030                       | 300                                 | 300                              | 0,01                      | 4,708 % éch. 12/03/2032                                                             | \$ 6 800                            | 6 718                            | 0,14                      | Société Générale S.A.<br>4,857 % éch. 07/07/2029 (b)                                    | \$ 1 400                            | 1 400                            | 0,03                      |
| Hestia Re Ltd.<br>10,270 % éch. 13/03/2032                      | 300                                 | 307                              | 0,01                      | 5,432 % éch. 10/09/2032                                                             | £ 2 800                             | 3 773                            | 0,08                      | 5,400 % éch. 08/08/2034 (b)                                                             | 3 100                               | 3 082                            | 0,07                      |
| 11,770 % éch. 13/03/2032                                        | 300                                 | 307                              | 0,01                      | Morgan Stanley Bank N.A.<br>4,788 % éch. 10/05/2030                                 | \$ 2 000                            | 2 002                            | 0,04                      | Sofina S.A.<br>1,000 % éch. 23/09/2028                                                  | € 2 900                             | 3 150                            | 0,07                      |
| 13,039 % éch. 16/04/2029                                        | 250                                 | 252                              | 0,01                      | Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des<br>Cadres et Sal |                                     |                                  |                           | SRC Sukuk Ltd.<br>5,375 % éch. 27/02/2035                                               | \$ 9 100                            | 9 253                            | 0,20                      |
| HSBC Holdings PLC<br>1,750 % éch. 24/07/2027                    | £ 3 200                             | 4 241                            | 0,09                      | 0,625 % éch. 21/06/2027                                                             | € 1 200                             | 1 339                            | 0,03                      | Standard Chartered PLC<br>5,005 % éch. 15/10/2030                                       | 1 600                               | 1 607                            | 0,03                      |
| 3,973 % éch. 22/05/2030                                         | \$ 2 500                            | 2 439                            | 0,05                      | 2,125 % éch. 21/06/2052                                                             | 3 400                               | 3 465                            | 0,07                      | Stellantis Financial Services U.S. Corp.<br>4,950 % éch. 15/09/2028                     | 2 600                               | 2 582                            | 0,06                      |
| 5,210 % éch. 11/08/2028                                         | 2 600                               | 2 618                            | 0,06                      | National Australia Bank Ltd.<br>3,146 % éch. 05/02/2031                             | 3 200                               | 3 684                            | 0,08                      | 5,800 % éch. 15/06/2031                                                                 | 3 300                               | 3 262                            | 0,07                      |
| ICBC Standard Bank PLC<br>20,000 % éch. 13/12/2029              | U\$ 15 470 000                      | 1 287                            | 0,03                      | National Bank of Canada<br>3,500 % éch. 25/04/2028                                  | 1 800                               | 2 082                            | 0,04                      | Store Capital LLC<br>4,625 % éch. 15/03/2029                                            | 200                                 | 198                              | 0,00                      |
| ING Groep NV<br>5,550 % éch. 19/03/2035                         | \$ 7 000                            | 7 134                            | 0,15                      | Nationwide Building Society<br>3,960 % éch. 18/07/2030                              | \$ 900                              | 877                              | 0,02                      | Sumisho Air Lease Corp.<br>4,850 % éch. 24/03/2031                                      | 5 300                               | 5 246                            | 0,11                      |
| 5,750 % éch. 16/11/2026 (h)(j)                                  | 900                                 | 905                              | 0,02                      | 4,302 % éch. 08/03/2029                                                             | € 6 800                             | 6 766                            | 0,15                      | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>5,138 % éch. 07/07/2034 (b)                    | 5 400                               | 5 383                            | 0,12                      |
| Integrity Re Ltd.<br>10,520 % éch. 07/06/2029                   | 300                                 | 300                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 20/06/2027 (h)(j)                                                      | £ 2 000                             | 2 658                            | 0,06                      | 5,454 % éch. 15/01/2032                                                                 | 8 600                               | 8 808                            | 0,19                      |
| 11,520 % éch. 06/06/2027                                        | 250                                 | 254                              | 0,01                      | NatWest Group PLC<br>4,892 % éch. 18/05/2029                                        | \$ 1 700                            | 1 705                            | 0,04                      | Synchrony Financial<br>5,150 % éch. 19/03/2029                                          | 9 000                               | 9 004                            | 0,19                      |
| 13,270 % éch. 06/06/2027                                        | 250                                 | 253                              | 0,01                      | 5,125 % éch. 12/05/2027 (h)(j)                                                      | £ 1 700                             | 2 250                            | 0,05                      | TAG Immobilien AG<br>3,625 % éch. 03/03/2032                                            | € 2 000                             | 2 264                            | 0,05                      |
| 14,520 % éch. 07/06/2029                                        | 250                                 | 249                              | 0,01                      | NE Property BV<br>3,875 % éch. 30/09/2033                                           | € 2 000                             | 2 267                            | 0,05                      | Titanium Bondco SARL (6,250 % de rémunération en nature)<br>6,250 % éch. 14/01/2031 (c) | 4 709                               | 788                              | 0,02                      |
| 15,770 % éch. 06/06/2028                                        | 500                                 | 518                              | 0,01                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>1,850 % éch. 16/09/2026                          | \$ 1 600                            | 1 586                            | 0,03                      | Torrey Pines Re Ltd.<br>6,539 % éch. 07/06/2033                                         | \$ 250                              | 250                              | 0,01                      |
| 29,020 % éch. 06/06/2027                                        | 900                                 | 941                              | 0,02                      | 2,450 % éch. 15/09/2028                                                             | 700                                 | 650                              | 0,01                      | 7,536 % éch. 07/06/2034                                                                 | 250                                 | 251                              | 0,01                      |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>0,750 % éch. 16/03/2028                  | € 3 100                             | 3 424                            | 0,07                      | Nomura Holdings, Inc.<br>3,459 % éch. 28/05/2030                                    | € 2 100                             | 2 406                            | 0,05                      | 9,586 % éch. 07/06/2032                                                                 | 800                                 | 823                              | 0,02                      |
| 4,000 % éch. 23/09/2029                                         | \$ 400                              | 391                              | 0,01                      | Nykredit Realkredit A/S<br>3,750 % éch. 26/09/2033                                  | 2 200                               | 2 510                            | 0,05                      | 9,810 % éch. 07/06/2034                                                                 | 250                                 | 256                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 29/06/2030                                         | 2 100                               | 2 103                            | 0,04                      | P3 Group SARL<br>3,750 % éch. 02/04/2033                                            | 1 600                               | 1 797                            | 0,04                      | 10,656 % éch. 07/06/2032                                                                | 400                                 | 412                              | 0,01                      |
| 5,148 % éch. 10/06/2030                                         | £ 1 400                             | 1 846                            | 0,04                      | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC<br>0,000 % éch. 05/04/2032 (e)       | \$ 6 500                            | 5 295                            | 0,11                      | TP ICAP Finance PLC<br>2,625 % éch. 18/11/2028                                          | £ 1 200                             | 1 502                            | 0,03                      |
| Iridium Capital PLC<br>3,886 % éch. 07/03/2027                  | € 2 700                             | 3 091                            | 0,07                      | Polestar Re Ltd.<br>10,550 % éch. 08/01/2029                                        | 300                                 | 301                              | 0,01                      | 6,375 % éch. 12/06/2032                                                                 | 5 000                               | 6 816                            | 0,15                      |
| JAB Holdings BV<br>2,200 % éch. 23/11/2030                      | \$ 1 638                            | 1 468                            | 0,03                      | 12,550 % éch. 08/01/2029                                                            | 300                                 | 303                              | 0,01                      | UBS AG<br>0,250 % éch. 01/09/2028                                                       | € 3 700                             | 3 996                            | 0,09                      |
| JPMorgan Chase & Co.<br>3,136 % éch. 18/02/2032                 | € 4 000                             | 4 524                            | 0,10                      | 14,050 % éch. 08/01/2029                                                            | 250                                 | 251                              | 0,01                      | UBS AG<br>4,632 % éch. 16/02/2032                                                       | \$ 8 350                            | 8 287                            | 0,18                      |
| 4,005 % éch. 23/04/2029                                         | \$ 4 500                            | 4 452                            | 0,10                      | 16,800 % éch. 07/01/2027                                                            | 2 900                               | 2 978                            | 0,06                      | UBS Group AG<br>3,091 % éch. 14/05/2032                                                 | 950                                 | 872                              | 0,02                      |
| 4,408 % éch. 23/04/2030                                         | 1 500                               | 1 487                            | 0,03                      | PPI Public Property Invest AB<br>3,250 % éch. 21/04/2029                            | € 2 800                             | 3 186                            | 0,07                      | 3,869 % éch. 12/01/2029                                                                 | 4 750                               | 4 696                            | 0,10                      |
| 4,457 % éch. 13/11/2031                                         | € 8 600                             | 10 277                           | 0,22                      | 4,125 % éch. 21/04/2033                                                             | 1 500                               | 1 693                            | 0,04                      | 4,194 % éch. 01/04/2031                                                                 | 2 100                               | 2 051                            | 0,04                      |
| 4,995 % éch. 22/07/2030                                         | \$ 2 400                            | 2 417                            | 0,05                      | Prologis International Funding S.A.<br>3,125 % éch. 01/06/2031                      | 2 200                               | 2 479                            | 0,05                      | 4,375 % éch. 10/02/2031 (h)(j)                                                          | 650                                 | 597                              | 0,01                      |
| JPMorgan Chase Bank N.A.<br>5,110 % éch. 08/12/2026             | 2 100                               | 2 108                            | 0,05                      | Purple Re Ltd.<br>10,050 % éch. 07/06/2033                                          | \$ 400                              | 400                              | 0,01                      | 4,502 % éch. 10/04/2030                                                                 | 3 000                               | 3 004                            | 0,06                      |
| Kizuna RE Pte. Ltd.<br>6,539 % éch. 09/04/2029                  | 602                                 | 612                              | 0,01                      | 12,676 % éch. 06/06/2031                                                            | 1 000                               | 1 027                            | 0,02                      | 4,588 % éch. 10/08/2032                                                                 | 1 500                               | 1 472                            | 0,03                      |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>5,500 % éch. 01/08/2030 | 1 200                               | 1 212                            | 0,03                      | QNB Finance Ltd.<br>3,000 % éch. 30/09/2030                                         | € 2 800                             | 3 125                            | 0,07                      | 5,699 % éch. 08/02/2035                                                                 | 600                                 | 616                              | 0,01                      |
| Lazard Group LLC<br>4,375 % éch. 11/03/2029                     | 15 300                              | 15 128                           | 0,33                      | Quercus Re DAC<br>10,149 % éch. 06/01/2031                                          | 300                                 | 349                              | 0,01                      | UniCredit SpA<br>5,305 % éch. 31/07/2032                                                | £ 4 800                             | 6 382                            | 0,14                      |
| Legal & General Group PLC<br>5,625 % éch. 24/03/2031 (h)(j)     | £ 800                               | 1 023                            | 0,02                      | 13,324 % éch. 07/01/2031                                                            | 900                                 | 1 044                            | 0,02                      | Ursa Re Ltd.<br>11,021 % éch. 22/02/2028                                                | \$ 1 000                            | 1 033                            | 0,02                      |
| Lineage Europe Finco BV<br>4,125 % éch. 26/11/2031              | € 2 600                             | 2 969                            | 0,06                      | Realty Income Corp.<br>3,375 % éch. 20/06/2031                                      | 1 800                               | 2 043                            | 0,04                      | 11,260 % éch. 07/06/2028                                                                | 700                                 | 720                              | 0,02                      |
| Lloyds Banking Group PLC<br>4,375 % éch. 22/03/2028             | \$ 900                              | 898                              | 0,02                      | 4,000 % éch. 15/07/2029                                                             | \$ 400                              | 393                              | 0,01                      | Veraison Re Ltd.<br>6,421 % éch. 08/03/2034                                             | 900                                 | 911                              | 0,02                      |
| 5,500 % éch. 08/06/2033                                         | £ 2 700                             | 3 612                            | 0,08                      | Recoletos RE DAC<br>5,289 % éch. 06/07/2032                                         | 500                                 | 500                              | 0,01                      | VICI Properties LP<br>3,750 % éch. 15/02/2027                                           | 3 300                               | 3 280                            | 0,07                      |
| Logicor Financing SARL<br>1,625 % éch. 17/01/2030               | € 900                               | 963                              | 0,02                      | RLJ Lodging Trust LP<br>3,750 % éch. 01/07/2026                                     | 1 600                               | 1 600                            | 0,03                      | 4,125 % éch. 15/08/2030                                                                 | 2 500                               | 2 400                            | 0,05                      |
| 2,750 % éch. 15/01/2030                                         | £ 900                               | 1 099                            | 0,02                      | Sagax AB<br>1,125 % éch. 30/01/2027                                                 | € 3 800                             | 4 301                            | 0,09                      | 4,750 % éch. 15/02/2028                                                                 | 2 300                               | 2 300                            | 0,05                      |
| Long Point Re Ltd.<br>7,289 % éch. 01/06/2034                   | \$ 1 300                            | 1 300                            | 0,03                      |                                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 01/04/2028                                                                 | 1 000                               | 999                              | 0,02                      |
| Longleaf Pine Re Ltd.<br>21,453 % éch. 27/05/2031               | 900                                 | 919                              | 0,02                      |                                                                                     |                                     |                                  |                           | Vitality Re Ltd.<br>5,521 % éch. 08/01/2031                                             | 1 100                               | 1 100                            | 0,02                      |
| Lower Ferry Re Ltd.<br>8,156 % éch. 08/07/2030                  | 500                                 | 500                              | 0,01                      |                                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,921 % éch. 08/01/2031                                                                 | 350                                 | 350                              | 0,01                      |
|                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                     |                                     |                                  |                           | Volkswagen Financial Services NV<br>5,125 % éch. 04/04/2029                             | £ 1 000                             | 1 329                            | 0,03                      |

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Volkswagen Leasing GmbH                  |                                     |                                  |                           | Burberry Group PLC                                              |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 18/06/2030                 | \$ 900                              | \$ 873                           | 0,02                      |
| 3,625 % éch. 11/10/2026                  | € 1 700                             | \$ 1 948                         | 0,04                      | 5,750 % éch. 20/06/2030                                         | £ 2 700                             | \$ 3 619                         | 0,08                      | 5,400 % éch. 08/08/2028                 | 7 800                               | 7 861                            | 0,17                      |
| 3,875 % éch. 11/10/2028                  | 2 300                               | 2 669                            | 0,06                      | Chick-fil-A, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | Sartorius Finance BV                    |                                     |                                  |                           |
| Vonovia SE                               |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 21/07/2031 (b)(k)                                  | \$ 7 000                            | 6 926                            | 0,15                      | 4,375 % éch. 14/09/2029                 | € 700                               | 826                              | 0,02                      |
| 6,385 % éch. 20/05/2033                  | AUD 3 400                           | 2 403                            | 0,05                      | Cogent Communications Group LLC                                 |                                     |                                  |                           | Schaeffler AG                           |                                     |                                  |                           |
| Wells Fargo & Co.                        |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2032                                         | 2 600                               | 2 343                            | 0,05                      | 4,125 % éch. 13/05/2029                 | 2 900                               | 3 337                            | 0,07                      |
| 1,375 % éch. 26/10/2026                  | € 2 200                             | 2 507                            | 0,05                      | Davide Campari-Milano NV                                        |                                     |                                  |                           | Smith & Nephew PLC                      |                                     |                                  |                           |
| 3,526 % éch. 24/03/2028                  | \$ 2 600                            | 2 581                            | 0,06                      | 4,250 % éch. 17/06/2033                                         | € 2 500                             | 2 910                            | 0,06                      | 5,400 % éch. 20/03/2034                 | \$ 1 900                            | 1 915                            | 0,04                      |
| 4,410 % éch. 24/01/2028                  | 1 800                               | 1 803                            | 0,04                      | Fedex Freight Holding Co., Inc.                                 |                                     |                                  |                           | South West Water Finance PLC            |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 23/04/2031                  | 1 400                               | 1 415                            | 0,03                      | 4,650 % éch. 15/03/2031                                         | \$ 11 300                           | 11 105                           | 0,24                      | 5,250 % éch. 15/09/2031                 | £ 2 700                             | 3 551                            | 0,08                      |
| 6,303 % éch. 23/10/2029                  | 6 100                               | 6 311                            | 0,14                      | Flora Food Management BV                                        |                                     |                                  |                           | Southern Co.                            |                                     |                                  |                           |
| Wells Fargo Bank N.A.                    |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 02/07/2029                                         | € 6 200                             | 6 934                            | 0,15                      | 3,700 % éch. 30/04/2030                 | \$ 400                              | 387                              | 0,01                      |
| 5,254 % éch. 11/12/2026                  | 8 000                               | 8 035                            | 0,17                      | Flutter Treasury DAC                                            |                                     |                                  |                           | T-Mobile USA, Inc.                      |                                     |                                  |                           |
| Westfield Stratford City Finance PLC     |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 04/06/2031                                         | 300                                 | 338                              | 0,01                      | 2,250 % éch. 15/11/2031                 | 2 300                               | 2 020                            | 0,04                      |
| 5,124 % éch. 05/05/2036                  | £ 1 600                             | 2 141                            | 0,05                      | 5,875 % éch. 04/06/2031                                         | \$ 3 100                            | 3 091                            | 0,07                      | 3,875 % éch. 15/04/2030                 | 2 700                               | 2 617                            | 0,06                      |
| Windmill Re DAC                          |                                     |                                  |                           | Grifols S.A.                                                    |                                     |                                  |                           | TD SYNEX Corp.                          |                                     |                                  |                           |
| 7,285 % éch. 05/07/2028                  | € 250                               | 294                              | 0,01                      | 3,875 % éch. 15/10/2028                                         | € 3 100                             | 3 524                            | 0,08                      | 2,375 % éch. 09/08/2028                 | 5 800                               | 5 518                            | 0,12                      |
| Windrose Re Ltd.                         |                                     |                                  |                           | GSG Bidco Ltd.                                                  |                                     |                                  |                           | TDF Infrastructure S.A.S.               |                                     |                                  |                           |
| 8,782 % éch. 11/02/2033                  | \$ 300                              | 300                              | 0,01                      | 5,375 % éch. 15/06/2036                                         | 4 900                               | 5 561                            | 0,12                      | 1,750 % éch. 01/12/2029                 | € 4 800                             | 5 159                            | 0,11                      |
| Winston RE Ltd.                          |                                     |                                  |                           | H Lundbeck A/S                                                  |                                     |                                  |                           | Thales S.A.                             |                                     |                                  |                           |
| 8,300 % éch. 04/05/2033                  | 300                                 | 301                              | 0,01                      | 3,375 % éch. 02/06/2029                                         | 2 900                               | 3 324                            | 0,07                      | 4,125 % éch. 18/10/2028                 | 1 500                               | 1 754                            | 0,04                      |
| 8,800 % éch. 04/05/2033                  | 300                                 | 301                              | 0,01                      | Haleon U.S. Capital LLC                                         |                                     |                                  |                           | Thames Water Super Senior Issuer PLC    |                                     |                                  |                           |
| Workspace Group PLC                      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 24/03/2029                                         | \$ 1 850                            | 1 792                            | 0,04                      | 9,750 % éch. 10/10/2027                 | £ 559                               | 788                              | 0,02                      |
| 2,250 % éch. 11/03/2028                  | £ 2 700                             | 3 410                            | 0,07                      | Haleon UK Capital PLC                                           |                                     |                                  |                           | United Airlines Pass-Through Trust      |                                     |                                  |                           |
| WPC Eurobond BV                          |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 18/09/2033                                         | £ 1 100                             | 1 428                            | 0,03                      | 5,450 % éch. 15/08/2038                 | \$ 752                              | 767                              | 0,02                      |
| 1,350 % éch. 15/04/2028                  | € 1 700                             | 1 883                            | 0,04                      | Heathrow Funding Ltd.                                           |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/04/2029                 | 1 338                               | 1 355                            | 0,03                      |
|                                          |                                     | 702 320                          | 15,21                     | 6,000 % éch. 05/03/2032                                         | 3 000                               | 4 037                            | 0,09                      | Universal Music Group NV                |                                     |                                  |                           |
| <b>INDUSTRIE</b>                         |                                     |                                  |                           | Hilton Domestic Operating Co., Inc.                             |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 30/06/2032                 | € 3 400                             | 3 941                            | 0,09                      |
| AA Bond Co. Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/05/2029                                         | \$ 300                              | 290                              | 0,01                      | 4,000 % éch. 13/06/2031                 | 300                                 | 353                              | 0,01                      |
| 3,250 % éch. 31/07/2050                  | £ 2 300                             | 2 927                            | 0,06                      | 4,000 % éch. 01/05/2031                                         | 3 200                               | 3 026                            | 0,07                      | Var Energi ASA                          |                                     |                                  |                           |
| AbbVie, Inc.                             |                                     |                                  |                           | Hilton Grand Vacations Borrower LLC                             |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 12/03/2031                 | 2 300                               | 2 650                            | 0,06                      |
| 4,950 % éch. 15/03/2031                  | \$ 8 300                            | 8 420                            | 0,18                      | 5,000 % éch. 01/06/2029                                         | 4 000                               | 3 909                            | 0,08                      | Venture Global Calcasieu Pass LLC       |                                     |                                  |                           |
| Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. |                                     |                                  |                           | Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement S.A.S. |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/11/2033                 | \$ 6 400                            | 5 708                            | 0,12                      |
| 3,100 % éch. 02/02/2031                  | 5 000                               | 4 509                            | 0,10                      | 0,625 % éch. 16/09/2028                                         | € 2 200                             | 2 405                            | 0,05                      | 6,250 % éch. 15/01/2030                 | 4 800                               | 4 918                            | 0,11                      |
| Aeroporti di Roma SpA                    |                                     |                                  |                           | Hyundai Capital America                                         |                                     |                                  |                           | Verisure Holding AB                     |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 30/07/2031                  | € 3 800                             | 3 992                            | 0,09                      | 4,900 % éch. 23/06/2028                                         | \$ 8 100                            | 8 123                            | 0,18                      | 4,125 % éch. 02/01/2032 (b)             | € 1 100                             | 1 268                            | 0,03                      |
| Air Canada                               |                                     |                                  |                           | Imperial Brands Finance Netherlands BV                          |                                     |                                  |                           | Viper Energy Partners LLC               |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/08/2026                  | \$ 1 300                            | 1 300                            | 0,03                      | 1,750 % éch. 18/03/2033                                         | € 1 700                             | 1 699                            | 0,04                      | 4,900 % éch. 01/08/2030                 | \$ 4 200                            | 4 188                            | 0,09                      |
| Air Canada Pass-Through Trust            |                                     |                                  |                           | Intralot Capital Luxembourg S.A.                                |                                     |                                  |                           | 5,700 % éch. 01/08/2035                 | 4 000                               | 4 066                            | 0,09                      |
| 3,600 % éch. 15/09/2028                  | 803                                 | 796                              | 0,02                      | 6,750 % éch. 15/10/2031 (I)                                     | 5 500                               | 6 391                            | 0,14                      | Virgin Media Secured Finance PLC        |                                     |                                  |                           |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           | JetBlue Pass-Through Trust                                      |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/05/2029                 | £ 2 000                             | 2 544                            | 0,05                      |
| 4,800 % éch. 15/02/2029                  | 626                                 | 626                              | 0,01                      | 2,750 % éch. 15/11/2033                                         | \$ 139                              | 123                              | 0,00                      | VistaJet Malta Finance PLC              |                                     |                                  |                           |
| Altice France S.A.                       |                                     |                                  |                           | Knorr-Bremse AG                                                 |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 15/01/2032                 | \$ 2 600                            | 2 578                            | 0,06                      |
| 12,875 % éch. 01/11/2029                 | € 731                               | 858                              | 0,02                      | 3,000 % éch. 30/09/2029                                         | € 1 000                             | 1 140                            | 0,02                      | Vmed O2 UK Financing PLC                |                                     |                                  |                           |
| Altrad Investment Authority S.A.S.       |                                     |                                  |                           | Las Vegas Sands Corp.                                           |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/07/2031                 | £ 2 800                             | 3 067                            | 0,07                      |
| 3,704 % éch. 23/06/2029                  | 900                                 | 1 030                            | 0,02                      | 3,900 % éch. 08/08/2029                                         | \$ 200                              | 193                              | 0,00                      | 5,625 % éch. 15/04/2032                 | € 12 300                            | 12 395                           | 0,27                      |
| American Airlines Pass-Through Trust     |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/06/2028                                         | 4 000                               | 4 049                            | 0,09                      | Volkswagen Group of America Finance LLC |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/04/2030                  | \$ 329                              | 319                              | 0,01                      | Motability Operations Group PLC                                 |                                     |                                  |                           | 5,650 % éch. 25/03/2032                 | \$ 600                              | 609                              | 0,01                      |
| 3,250 % éch. 15/04/2030                  | 110                                 | 105                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 17/01/2030                                         | € 3 400                             | 3 963                            | 0,09                      | Wabtec Transportation Netherlands BV    |                                     |                                  |                           |
| 3,350 % éch. 15/04/2031                  | 624                                 | 601                              | 0,01                      | Mundys SpA                                                      |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 03/12/2027                 | € 4 600                             | 5 133                            | 0,11                      |
| 3,375 % éch. 01/11/2028                  | 718                                 | 710                              | 0,02                      | 1,875 % éch. 12/02/2028                                         | 7 930                               | 8 885                            | 0,19                      | Werfen S.A.                             |                                     |                                  |                           |
| 3,575 % éch. 15/07/2029                  | 767                                 | 757                              | 0,02                      | National Fuel Gas Co.                                           |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 12/02/2032                 | 4 600                               | 5 236                            | 0,11                      |
| Arcadis NV                               |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 15/10/2031                                         | \$ 2 900                            | 2 888                            | 0,06                      | Wessex Water Services Finance PLC       |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 20/05/2031                  | € 2 600                             | 2 987                            | 0,06                      | Nissan Motor Co. Ltd.                                           |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 10/03/2028                 | £ 300                               | 399                              | 0,01                      |
| Ashtead Capital, Inc.                    |                                     |                                  |                           | 4,345 % éch. 17/09/2027                                         | 1 700                               | 1 673                            | 0,04                      | WMG Acquisition Corp.                   |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 15/10/2033                  | \$ 7 820                            | 8 071                            | 0,17                      | 4,810 % éch. 17/09/2030                                         | 500                                 | 466                              | 0,01                      | 3,875 % éch. 15/07/2030                 | \$ 2 035                            | 1 929                            | 0,04                      |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd.   |                                     |                                  |                           | NTT Finance Corp.                                               |                                     |                                  |                           | Yorkshire Water Finance PLC             |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 22/04/2034                  | 1 200                               | 1 238                            | 0,03                      | 4,876 % éch. 16/07/2030                                         | 2 000                               | 1 996                            | 0,04                      | 5,250 % éch. 28/04/2030                 | £ 4 300                             | 5 683                            | 0,12                      |
| Baker Hughes Holdings LLC                |                                     |                                  |                           | 4,943 % éch. 16/07/2030                                         | 2 600                               | 2 650                            | 0,06                      | 6,625 % éch. 22/07/2040                 | 4 000                               | 5 274                            | 0,11                      |
| 3,226 % éch. 11/03/2030                  | € 1 700                             | 1 945                            | 0,04                      | Petroleos Mexicanos                                             |                                     |                                  |                           |                                         |                                     | 421 103                          | 9,12                      |
| Bayer U.S. Finance LLC                   |                                     |                                  |                           | 6,700 % éch. 16/02/2032                                         | 4 981                               | 5 028                            | 0,11                      | <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>       |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 21/11/2026                  | \$ 800                              | 804                              | 0,02                      | 10,000 % éch. 07/02/2033                                        | 900                                 | 1 060                            | 0,02                      | AES Corp.                               |                                     |                                  |                           |
| Beignet Investor LLC                     |                                     |                                  |                           | QatarEnergy                                                     |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/01/2031                 | \$ 3 100                            | 2 767                            | 0,06                      |
| 6,581 % éch. 30/05/2049                  | 46 330                              | 47 287                           | 1,02                      | 4,625 % éch. 23/06/2029                                         | 3 300                               | 3 280                            | 0,07                      | Anglian Water Osprey Financing PLC      |                                     |                                  |                           |
| BMW U.S. Capital LLC                     |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC                                  |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 27/08/2031                 | £ 7 900                             | 10 567                           | 0,23                      |
| 4,650 % éch. 19/03/2027                  | 1 800                               | 1 804                            | 0,04                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                                         | 67 700                              | 67 513                           | 1,46                      | Anglian Water Services Financing PLC    |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 21/03/2028                  | 900                                 | 903                              | 0,02                      | Royal Caribbean Cruises Ltd.                                    |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 23/06/2036                 | € 9 200                             | 10 532                           | 0,23                      |
| Boeing Co.                               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/05/2033                                         | 10 700                              | 10 419                           | 0,23                      | 5,875 % éch. 20/06/2031                 | £ 3 500                             | 4 725                            | 0,10                      |
| 6,298 % éch. 01/05/2029                  | 2 000                               | 2 083                            | 0,04                      | Sandoz Finance BV                                               |                                     |                                  |                           | Dominion Energy, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| British Airways Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 12/09/2029                                         | € 2 200                             | 2 520                            | 0,05                      | 5,000 % éch. 15/06/2030                 | \$ 2 500                            | 2 529                            | 0,05                      |
| 2,900 % éch. 15/09/2036                  | 1 225                               | 1 121                            | 0,02                      | 4,220 % éch. 17/04/2030                                         | 3 200                               | 3 775                            | 0,08                      | DWR Cymru Financing UK PLC              |                                     |                                  |                           |
| Broadcom, Inc.                           |                                     |                                  |                           | Sands China Ltd.                                                |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 31/03/2034                 | £ 8 400                             | 8 553                            | 0,19                      |
| 5,050 % éch. 15/04/2030                  | 9 700                               | 9 846                            | 0,21                      | 3,250 % éch. 08/08/2031                                         | \$ 1 100                            | 1 001                            | 0,02                      | Edison International                    |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/03/2030                 | \$ 2 250                            | 2 313                            | 0,05                      |



# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Électricité de France S.A.<br>4,125 % éch. 17/06/2031                                           | € 1 900                             | \$2 245                          | 0,05                      | 2,758 % éch. 25/03/2042 (a)<br>3,000 % éch. 25/08/2043 -<br>25/02/2052 (a)                           | \$ 4 889                            | \$578                            | 0,01                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                            |                                     |                                  |                           |
| Emera U.S. Finance LLC<br>4,500 % éch. 01/04/2029                                               | \$ 1 100                            | 1 093                            | 0,02                      | 3,500 % éch. 25/01/2051 -<br>25/11/2051 (a)                                                          | 56 334                              | 8 718                            | 0,19                      | Obligations du Trésor américain                                                            |                                     |                                  |                           |
| Entergy Corp.<br>2,400 % éch. 15/06/2031                                                        | 300                                 | 267                              | 0,01                      | 3,847 % éch. 25/03/2034<br>3,882 % éch. 25/02/2032<br>3,912 % éch. 25/11/2032                        | 21 139                              | 3 435                            | 0,07                      | 4,625 % éch. 15/02/2046                                                                    | \$ 4 100                            | \$3 937                          | 0,09                      |
| EPH Financing International A/S<br>4,625 % éch. 02/07/2032                                      | € 2 200                             | 2 568                            | 0,06                      | 4,092 % éch. 25/03/2037<br>4,171 % éch. 18/10/2030<br>4,500 % éch. 25/09/2053 (a)                    | 11 777                              | 2 692                            | 0,06                      | 4,750 % éch. 15/02/2056                                                                    | 3 300                               | 3 206                            | 0,07                      |
| 5,875 % éch. 30/11/2029                                                                         | 3 000                               | 3 648                            | 0,08                      | 4,967 % éch. 01/11/2042<br>5,000 % éch. 25/09/2053 -<br>25/05/2055 (a)                               | 57 856                              | 12 579                           | 0,27                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (g)                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,651 % éch. 13/11/2028                                                                         | 1 700                               | 2 066                            | 0,04                      | 5,500 % éch. 25/05/2055 (a)<br>5,795 % éch. 01/12/2034                                               | 13 275                              | 2 903                            | 0,06                      | 0,625 % éch. 15/07/2032                                                                    | 84 106                              | 77 917                           | 1,69                      |
| Georgia Power Co.<br>4,700 % éch. 15/05/2032                                                    | \$ 1 200                            | 1 201                            | 0,03                      | 5,954 % éch. 01/02/2035<br>6,000 % éch. 25/05/2055 (a)                                               | 8 860                               | 1 616                            | 0,04                      | 1,125 % éch. 15/01/2033                                                                    | 76 896                              | 72 757                           | 1,57                      |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>4,625 % éch. 15/07/2027                                | 350                                 | 350                              | 0,01                      | 10,845 % éch. 25/03/2036                                                                             | 127                                 | 149                              | 0,00                      | 1,750 % éch. 15/01/2034                                                                    | 18 845                              | 18 418                           | 0,40                      |
| Northumbrian Water Finance PLC<br>1,625 % éch. 11/10/2026                                       | £ 3 376                             | 4 446                            | 0,10                      | Freddie Mac<br>0,453 % éch. 15/08/2042                                                               | 865                                 | 608                              | 0,01                      | 1,875 % éch. 15/07/2034                                                                    | 110 451                             | 108 893                          | 2,36                      |
| ONEOK, Inc.<br>4,350 % éch. 15/03/2029                                                          | \$ 100                              | 99                               | 0,00                      | 1,500 % éch. 25/12/2035 (a)<br>1,617 % éch. 15/12/2050 (a)                                           | 22 098                              | 922                              | 0,02                      | Billets du Trésor américain                                                                |                                     |                                  |                           |
| Pacific Gas & Electric Co.<br>3,000 % éch. 15/06/2028                                           | 2 400                               | 2 323                            | 0,05                      | 2,000 % éch. 25/12/2050 -<br>25/06/2052 (a)                                                          | 52 176                              | 6 022                            | 0,13                      | 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                    | 410                                 | 400                              | 0,01                      |
| 3,250 % éch. 01/06/2031                                                                         | 2 400                               | 2 215                            | 0,05                      | 2,223 % éch. 15/12/2037 (a)<br>2,358 % éch. 25/06/2050 (a)                                           | 210                                 | 14                               | 0,00                      | 4,250 % éch. 15/11/2034                                                                    | 59 800                              | 59 222                           | 1,28                      |
| 3,300 % éch. 01/12/2027                                                                         | 3 000                               | 2 944                            | 0,06                      | 2,408 % éch. 25/06/2050 (a)<br>2,443 % éch. 15/07/2047 (a)                                           | 8 751                               | 948                              | 0,02                      | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR<br>DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/08/2050                                                                         | 300                                 | 200                              | 0,00                      | 2,500 % éch. 25/01/2051 (a)<br>2,903 % éch. 15/04/2042 (a)                                           | 101                                 | 9                                | 0,00                      | Adjustable Rate Mortgage Trust                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,300 % éch. 15/03/2045                                                                         | 500                                 | 395                              | 0,01                      | 3,000 % éch. 25/10/2049 -<br>15/10/2052 (a)                                                          | 32 684                              | 5 272                            | 0,11                      | 4,283 % éch. 25/01/2036                                                                    | 448                                 | 434                              | 0,01                      |
| 4,550 % éch. 01/07/2030                                                                         | 4 100                               | 4 039                            | 0,09                      | 3,500 % éch. 25/04/2050 -<br>25/07/2051 (a)                                                          | 24 636                              | 4 534                            | 0,10                      | 4,303 % éch. 25/02/2036                                                                    | 1 084                               | 681                              | 0,02                      |
| 5,200 % éch. 01/05/2036                                                                         | 1 400                               | 1 360                            | 0,03                      | 4,000 % éch. 15/01/2033 -<br>25/11/2050 (a)                                                          | 25 440                              | 5 280                            | 0,11                      | 4,323 % éch. 25/10/2035                                                                    | 12                                  | 12                               | 0,00                      |
| 5,450 % éch. 15/06/2027                                                                         | 200                                 | 202                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 01/07/2047<br>4,022 % éch. 25/09/2031                                                   | 79                                  | 75                               | 0,00                      | 4,673 % éch. 25/11/2035                                                                    | 193                                 | 132                              | 0,00                      |
| 6,150 % éch. 15/01/2033                                                                         | 3 800                               | 3 971                            | 0,09                      | 4,500 % éch. 25/06/2050 -<br>15/02/2051 (a)                                                          | 21 971                              | 4 992                            | 0,11                      | 5,110 % éch. 25/03/2037                                                                    | 5                                   | 4                                | 0,00                      |
| PacifiCorp<br>5,100 % éch. 15/04/2031                                                           | 2 400                               | 2 423                            | 0,05                      | 5,000 % éch. 25/01/2053 -<br>25/08/2055 (a)                                                          | 51 169                              | 11 362                           | 0,25                      | 5,416 % éch. 25/01/2036                                                                    | 26                                  | 25                               | 0,00                      |
| Southern California Edison Co.<br>5,250 % éch. 15/03/2030                                       | 3 200                               | 3 237                            | 0,07                      | 5,144 % éch. 25/07/2044<br>5,500 % éch. 01/04/2027 -<br>01/01/2040                                   | 219                                 | 215                              | 0,00                      | 6,480 % éch. 25/08/2035                                                                    | 6                                   | 6                                | 0,00                      |
| Southern California Gas Co.<br>2,950 % éch. 15/04/2027                                          | 1 900                               | 1 881                            | 0,04                      | Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 15/07/2045<br>4,000 % éch. 20/10/2042 (a)                                 | 8 801                               | 8 154                            | 0,18                      | American Home Mortgage Assets Trust                                                        |                                     |                                  |                           |
| SW Finance PLC<br>5,750 % éch. 19/11/2030                                                       | £ 3 300                             | 4 273                            | 0,09                      | 4,000 % éch. 15/02/2052 -<br>15/03/2052                                                              | 2 473                               | 436                              | 0,01                      | 4,183 % éch. 25/06/2037                                                                    | \$ 2 302                            | 2 261                            | 0,05                      |
| 6,125 % éch. 19/11/2033                                                                         | 1 000                               | 1 274                            | 0,03                      | 4,500 % éch. 20/10/2045 (a)<br>5,125 % éch. 20/11/2029                                               | 1 689                               | 299                              | 0,01                      | 4,664 % éch. 25/11/2046                                                                    | 59                                  | 13                               | 0,00                      |
| 6,875 % éch. 07/08/2032                                                                         | 5 100                               | 6 819                            | 0,15                      | 5,375 % éch. 20/09/2031<br>Ginnie Mae, TBA                                                           | 61                                  | 61                               | 0,00                      | 6,750 % éch. 25/11/2046                                                                    | 461                                 | 421                              | 0,01                      |
| 6,875 % éch. 14/11/2034                                                                         | 2 200                               | 2 923                            | 0,06                      | 4,000 % éch. 01/07/2056<br>5,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                                   | 3 000                               | 2 792                            | 0,06                      | American Home Mortgage Investment Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 31/10/2031                                                                         | 2 300                               | 3 170                            | 0,07                      | 6,000 % éch. 01/08/2056 -<br>01/09/2056                                                              | 174 050                             | 177 337                          | 3,84                      | 5,895 % éch. 25/11/2045                                                                    | 196                                 | 75                               | 0,00                      |
| TDC Net A/S<br>5,000 % éch. 09/08/2032                                                          | € 1 300                             | 1 543                            | 0,03                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>3,500 % éch. 01/04/2037 -<br>01/07/2048 | 9 417                               | 8 622                            | 0,19                      | 4,886 % éch. 20/01/2061                                                                    | £ 970                               | 1 288                            | 0,03                      |
|                                                                                                 |                                     | 105 161                          | 2,28                      | 4,000 % éch. 01/05/2047 -<br>01/03/2049                                                              | 6 505                               | 6 168                            | 0,13                      | Banc of America Alternative Loan Trust                                                     |                                     |                                  |                           |
| Total des Obligations et billets privés                                                         |                                     | 1 228 584                        | 26,61                     | 4,500 % éch. 01/04/2028<br>5,500 % éch. 01/02/2027 -<br>01/08/2040                                   | 263                                 | 268                              | 0,01                      | 2,877 % éch. 25/06/2037 (a)                                                                | \$ 468                              | 53                               | 0,00                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/06/2037                                                                    | 431                                 | 320                              | 0,01                      |
| Obligations California State General Obligation Bonds, (BABs),<br>(AGM/CR Insured), Series 2010 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/06/2046                                                                    | 174                                 | 153                              | 0,00                      |
| 6,875 % éch. 01/11/2026                                                                         | \$ 2 345                            | 2 365                            | 0,05                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2046                                                                    | 380                                 | 330                              | 0,01                      |
| Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Banc of America Funding Trust                                                              |                                     |                                  |                           |
| 7,350 % éch. 01/07/2035                                                                         | 536                                 | 573                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,390 % éch. 20/10/2046                                                                    | 63                                  | 55                               | 0,00                      |
| Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia<br>Revenue Bonds, Series 2007   |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,823 % éch. 25/01/2037                                                                    | 76                                  | 68                               | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 01/06/2047 (e)                                                                     | 23 300                              | 2 335                            | 0,05                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,074 % éch. 20/02/2047                                                                    | 428                                 | 426                              | 0,01                      |
| Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia<br>Revenue Bonds, Series 2020   |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,112 % éch. 20/06/2037                                                                    | 47                                  | 41                               | 0,00                      |
| 3,151 % éch. 01/06/2032                                                                         | 1 500                               | 1 342                            | 0,03                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,134 % éch. 20/07/2036                                                                    | 721                                 | 721                              | 0,02                      |
| 3,301 % éch. 01/06/2033                                                                         | 800                                 | 706                              | 0,02                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,134 % éch. 20/12/2046                                                                    | 129                                 | 119                              | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     | 7 321                            | 0,16                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,409 % éch. 20/12/2034                                                                    | 10                                  | 8                                | 0,00                      |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,563 % éch. 25/05/2037                                                                    | 471                                 | 438                              | 0,01                      |
| Fannie Mae                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,577 % éch. 20/05/2036                                                                    | 96                                  | 84                               | 0,00                      |
| 0,462 % éch. 25/07/2042 (a)                                                                     | 14 060                              | 247                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,727 % éch. 20/01/2047                                                                    | 244                                 | 214                              | 0,01                      |
| 0,604 % éch. 25/06/2042 (a)                                                                     | 11 046                              | 84                               | 0,00                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,065 % éch. 20/04/2035                                                                    | 581                                 | 571                              | 0,01                      |
| 1,500 % éch. 25/01/2052 (a)                                                                     | 8 203                               | 813                              | 0,02                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,171 % éch. 20/06/2036                                                                    | 7                                   | 6                                | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 25/11/2050 -<br>25/07/2052 (a)                                                     | 24 063                              | 2 870                            | 0,06                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,608 % éch. 20/02/2036                                                                    | 60                                  | 58                               | 0,00                      |
| 2,158 % éch. 25/12/2056 (a)                                                                     | 2 793                               | 371                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,632 % éch. 20/11/2034                                                                    | 241                                 | 234                              | 0,01                      |
| 2,213 % éch. 25/09/2060 (a)                                                                     | 7 577                               | 662                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Banc of America Mortgage Trust                                                             |                                     |                                  |                           |
| 2,220 % éch. 25/06/2043 (a)                                                                     | 3 181                               | 264                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 25/02/2035                                                                    | 43                                  | 42                               | 0,00                      |
| 2,247 % éch. 25/11/2046 (a)                                                                     | 2 782                               | 124                              | 0,00                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,779 % éch. 25/06/2035                                                                    | 25                                  | 22                               | 0,00                      |
| 2,308 % éch. 25/07/2059 (a)                                                                     | 6 783                               | 680                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,933 % éch. 25/05/2035                                                                    | 178                                 | 159                              | 0,00                      |
| 2,358 % éch. 25/07/2050 (a)                                                                     | 3 229                               | 346                              | 0,01                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,616 % éch. 25/01/2035                                                                    | 18                                  | 18                               | 0,00                      |
| 2,408 % éch. 25/07/2043 (a)                                                                     | 793                                 | 75                               | 0,00                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 20/07/2032                                                                    | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,458 % éch. 25/05/2048 (a)                                                                     | 1 318                               | 140                              | 0,00                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | BCAP LLC Trust                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 25/07/2037 (a)                                                                     | 28 422                              | 1 876                            | 0,04                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,836 % éch. 26/11/2036                                                                    | 1 015                               | 1 109                            | 0,03                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/01/2037                                                                    | 1 446                               | 1 294                            | 0,03                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/03/2037                                                                    | 568                                 | 535                              | 0,01                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,440 % éch. 26/03/2037                                                                    | 1 045                               | 1 827                            | 0,04                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,063 % éch. 25/09/2047                                                                    | 662                                 | 606                              | 0,01                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 26/02/2036                                                                    | 549                                 | 197                              | 0,01                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 26/06/2036                                                                    | 9 581                               | 3 228                            | 0,07                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 26/04/2037                                                                    | 548                                 | 290                              | 0,01                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 26/06/2037                                                                    | 83                                  | 74                               | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,015 % éch. 25/05/2047                                                                    | 437                                 | 395                              | 0,01                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,035 % éch. 25/09/2034                                                                    | 147                                 | 135                              | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,498 % éch. 25/07/2034                                                                    | 28                                  | 27                               | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,786 % éch. 25/01/2035                                                                    | 200                                 | 193                              | 0,01                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,809 % éch. 25/08/2035                                                                    | 29                                  | 27                               | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,604 % éch. 25/11/2034                                                                    | 26                                  | 24                               | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,910 % éch. 25/04/2033                                                                    | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/04/2033                                                                    | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 6,156 % éch. 25/01/2034                                                                    | 26                                  | 26                               | 0,00                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                            |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,355 % éch. 25/01/2035                                              | \$ 22                               | \$ 21                            | 0,00                      | 4,473 % éch. 25/07/2036                                              | \$ 511                              | \$ 155                           | 0,00                      | GMAC Mortgage Corp. Loan Trust         |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 25/08/2033                                              | 32                                  | 32                               | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/12/2036                                              | 641                                 | 194                              | 0,01                      | 3,704 % éch. 19/04/2036                | \$ 36                               | \$ 30                            | 0,00                      |
| 6,548 % éch. 25/01/2035                                              | 11                                  | 11                               | 0,00                      | 4,744 % éch. 25/12/2035                                              | 1 483                               | 1 306                            | 0,03                      | GreenPoint Mortgage Funding Trust      |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 25/11/2034                                              | 21                                  | 21                               | 0,00                      | 5,000 % éch. 25/03/2035                                              | 4                                   | 3                                | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/11/2045                | 114                                 | 111                              | 0,00                      |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                             |                                     |                                  |                           | 5,063 % éch. 25/10/2035                                              | 1 044                               | 709                              | 0,02                      | 4,383 % éch. 25/10/2045                | 6                                   | 5                                | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/02/2034                                              | 7                                   | 7                                | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/04/2035                                              | 96                                  | 63                               | 0,00                      | GSR Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                           |
| 4,075 % éch. 25/04/2035                                              | 35                                  | 33                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                              | 155                                 | 82                               | 0,00                      | 2,887 % éch. 25/01/2037 (a)            | 3 012                               | 212                              | 0,01                      |
| 4,083 % éch. 25/02/2034                                              | 63                                  | 60                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/12/2035                                              | 2 768                               | 1 604                            | 0,04                      | 4,096 % éch. 25/11/2035                | 37                                  | 33                               | 0,00                      |
| 4,094 % éch. 25/03/2036                                              | 136                                 | 110                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/01/2036                                              | 19                                  | 10                               | 0,00                      | 4,837 % éch. 25/09/2035                | 83                                  | 80                               | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/08/2036                                              | 146                                 | 133                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/02/2035                                              | 121                                 | 78                               | 0,00                      | 4,958 % éch. 25/11/2035                | 85                                  | 36                               | 0,00                      |
| 4,112 % éch. 25/11/2036                                              | 986                                 | 412                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/07/2035                                              | 545                                 | 320                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/03/2036                | 8                                   | 7                                | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/02/2034                                              | 310                                 | 290                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/05/2036                                              | 422                                 | 148                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/01/2037                | 17                                  | 10                               | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/04/2036                                              | 309                                 | 282                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/03/2037                                              | 355                                 | 173                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2032                | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,231 % éch. 25/11/2036                                              | 2 674                               | 1 413                            | 0,03                      | 6,000 % éch. 25/04/2036                                              | 731                                 | 312                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/11/2035                | 800                                 | 220                              | 0,01                      |
| 4,243 % éch. 25/02/2036                                              | 219                                 | 211                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/08/2036                                              | 111                                 | 59                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2037                | 42                                  | 19                               | 0,00                      |
| 4,252 % éch. 25/09/2035                                              | 3 697                               | 1 499                            | 0,03                      | 6,000 % éch. 25/12/2036                                              | 1 225                               | 448                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                | 91                                  | 65                               | 0,00                      |
| 4,405 % éch. 25/09/2034                                              | 50                                  | 45                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                                              | 223                                 | 81                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/09/2036                | 73                                  | 28                               | 0,00                      |
| 4,494 % éch. 25/05/2036                                              | 484                                 | 220                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/03/2037                                              | 283                                 | 88                               | 0,00                      | HarborView Mortgage Loan Trust         |                                     |                                  |                           |
| 5,044 % éch. 25/05/2035                                              | 141                                 | 136                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                              | 551                                 | 229                              | 0,01                      | 3,903 % éch. 19/10/2033                | 22                                  | 20                               | 0,00                      |
| 5,247 % éch. 25/01/2034                                              | 27                                  | 26                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                              | 92                                  | 43                               | 0,00                      | 3,923 % éch. 25/05/2038                | 352                                 | 287                              | 0,01                      |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust                                  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/08/2037                                              | 625                                 | 300                              | 0,01                      | 4,194 % éch. 19/05/2035                | 110                                 | 108                              | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/06/2037                                              | 466                                 | 445                              | 0,01                      | 6,500 % éch. 25/08/2032                                              | 21                                  | 21                               | 0,00                      | 4,254 % éch. 19/01/2036                | 588                                 | 374                              | 0,01                      |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                         |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/09/2037                                              | 542                                 | 201                              | 0,01                      | 4,314 % éch. 19/02/2036                | 196                                 | 79                               | 0,00                      |
| 3,918 % éch. 26/12/2046                                              | 334                                 | 260                              | 0,01                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                    |                                     |                                  |                           | 4,574 % éch. 19/11/2034                | 46                                  | 43                               | 0,00                      |
| Canada Square Funding PLC                                            |                                     |                                  |                           | 3,549 % éch. 25/04/2035                                              | 25                                  | 15                               | 0,00                      | 4,576 % éch. 19/06/2045                | 887                                 | 340                              | 0,01                      |
| 4,597 % éch. 17/01/2059                                              | £ 1 621                             | 2 152                            | 0,05                      | 3,961 % éch. 20/05/2036                                              | 497                                 | 478                              | 0,01                      | Harmony French Home Loans              |                                     |                                  |                           |
| Chase Mortgage Finance Trust                                         |                                     |                                  |                           | 4,177 % éch. 20/02/2036                                              | 365                                 | 347                              | 0,01                      | 2,854 % éch. 27/05/2062                | € 3 654                             | 4 181                            | 0,09                      |
| 4,008 % éch. 25/03/2037                                              | \$ 201                              | 189                              | 0,01                      | 4,223 % éch. 25/05/2035                                              | 24                                  | 22                               | 0,00                      | Harvest Funding PLC                    |                                     |                                  |                           |
| 4,350 % éch. 25/03/2037                                              | 18                                  | 17                               | 0,00                      | 4,256 % éch. 20/05/2036                                              | 274                                 | 261                              | 0,01                      | 4,643 % éch. 15/11/2069                | £ 5 500                             | 7 301                            | 0,16                      |
| 6,310 % éch. 25/02/2037                                              | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/04/2035                                              | 19                                  | 19                               | 0,00                      | HomeBanc Mortgage Trust                |                                     |                                  |                           |
| ChaseFlex Trust                                                      |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/03/2035                                              | 204                                 | 191                              | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/04/2037                | \$ 1 156                            | 1 046                            | 0,02                      |
| 4,363 % éch. 25/07/2037                                              | 10                                  | 9                                | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/02/2035                                              | 24                                  | 23                               | 0,00                      | Impac CMB Trust                        |                                     |                                  |                           |
| ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | 4,503 % éch. 25/02/2035                                              | 572                                 | 533                              | 0,01                      | 4,403 % éch. 25/03/2035                | 221                                 | 218                              | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/08/2037                                              | 643                                 | 548                              | 0,01                      | 5,250 % éch. 25/12/2027                                              | 19                                  | 10                               | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/03/2035                | 240                                 | 222                              | 0,01                      |
| Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 25/11/2035                                              | 3                                   | 2                                | 0,00                      | 4,543 % éch. 25/10/2034                | 34                                  | 34                               | 0,00                      |
| 3,943 % éch. 25/05/2036                                              | 15                                  | 15                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/02/2037                                              | 350                                 | 139                              | 0,00                      | IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust |                                     |                                  |                           |
| Citicorp Mortgage Securities Trust                                   |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/05/2037                                              | 20                                  | 9                                | 0,00                      | 5,789 % éch. 25/01/2032                | 9                                   | 9                                | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/09/2037                                              | 17                                  | 18                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/08/2037                                              | 1 969                               | 936                              | 0,02                      | IndyMac Mortgage Loan Trust            |                                     |                                  |                           |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/09/2037                                              | 77                                  | 36                               | 0,00                      | 3,125 % éch. 25/06/2037                | 789                                 | 437                              | 0,01                      |
| 3,817 % éch. 25/10/2046                                              | 210                                 | 191                              | 0,01                      | 6,116 % éch. 20/07/2034                                              | 30                                  | 30                               | 0,00                      | 3,272 % éch. 25/07/2037                | 1 836                               | 1 132                            | 0,03                      |
| 4,744 % éch. 25/07/2037                                              | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 6,224 % éch. 20/02/2036                                              | 13                                  | 11                               | 0,00                      | 3,653 % éch. 25/06/2037                | 56                                  | 33                               | 0,00                      |
| 5,329 % éch. 25/08/2035                                              | 23                                  | 22                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/12/2037                                              | 1 386                               | 498                              | 0,01                      | 3,864 % éch. 25/06/2036                | 184                                 | 164                              | 0,00                      |
| 5,510 % éch. 25/09/2035                                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust                       |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/07/2047                | 483                                 | 319                              | 0,01                      |
| 6,028 % éch. 25/03/2034                                              | 38                                  | 36                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/11/2034                                              | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/07/2036                | 597                                 | 594                              | 0,01                      |
| 6,040 % éch. 25/11/2035                                              | 48                                  | 48                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/03/2035                                              | 222                                 | 292                              | 0,01                      | 4,234 % éch. 25/07/2037                | 440                                 | 178                              | 0,00                      |
| 6,160 % éch. 25/02/2034                                              | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                 |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/07/2035                | 164                                 | 131                              | 0,00                      |
| 6,190 % éch. 25/05/2035                                              | 14                                  | 14                               | 0,00                      | 4,426 % éch. 25/03/2032                                              | 18                                  | 17                               | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/02/2035                | 32                                  | 30                               | 0,00                      |
| 6,549 % éch. 25/09/2037                                              | 7                                   | 6                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2036                                              | 480                                 | 284                              | 0,01                      | 4,563 % éch. 25/11/2034                | 76                                  | 72                               | 0,00                      |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust                                  |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/04/2033                                              | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 4,583 % éch. 25/11/2034                | 55                                  | 51                               | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/01/2037                                              | 828                                 | 699                              | 0,02                      | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | 4,731 % éch. 25/10/2034                | 148                                 | 142                              | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/06/2037                                              | 1 215                               | 1 025                            | 0,02                      | 6,077 % éch. 25/10/2033                                              | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/07/2037                | 3 061                               | 889                              | 0,02                      |
| 4,413 % éch. 25/09/2036                                              | 1 116                               | 949                              | 0,02                      | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                          |                                     |                                  |                           | JPMorgan Alternative Loan Trust        |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/10/2037                                              | 512                                 | 480                              | 0,01                      | 3,509 % éch. 30/11/2037                                              | 2 578                               | 2 395                            | 0,05                      | 4,123 % éch. 25/06/2037                | 8 141                               | 4 062                            | 0,09                      |
| Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,674 % éch. 25/06/2050                                              | 1 428                               | 1 285                            | 0,03                      | 4,332 % éch. 25/03/2036                | 154                                 | 112                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/05/2036                                              | 88                                  | 46                               | 0,00                      | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust                 |                                     |                                  |                           | 5,843 % éch. 26/05/2037                | 733                                 | 569                              | 0,01                      |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/02/2037                                              | 3 560                               | 1 522                            | 0,03                      | JPMorgan Mortgage Trust                |                                     |                                  |                           |
| 1,237 % éch. 25/12/2035 (a)                                          | 1 049                               | 69                               | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/08/2036                                              | 41                                  | 14                               | 0,00                      | 0,000 % éch. 25/05/2034                | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 3,934 % éch. 20/02/2047                                              | 248                                 | 202                              | 0,01                      | 7,000 % éch. 25/08/2037                                              | 370                                 | 180                              | 0,00                      | 3,927 % éch. 27/07/2037                | 83                                  | 77                               | 0,00                      |
| 3,944 % éch. 20/03/2047                                              | 3 740                               | 3 299                            | 0,07                      | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                        |                                     |                                  |                           | 4,701 % éch. 25/11/2035                | 14                                  | 11                               | 0,00                      |
| 3,949 % éch. 20/12/2046                                              | 8 497                               | 7 690                            | 0,17                      | 4,043 % éch. 25/07/2047                                              | 301                                 | 289                              | 0,01                      | 5,070 % éch. 25/10/2035                | 109                                 | 79                               | 0,00                      |
| 3,963 % éch. 25/04/2047                                              | 94                                  | 94                               | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                                              | 185                                 | 179                              | 0,00                      | 5,287 % éch. 25/04/2036                | 5                                   | 5                                | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/06/2037                                              | 545                                 | 506                              | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/09/2047                                              | 542                                 | 478                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/01/2036                | 52                                  | 22                               | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/04/2047                                              | 930                                 | 857                              | 0,02                      | 4,423 % éch. 25/08/2037                                              | 1 101                               | 926                              | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                | 246                                 | 103                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/09/2047                                              | 409                                 | 386                              | 0,01                      | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                           | 6,244 % éch. 25/12/2034                | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/05/2047                                              | 414                                 | 384                              | 0,01                      | 3,944 % éch. 19/10/2036                                              | 482                                 | 450                              | 0,01                      | 6,250 % éch. 25/07/2036                | 137                                 | 41                               | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/05/2047                                              | 628                                 | 588                              | 0,01                      | 4,815 % éch. 19/07/2044                                              | 129                                 | 127                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2036                | 247                                 | 78                               | 0,00                      |
| 4,133 % éch. 25/02/2037                                              | 1 812                               | 480                              | 0,01                      | EMF-NL Prime BV                                                      |                                     |                                  |                           | Lehman Mortgage Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 4,143 % éch. 25/07/2046                                              | 60                                  | 69                               | 0,00                      | 3,040 % éch. 17/04/2041                                              | € 105                               | 120                              | 0,00                      | 5,584 % éch. 25/04/2036                | 792                                 | 492                              | 0,01                      |
| 4,143 % éch. 25/09/2046                                              | 13                                  | 13                               | 0,00                      | Eurosail PLC                                                         |                                     |                                  |                           | Lehman XS Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 4,163 % éch. 25/05/2036                                              | 322                                 | 247                              | 0,01                      | 2,651 % éch. 13/03/2045                                              | 3 632                               | 4 035                            | 0,09                      | 4,213 % éch. 25/08/2046                | 110                                 | 116                              | 0,00                      |
| 4,174 % éch. 20/03/2046                                              | 39                                  | 37                               | 0,00                      | 4,116 % éch. 13/03/2045                                              | £ 4 250                             | 5 495                            | 0,12                      | 4,663 % éch. 25/08/2047                | 372                                 | 356                              | 0,01                      |
| 4,174 % éch. 20/05/2046                                              | 235                                 | 214                              | 0,01                      | 4,346 % éch. 10/06/2044                                              | 2 163                               | 2 866                            | 0,06                      | Luminent Mortgage Trust                |                                     |                                  |                           |
| 4,213 % éch. 25/09/2035                                              | 197                                 | 117                              | 0,00                      | 4,816 % éch. 13/06/2045                                              | 10 049                              | 13 228                           | 0,29                      | 4,123 % éch. 25/12/2036                | 9                                   | 9                                | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/01/2037                                              | 1 644                               | 1 453                            | 0,03                      | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust                  |                                     |                                  |                           | Mansard Mortgages PLC                  |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/12/2035                                              | 1 155                               | 443                              | 0,01                      | 4,073 % éch. 25/01/2036                                              | \$ 292                              | 137                              | 0,00                      | 4,166 % éch. 15/04/2049                | £ 2 494                             | 3 241                            | 0,07                      |
| 4,314 % éch. 20/09/2046                                              | 556                                 | 509                              | 0,01                      | 4,782 % éch. 25/09/2034                                              | 20                                  | 20                               | 0,00                      | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust  |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/02/2037                                              | 543                                 | 455                              | 0,01                      | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust                            |                                     |                                  |                           | 3,328 % éch. 25/07/2035                | \$ 162                              | 142                              | 0,00                      |
| 4,343 % éch. 25/02/2036                                              | 1 425                               | 1 369                            | 0,03                      | 5,737 % éch. 25/08/2035                                              | 20                                  | 13                               | 0,00                      | 5,370 % éch. 21/11/2034                | 67                                  | 67                               | 0,00                      |
| 4,398 % éch. 20/11/2035                                              | 16                                  | 14                               | 0,00                      |                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,641 % éch. 25/05/2034                | 33                                  | 32                               | 0,00                      |

# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| MASTR Seasoned Securitization Trust                          |                                     |                                  |                           | Sequoia Mortgage Trust                                               |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Alternative Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,275 % éch. 25/10/2032                                      | \$ 1                                | \$ 1                             | 0,00                      | 3,876 % éch. 20/01/2047                                              | \$ 85                               | \$ 58                            | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/06/2037                                              | \$ 162                              | \$ 120                           | 0,00                      |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust |                                     |                                  |                           | 4,683 % éch. 20/07/2033                                              | 8                                   | 7                                | 0,00                      | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                                | 2 100                               | 1 970                            | 0,04                      |
| 4,180 % éch. 15/12/2030                                      | 61                                  | 60                               | 0,00                      | 6,255 % éch. 20/04/2035                                              | 12                                  | 12                               | 0,00                      | 3,874 % éch. 15/06/2036                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,440 % éch. 15/11/2031                                      | 8                                   | 8                                | 0,00                      | Stratton BTL Mortgage Funding PLC                                    |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                       |                                     |                                  |                           | 4,477 % éch. 20/01/2054                                              | £ 822                               | 1 092                            | 0,02                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,244 % éch. 25/03/2036                                      | 359                                 | 159                              | 0,00                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/11/2035                                      | 23                                  | 22                               | 0,00                      | 3,912 % éch. 25/04/2036                                              | \$ 106                              | 58                               | 0,00                      | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,860 % éch. 25/10/2028                                      | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/09/2034                                              | 3                                   | 3                                | 0,00                      | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES                       |                                     |                                  |                           |
| 5,109 % éch. 25/02/2035                                      | 7                                   | 6                                | 0,00                      | 4,312 % éch. 25/04/2035                                              | 84                                  | 76                               | 0,00                      | Golden Bar Securitisation SRL                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,285 % éch. 25/07/2035                                      | 19                                  | 17                               | 0,00                      | 4,654 % éch. 25/09/2035                                              | 47                                  | 42                               | 0,00                      | 3,436 % éch. 22/09/2043                                              | € 3 191                             | 3 670                            | 0,08                      |
| 5,302 % éch. 25/05/2033                                      | 32                                  | 32                               | 0,00                      | 4,793 % éch. 25/04/2035                                              | 161                                 | 150                              | 0,00                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,645 % éch. 25/12/2032                                      | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 4,882 % éch. 25/09/2034                                              | 139                                 | 136                              | 0,00                      | Accredited Mortgage Loan Trust                                       |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                           |                                     |                                  |                           | 5,057 % éch. 25/10/2035                                              | 75                                  | 67                               | 0,00                      | 4,708 % éch. 25/09/2035                                              | \$ 6 171                            | 5 498                            | 0,12                      |
| 3,128 % éch. 25/11/2037                                      | 1 345                               | 922                              | 0,02                      | 5,468 % éch. 25/07/2034                                              | 75                                  | 73                               | 0,00                      | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 3,651 % éch. 25/12/2037                                      | 946                                 | 583                              | 0,01                      | 5,589 % éch. 25/04/2034                                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/08/2036                                              | 1 461                               | 331                              | 0,01                      |
| 4,023 % éch. 25/04/2035                                      | 25                                  | 25                               | 0,00                      | 5,923 % éch. 25/02/2034                                              | 64                                  | 62                               | 0,00                      | 4,588 % éch. 25/12/2045                                              | 752                                 | 581                              | 0,01                      |
| 5,962 % éch. 25/06/2036                                      | 664                                 | 175                              | 0,00                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                          |                                     |                                  |                           | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through       |                                     |                                  |                           |
| 6,354 % éch. 25/08/2036                                      | 747                                 | 121                              | 0,00                      | 3,883 % éch. 25/08/2036                                              | 511                                 | 456                              | 0,01                      | Certificates                                                         |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley Re-REMIC Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/03/2037                                              | 47                                  | 2                                | 0,00                      | 3,203 % éch. 25/09/2034                                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 5,250 % éch. 26/05/2037                                      | 802                                 | 340                              | 0,01                      | 4,123 % éch. 25/07/2046                                              | 248                                 | 223                              | 0,01                      | 4,468 % éch. 25/11/2035                                              | 469                                 | 467                              | 0,01                      |
| MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |                                     |                                  |                           | 4,143 % éch. 25/06/2036                                              | 31                                  | 31                               | 0,00                      | 4,633 % éch. 25/01/2036                                              | 572                                 | 563                              | 0,01                      |
| 4,223 % éch. 25/06/2047                                      | 1 129                               | 1 005                            | 0,02                      | 4,163 % éch. 25/10/2036                                              | 976                                 | 881                              | 0,02                      | Amortizing Residential Collateral Trust                              |                                     |                                  |                           |
| Newgate Funding PLC                                          |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/04/2036                                              | 166                                 | 153                              | 0,00                      | 4,463 % éch. 25/10/2031                                              | 11                                  | 11                               | 0,00                      |
| 2,369 % éch. 01/12/2050                                      | € 1 665                             | 1 896                            | 0,04                      | 4,183 % éch. 25/08/2036                                              | 48                                  | 40                               | 0,00                      | Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust             |                                     |                                  |                           |
| Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust         |                                     |                                  |                           | 4,254 % éch. 19/07/2035                                              | 48                                  | 47                               | 0,00                      | 4,703 % éch. 25/06/2029                                              | 5                                   | 5                                | 0,00                      |
| 4,321 % éch. 25/10/2035                                      | \$ 62                               | 57                               | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/12/2035                                              | 103                                 | 88                               | 0,00                      | Argent Mortgage Loan Trust                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,559 % éch. 25/06/2036                                      | 1 002                               | 690                              | 0,02                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates | 32                                  | 31                               | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/05/2035                                              | 1 416                               | 1 316                            | 0,03                      |
| 4,833 % éch. 25/02/2035                                      | 36                                  | 36                               | 0,00                      | 5,446 % éch. 25/12/2033                                              | 32                                  | 31                               | 0,00                      | Argent Securities Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                              |                                     |                                  |                           | 6,032 % éch. 25/06/2033                                              | 1                                   | 0                                | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/09/2036                                              | 1 866                               | 592                              | 0,01                      |
| 0,382 % éch. 25/09/2046                                      | 1 727                               | 635                              | 0,01                      | Thornburg Mortgage Securities Trust                                  |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 25/05/2036                                              | 507                                 | 119                              | 0,00                      |
| OBX Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 5,013 % éch. 25/06/2037                                              | 195                                 | 185                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                                              | 1 582                               | 418                              | 0,01                      |
| 4,413 % éch. 25/06/2057                                      | 88                                  | 88                               | 0,00                      | 5,116 % éch. 25/07/2036                                              | 115                                 | 93                               | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                              | 4 523                               | 4 123                            | 0,09                      |
| Prime Mortgage Trust                                         |                                     |                                  |                           | 6,039 % éch. 25/06/2037                                              | 1 389                               | 1 152                            | 0,03                      | 4,083 % éch. 25/05/2036                                              | 3 395                               | 798                              | 0,02                      |
| 8,000 % éch. 25/07/2034                                      | 130                                 | 109                              | 0,00                      | Towd Point Mortgage Funding PLC                                      |                                     |                                  |                           | Asset-Backed Funding Certificates Trust                              |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                             |                                     |                                  |                           | 4,544 % éch. 20/04/2051                                              | £ 6 998                             | 9 289                            | 0,20                      | 4,463 % éch. 25/06/2034                                              | 446                                 | 435                              | 0,01                      |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                  | AUD 62 400                          | 43 089                           | 0,93                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                        | \$ 20                               | 17                               | 0,00                      | 4,813 % éch. 25/03/2034                                              | 263                                 | 255                              | 0,01                      |
| 5,713 % éch. 30/12/2057 (b)                                  | 2 100                               | 1 452                            | 0,03                      | 3,078 % éch. 25/05/2037                                              | 52                                  | 46                               | 0,00                      | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust                 | 313                                 | 325                              | 0,01                      |
| 5,863 % éch. 30/12/2057 (b)                                  | 1 500                               | 1 037                            | 0,02                      | 3,667 % éch. 25/06/2037                                              | 92                                  | 83                               | 0,00                      | 4,858 % éch. 25/02/2035                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,163 % éch. 30/12/2057 (b)                                  | 800                                 | 553                              | 0,01                      | 3,748 % éch. 25/12/2046                                              | 92                                  | 83                               | 0,00                      | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                           | 713                                 | 699                              | 0,02                      |
| 6,563 % éch. 30/12/2057 (b)                                  | 600                                 | 415                              | 0,01                      | 3,761 % éch. 25/12/2046                                              | 123                                 | 113                              | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/02/2037                                              | 3 061                               | 2 980                            | 0,06                      |
| RBSGC Structured Trust                                       |                                     |                                  |                           | 3,976 % éch. 25/02/2037                                              | 948                                 | 860                              | 0,02                      | 4,618 % éch. 25/07/2034                                              | 1 011                               | 1 003                            | 0,02                      |
| 5,500 % éch. 25/11/2035                                      | \$ 521                              | 430                              | 0,01                      | 3,994 % éch. 25/02/2037                                              | 116                                 | 102                              | 0,00                      | 4,716 % éch. 25/11/2035                                              | 598                                 | 620                              | 0,01                      |
| RBSPS Resecuritization Trust                                 |                                     |                                  |                           | 4,262 % éch. 25/03/2036                                              | 8                                   | 7                                | 0,00                      | 4,813 % éch. 25/08/2037                                              | 75                                  | 68                               | 0,00                      |
| 4,009 % éch. 27/06/2036                                      | 4 946                               | 4 493                            | 0,10                      | 4,283 % éch. 25/11/2045                                              | 567                                 | 538                              | 0,01                      | 5,857 % éch. 25/06/2043                                              | 35                                  | 34                               | 0,00                      |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,343 % éch. 25/07/2045                                              | 93                                  | 90                               | 0,00                      | Carrington Mortgage Loan Trust                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,913 % éch. 25/02/2047                                      | 2 551                               | 760                              | 0,02                      | 4,343 % éch. 25/10/2045                                              | 124                                 | 121                              | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/10/2036                                              | 762                                 | 650                              | 0,01                      |
| 4,063 % éch. 25/08/2035                                      | 160                                 | 109                              | 0,00                      | 4,435 % éch. 25/09/2036                                              | 247                                 | 220                              | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/10/2036                                              | 1 086                               | 1 069                            | 0,02                      |
| 4,143 % éch. 25/09/2036                                      | 453                                 | 429                              | 0,01                      | 4,444 % éch. 25/02/2047                                              | 472                                 | 445                              | 0,01                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                                              | 511                                 | 500                              | 0,01                      |
| 4,143 % éch. 25/12/2036                                      | 261                                 | 240                              | 0,01                      | 4,474 % éch. 25/01/2047                                              | 126                                 | 114                              | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/05/2034                                              | 250                                 | 263                              | 0,01                      |
| 4,143 % éch. 25/05/2047                                      | 296                                 | 280                              | 0,01                      | 4,484 % éch. 25/01/2047                                              | 43                                  | 41                               | 0,00                      | Centex Home Equity Loan Trust                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,163 % éch. 25/11/2036                                      | 84                                  | 61                               | 0,00                      | 4,494 % éch. 25/06/2047                                              | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,693 % éch. 25/09/2034                                              | 212                                 | 208                              | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/08/2037                                      | 52                                  | 50                               | 0,00                      | 4,504 % éch. 25/04/2047                                              | 703                                 | 657                              | 0,02                      | CIT Mortgage Loan Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/12/2045                                      | 67                                  | 39                               | 0,00                      | 4,603 % éch. 25/07/2045                                              | 145                                 | 141                              | 0,00                      | 5,263 % éch. 25/10/2037                                              | 5 948                               | 6 009                            | 0,13                      |
| 4,655 % éch. 25/10/2037                                      | 142                                 | 112                              | 0,00                      | 4,724 % éch. 25/06/2046                                              | 230                                 | 205                              | 0,01                      | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 4,967 % éch. 25/01/2036                                      | 167                                 | 111                              | 0,00                      | 4,744 % éch. 25/02/2046                                              | 287                                 | 267                              | 0,01                      | 4,708 % éch. 25/10/2034                                              | 95                                  | 94                               | 0,00                      |
| 5,129 % éch. 25/12/2035                                      | 119                                 | 99                               | 0,00                      | 4,744 % éch. 25/08/2046                                              | 277                                 | 262                              | 0,01                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,244 % éch. 25/08/2035                                      | 43                                  | 32                               | 0,00                      | 4,792 % éch. 25/07/2046                                              | 174                                 | 161                              | 0,00                      | 3,933 % éch. 25/07/2045                                              | 1 117                               | 810                              | 0,02                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2036                                      | 209                                 | 182                              | 0,00                      | 4,792 % éch. 25/08/2046                                              | 2 416                               | 2 130                            | 0,05                      | 3,963 % éch. 25/05/2037                                              | 3 458                               | 2 354                            | 0,05                      |
| 6,500 % éch. 25/09/2037                                      | 80                                  | 67                               | 0,00                      | 5,133 % éch. 25/08/2034                                              | 47                                  | 45                               | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/03/2037                                              | 311                                 | 284                              | 0,01                      |
| Residential Asset Securitization Trust                       |                                     |                                  |                           | 5,144 % éch. 25/06/2042                                              | 7                                   | 6                                | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/12/2036                                              | 224                                 | 156                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/06/2033                                      | 26                                  | 26                               | 0,00                      | 5,144 % éch. 25/08/2042                                              | 22                                  | 21                               | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/08/2036                                              | 1 269                               | 1 258                            | 0,03                      |
| 5,500 % éch. 25/09/2035                                      | 16                                  | 6                                | 0,00                      | 5,244 % éch. 25/11/2046                                              | 1 805                               | 1 589                            | 0,04                      | 4,283 % éch. 25/09/2036                                              | 581                                 | 526                              | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 25/12/2035                                      | 78                                  | 32                               | 0,00                      | 5,595 % éch. 25/03/2034                                              | 163                                 | 166                              | 0,00                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/02/2036                                      | 125                                 | 41                               | 0,00                      | 5,675 % éch. 25/09/2033                                              | 12                                  | 12                               | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/08/2037                                              | 134                                 | 120                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                                      | 383                                 | 131                              | 0,00                      | 5,854 % éch. 25/10/2034                                              | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/06/2047                                              | 4 215                               | 3 719                            | 0,08                      |
| 6,250 % éch. 25/08/2037                                      | 2 260                               | 475                              | 0,01                      | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust           |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/06/2035                                              | 329                                 | 299                              | 0,01                      |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust          |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/02/2037                                              | 158                                 | 125                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/07/2037                                              | 868                                 | 798                              | 0,02                      |
| 5,351 % éch. 25/04/2037                                      | 24                                  | 21                               | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/07/2036                                              | 1 123                               | 728                              | 0,02                      | 4,163 % éch. 25/09/2037                                              | 469                                 | 435                              | 0,01                      |
| 5,392 % éch. 25/09/2035                                      | 292                                 | 181                              | 0,00                      | 4,463 % éch. 25/01/2036                                              | 267                                 | 226                              | 0,01                      | 4,183 % éch. 25/05/2047                                              | 1 420                               | 1 405                            | 0,03                      |
| 5,497 % éch. 27/07/2037                                      | 143                                 | 93                               | 0,00                      | 4,464 % éch. 25/12/2046                                              | 2 465                               | 2 081                            | 0,05                      | 4,203 % éch. 25/09/2037                                              | 144                                 | 158                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/03/2032                                      | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/07/2035                                              | 286                                 | 270                              | 0,01                      | 4,203 % éch. 25/09/2047                                              | 972                                 | 1 016                            | 0,02                      |
| Resloc UK PLC                                                |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/11/2035                                              | 248                                 | 241                              | 0,01                      | 4,223 % éch. 25/05/2037                                              | 168                                 | 163                              | 0,00                      |
| 2,581 % éch. 15/12/2043                                      | € 606                               | 667                              | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/10/2035                                              | 112                                 | 90                               | 0,00                      | 4,357 % éch. 25/07/2036                                              | 2 070                               | 1 965                            | 0,04                      |
| 2,651 % éch. 15/12/2043                                      | 2 680                               | 2 924                            | 0,06                      | 6,000 % éch. 25/03/2036                                              | 191                                 | 190                              | 0,01                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,086 % éch. 15/12/2043                                      | £ 3 657                             | 4 684                            | 0,10                      | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust       |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Rochester Financing PLC                                      |                                     |                                  |                           | 4,339 % éch. 25/02/2033                                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,046 % éch. 18/12/2044                                      | 717                                 | 953                              | 0,02                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |

[Voir les notes annexes](#)

### Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| BILAN                                         |                                     |                                  |                           | BILAN                                                               |                                     |                                  |                           | BILAN                                                                 |                                     |                                  |                           | BILAN       |                                     |                                  |                           |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
| 3,285 % éch. 23/01/2039                       | € 3 000                             | \$ 3 435                         | 0,07                      | 4,421 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 10,500 % éch. 15/03/2037                                              | DOP 57 300                          | \$ 1 027                         | 0,02                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,488 % éch. 15/06/2037                       | 5 700                               | 6 525                            | 0,14                      | 25/06/2036                                                          | \$ 446                              | \$ 436                           | 0,01                      | 10,750 % éch. 01/06/2036                                              | 67 800                              | 1 233                            | 0,03                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,528 % éch. 15/05/2037                       | 2 100                               | 2 407                            | 0,05                      | RAAC Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 11,250 % éch. 15/09/2035                                              | 33 900                              | 632                              | 0,01                      |             |                                     |                                  |                           |
| Dryden Euro CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | Eagle Funding Luxco SARL                                              |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 2,864 % éch. 15/04/2033                       | 2 747                               | 3 141                            | 0,07                      | 25/06/2044                                                          | 70                                  | 65                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 17/08/2030                                               | \$ 8 550                            | 8 595                            | 0,19                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,143 % éch. 15/05/2034                       | 1 611                               | 1 842                            | 0,04                      | Residential Asset Mortgage Products Trust                           |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,220 % éch. 17/01/2033                       | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | 4,503 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 19,698 % éch. 14/10/2030                                              | EGP 699 600                         | 13 557                           | 0,29                      |             |                                     |                                  |                           |
| Euro-Galaxy CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | 25/05/2037                                                          | 1 880                               | 1 689                            | 0,04                      | 21,954 % éch. 04/03/2028                                              | 307 300                             | 6 064                            | 0,13                      |             |                                     |                                  |                           |
| 2,781 % éch. 24/04/2034                       | 2 142                               | 2 448                            | 0,05                      | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi     |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Fair Oaks Loan Funding DAC                    |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 20/04/2033                                               | \$ 4 100                            | 4 087                            | 0,09                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,439 % éch. 15/10/2036                       | 2 300                               | 2 631                            | 0,06                      | 25/10/2036                                                          | 8 838                               | 2 876                            | 0,06                      | 4,875 % éch. 30/04/2029                                               | 3 900                               | 3 929                            | 0,08                      |             |                                     |                                  |                           |
| Grosvenor Place CLO DAC                       |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/04/2034                                               | 1 800                               | 1 831                            | 0,04                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,383 % éch. 15/08/2039                       | 2 900                               | 3 319                            | 0,07                      | 25/08/2035                                                          | 1 210                               | 944                              | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement israélien                   |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Harvest CLO DAC                               |                                     |                                  |                           | 4,723 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/10/2026                                               | € 14 600                            | 16 805                           | 0,36                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,464 % éch. 15/10/2038                       | 2 800                               | 3 206                            | 0,07                      | 25/01/2036                                                          | 150                                 | 145                              | 0,00                      | 5,375 % éch. 19/02/2030                                               | \$ 7 200                            | 7 302                            | 0,16                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,523 % éch. 25/07/2037 (b)                   | 4 700                               | 5 374                            | 0,12                      | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Hayfin Emerald CLO DAC                        |                                     |                                  |                           | 3,767 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 20/12/2044                                               | ¥ 4 340 000                         | \$ 21 177                        | 0,46                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,404 % éch. 22/01/2039                       | 1 700                               | 1 947                            | 0,04                      | 25/02/2027                                                          | 1 353                               | 426                              | 0,01                      | 2,300 % éch. 20/12/2054                                               | 3 300 000                           | 14 693                           | 0,32                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,498 % éch. 18/10/2039                       | 3 500                               | 4 005                            | 0,09                      | 4,063 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 20/03/2056                                               | 1 762 150                           | 10 479                           | 0,23                      |             |                                     |                                  |                           |
| ICG Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | 25/09/2037                                                          | 425                                 | 140                              | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement mexicain                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                       | 3 100                               | 3 548                            | 0,08                      | 4,363 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 30/11/2028 (g)                                           | MXN 6 038                           | 346                              | 0,01                      |             |                                     |                                  |                           |
| Indigo Credit Management DAC                  |                                     |                                  |                           | 25/12/2036                                                          | 452                                 | 440                              | 0,01                      | 6,350 % éch. 09/02/2035                                               | \$ 3 700                            | 3 789                            | 0,08                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,464 % éch. 15/10/2037                       | 1 500                               | 1 717                            | 0,04                      |                                                                     |                                     | 11 053                           | 0,24                      | 6,875 % éch. 13/05/2037                                               | 3 400                               | 3 571                            | 0,08                      |             |                                     |                                  |                           |
| Invesco Euro CLO DAC                          |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     | 419 877                          | 9,09                      | Obligation internationale du gouvernement péruvien                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,277 % éch. 15/07/2037                       | 2 800                               | 3 205                            | 0,07                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 12/08/2034                                               | PEN 39 900                          | 11 435                           | 0,25                      |             |                                     |                                  |                           |
| Jubilee CLO DAC                               |                                     |                                  |                           | Baiterek National Investment Holding JSC                            |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 12/08/2032                                               | 282 500                             | 89 730                           | 1,94                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,164 % éch. 15/10/2035                       | 2 200                               | 2 517                            | 0,05                      | 16,950 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           | 6,850 % éch. 12/08/2035                                               | 5 200                               | 1 605                            | 0,03                      |             |                                     |                                  |                           |
| Madison Park Euro Funding DAC                 |                                     |                                  |                           | 02/04/2029                                                          | KZT 320 500                         | 681                              | 0,01                      | 6,900 % éch. 12/08/2037                                               | 96 500                              | 29 001                           | 0,63                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                       | 3 649                               | 4 177                            | 0,09                      | 16,950 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 12/08/2031                                               | 178 961                             | 59 704                           | 1,29                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,384 % éch. 15/07/2036                       | 10 000                              | 11 428                           | 0,25                      | 02/04/2031                                                          | 309 000                             | 665                              | 0,01                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                                               | 126 700                             | 41 628                           | 0,90                      |             |                                     |                                  |                           |
| Massachusetts Educational Financing Authority |                                     |                                  |                           | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement qatari                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 4,880 % éch. 25/04/2038                       | \$ 172                              | 172                              | 0,00                      | 4,700 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                                               | \$ 6 400                            | 6 434                            | 0,14                      |             |                                     |                                  |                           |
| Navient Student Loan Trust                    |                                     |                                  |                           | 01/09/2030                                                          | CLP 1 220 000                       | 1 307                            | 0,03                      | Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 4,792 % éch. 27/12/2066                       | 2 476                               | 2 511                            | 0,05                      | 5,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 24/01/2052                                               | € 1 700                             | 1 246                            | 0,03                      |             |                                     |                                  |                           |
| Palmer Square European Loan Funding DAC       |                                     |                                  |                           | 01/03/2035                                                          | 300 000                             | 317                              | 0,01                      | 3,750 % éch. 30/01/2028                                               | 360                                 | 419                              | 0,01                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,054 % éch. 15/10/2034                       | € 459                               | 525                              | 0,01                      | 5,800 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 30/01/2033                                               | 2 035                               | 2 431                            | 0,05                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,150 % éch. 15/10/2035                       | 5 900                               | 6 754                            | 0,15                      | 01/10/2029                                                          | 2 535 000                           | 2 829                            | 0,06                      | 4,000 % éch. 30/01/2037                                               | 1 120                               | 1 329                            | 0,03                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,283 % éch. 15/05/2034                       | 2 145                               | 2 455                            | 0,05                      | 6,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain                     |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,433 % éch. 15/02/2035                       | 6 286                               | 7 192                            | 0,16                      | 01/04/2033                                                          | 790 000                             | 887                              | 0,02                      | 1,750 % éch. 13/07/2030                                               | 5 100                               | 5 298                            | 0,11                      |             |                                     |                                  |                           |
| Providus CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement bulgare                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement saoudien                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,189 % éch. 20/05/2034                       | 8 300                               | 9 501                            | 0,20                      | 3,625 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 13/01/2031                                               | \$ 4 400                            | 4 493                            | 0,10                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,364 % éch. 15/10/2038                       | 1 400                               | 1 603                            | 0,03                      | 05/09/2032                                                          | € 4 100                             | 4 769                            | 0,10                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain                |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,374 % éch. 15/07/2038                       | 2 100                               | 2 401                            | 0,05                      | 5,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 30/09/2029                                               | 10 100                              | 10 032                           | 0,22                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,415 % éch. 20/11/2038                       | 4 400                               | 5 033                            | 0,11                      | 05/03/2037                                                          | \$ 4 000                            | 3 912                            | 0,08                      | 6,250 % éch. 31/03/2036                                               | ZAR 47 100                          | 2 464                            | 0,05                      |             |                                     |                                  |                           |
| Rockford Tower Europe CLO DAC                 |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement colombien                 |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/02/2031                                               | 1 057 400                           | 62 316                           | 1,35                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,121 % éch. 24/01/2035                       | 1 800                               | 2 058                            | 0,04                      | 1,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 31/01/2030                                               | 869 800                             | 53 515                           | 1,16                      |             |                                     |                                  |                           |
| Sculptor European CLO DAC                     |                                     |                                  |                           | 18/09/2030                                                          | COP 108 685 400                     | 27 138                           | 0,59                      | 8,250 % éch. 31/03/2032                                               | 146 700                             | 9 050                            | 0,20                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,082 % éch. 10/10/2034                       | 11 700                              | 13 386                           | 0,29                      | 1,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 31/01/2037                                               | 473 900                             | 28 804                           | 0,62                      |             |                                     |                                  |                           |
| Sierra Madre Funding Ltd.                     |                                     |                                  |                           | 24/01/2035                                                          | 121 851 100                         | 34 707                           | 0,75                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                               | 614 300                             | 38 842                           | 0,84                      |             |                                     |                                  |                           |
| 4,108 % éch. 07/09/2039                       | \$ 1 509                            | 779                              | 0,02                      | 6,125 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 31/01/2040                                               | 465 450                             | 28 728                           | 0,62                      |             |                                     |                                  |                           |
| 4,128 % éch. 07/09/2039                       | 8 658                               | 4 482                            | 0,10                      | 21/01/2031                                                          | \$ 1 900                            | 1 921                            | 0,04                      | 9,875 % éch. 31/03/2039                                               | 43 000                              | 2 839                            | 0,06                      |             |                                     |                                  |                           |
| St. Paul's CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | TES colombien                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 2,954 % éch. 15/01/2032                       | € 58                                | 67                               | 0,00                      | 2,250 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Tikehau CLO DAC                               |                                     |                                  |                           | 18/04/2029 (g)                                                      | COP 559 891                         | 146                              | 0,00                      | ACTIONS                                                               |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,483 % éch. 20/04/2038                       | 4 800                               | 5 496                            | 0,12                      | 3,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | ACTIONS ORDINAIRES                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Toro European CLO DAC                         |                                     |                                  |                           | 25/03/2033 (g)                                                      | 7 133 425                           | 1 695                            | 0,04                      | SERVICES DE COMMUNICATION                                             |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,070 % éch. 12/01/2032                       | 3 204                               | 3 668                            | 0,08                      | 6,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | SES S.A. (d)                                                          | 19 367                              | 293                              | 0,01                      |             |                                     |                                  |                           |
| 3,474 % éch. 15/04/2037                       | 6 900                               | 7 898                            | 0,17                      | 22/01/2031 (g)                                                      | 160 108 061                         | 46 037                           | 1,00                      | BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE                                 |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Triaxx Prime CDO Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           | Booking Holdings, Inc.                                                | 356 000                             | 63 453                           | 1,38                      |             |                                     |                                  |                           |
| 4,590 % éch. 02/10/2039                       | \$ 1 318                            | 11                               | 0,00                      | 22/08/2029                                                          | 34 458 000                          | 9 700                            | 0,21                      | MercadoLibre, Inc. (d)                                                | 35 700                              | 60 597                           | 1,31                      |             |                                     |                                  |                           |
| 4,763 % éch. 02/10/2039 ^                     | 524                                 | 4                                | 0,00                      | 11,750 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           | Ross Stores, Inc.                                                     | 52 000                              | 11 068                           | 0,24                      |             |                                     |                                  |                           |
| Trinitas CLO Ltd.                             |                                     |                                  |                           | 24/01/2035                                                          | 127 837 700                         | 36 418                           | 0,79                      |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 4,825 % éch. 20/10/2034                       | 2 800                               | 2 803                            | 0,06                      | 12,750 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| Trinitas Euro CLO DAC                         |                                     |                                  |                           | 28/11/2040                                                          | 40 544 200                          | 12 268                           | 0,27                      |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
| 3,414 % éch. 15/07/2039                       | € 1 600                             | 1 833                            | 0,04                      | 13,250 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     | 228 070                          | 4,94                      | 09/02/2033                                                          | 26 656 000                          | 8 158                            | 0,18                      | SERVICES FINANCIERS                                                   |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain               |                                     |                                  |                           | Adler Group S.A. (d)                                                  | 829 536                             | 0                                | 0,00                      |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | National Bank of                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 21/11/2030                                                          | € 2 500                             | 3 007                            | 0,07                      | Greece S.A.                                                           | 307 710                             | 5 319                            | 0,11                      |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 27/04/2033                                                          | 700                                 | 854                              | 0,02                      |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 6,001 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           | TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION                                         |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 16/01/2036                                                          | 1 500                               | 1 816                            | 0,04                      | Apple, Inc.                                                           | 200 000                             | 57 872                           | 1,25                      |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | Development Bank of Kazakhstan JSC                                  |                                     |                                  |                           | NVIDIA Corp.                                                          | 286 000                             | 57 226                           | 1,24                      |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 18,400 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 16/10/2028                                                          | KZT 807 000                         | 1 758                            | 0,04                      |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 7,050 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | 03/02/2031                                                          | \$ 300                              | 316                              | 0,01                      |                                                                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                                          | ACTIONS  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>BONS DE SOUSCRIPTION</b>                                          |          |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071 (k)  | 1        | \$ 0                             | 0,00                      | Keurig Dr Pepper, Inc. 4,300 % éch. 01/07/2026              | \$ 4 200                            | \$ 4 200                         | 0,09                      | 21,638 % éch. 11/08/2026 (e)(f) NGN                                                    | 839 200                             | \$ 596                           | 0,01                      |
|                                                                      |          |                                  |                           | 4,350 % éch. 17/07/2026                                     | 1 400                               | 1 397                            | 0,03                      | 21,659 % éch. 25/08/2026 (e)(f)                                                        | 489 500                             | 345                              | 0,01                      |
|                                                                      |          |                                  |                           | 4,350 % éch. 24/07/2026                                     | 6 400                               | 6 382                            | 0,14                      | 21,675 % éch. 18/08/2026 (e)(f)                                                        | 279 700                             | 198                              | 0,00                      |
|                                                                      |          |                                  |                           | 4,400 % éch. 15/07/2026                                     | 4 350                               | 4 342                            | 0,09                      | 21,676 % éch. 11/08/2026 (e)(f)                                                        | 1 280 700                           | 910                              | 0,02                      |
| <b>TITRES PRIVILÉGIÉS</b>                                            |          |                                  |                           | Lseg U.S. Fin Corp. 4,000 % éch. 01/09/2026                 | 250                                 | 248                              | 0,01                      | 21,690 % éch. 07/07/2026 (e)(f)                                                        | 637 800                             | 463                              | 0,01                      |
| Nationwide Building Society 10,250 %                                 | 7 094    | 1 214                            | 0,03                      | McCormick & Co. Inc. 4,300 % éch. 02/07/2026                | 2 150                               | 2 150                            | 0,05                      | 21,699 % éch. 25/08/2026 (e)(f)                                                        | 382 700                             | 270                              | 0,01                      |
|                                                                      |          |                                  |                           | Oglethorpe Power Corp. 4,050 % éch. 07/07/2026              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 21,704 % éch. 01/09/2026 (e)(f)                                                        | 382 700                             | 269                              | 0,01                      |
| <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                     |          |                                  |                           | Telus Corp. 4,270 % éch. 05/08/2026                         | 450                                 | 448                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>BILLETTS DE TRÉSORERIE</b>                                        |          |                                  |                           | 2 250                                                       | 2 236                               | 0,05                             |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Campbell Soup Co. 4,180 % éch. 09/09/2026                            | \$ 1 100 | 1 091                            | 0,02                      | Triton Container International Ltd. 4,330 % éch. 06/07/2026 | 2 600                               | 2 598                            | 0,06                      | des Instruments à court terme                                                          |                                     | 109 184                          | 2,37                      |
| 4,270 % éch. 30/09/2026                                              | 750      | 742                              | 0,02                      | 4,350 % éch. 02/07/2026                                     | 250                                 | 250                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Constellation Energy Corp. 4,100 % éch. 01/07/2026                   | 1 050    | 1 050                            | 0,02                      |                                                             |                                     | 93 622                           | 2,03                      | Total des Valeurs mobilières                                                           | \$ 6 137 605                        | 132,92                           |                           |
| 4,100 % éch. 03/08/2026                                              | 1 400    | 1 394                            | 0,03                      | <b>BILLETTS À COURT TERME</b>                               |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,110 % éch. 03/08/2026                                              | 1 950    | 1 942                            | 0,04                      | Kona Spc Ltd. 5,718 % éch. 15/09/2026                       | € 1 100                             | 1 258                            | 0,03                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,110 % éch. 04/08/2026                                              | 1 200    | 1 195                            | 0,03                      |                                                             |                                     |                                  |                           | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,120 % éch. 05/08/2026                                              | 950      | 946                              | 0,02                      | 23,650 % éch. 13/10/2026 (e)(f) EGP                         | 32 475                              | 620                              | 0,01                      | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)   | 770 713                             | 9 403                            | 0,20                      |
| 4,150 % éch. 02/07/2026                                              | 2 800    | 2 799                            | 0,06                      | 24,000 % éch. 13/10/2026 (e)(f)                             | 44 500                              | 849                              | 0,02                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| eBay, Inc. 4,060 % éch. 24/08/2026                                   | 1 300    | 1 292                            | 0,03                      | 24,060 % éch. 20/10/2026 (e)(f)                             | 11 500                              | 219                              | 0,01                      | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (i) | 1 496 908                           | 16 840                           | 0,37                      |
| Entergy Corp. 4,050 % éch. 01/09/2026                                | 700      | 695                              | 0,01                      |                                                             |                                     | 1 688                            | 0,04                      | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (i)                | 11 069 896                          | 113 688                          | 2,46                      |
| 4,100 % éch. 08/07/2026                                              | 700      | 699                              | 0,01                      | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>                              |                                     |                                  |                           | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)        | 17 702 922                          | 176 538                          | 3,82                      |
| 4,100 % éch. 23/07/2026                                              | 1 550    | 1 546                            | 0,03                      | 20,537 % éch. 14/01/2027 (e)(f) NGN                         | 3 714 500                           | 2 430                            | 0,05                      |                                                                                        |                                     | 316 469                          | 6,85                      |
| 4,120 % éch. 03/09/2026                                              | 650      | 645                              | 0,01                      | 20,607 % éch. 21/01/2027 (e)(f)                             | 3 569 500                           | 2 325                            | 0,05                      | Total des Fonds d'investissement                                                       | \$ 450 673                          | 9,76                             |                           |
| Equifax Inc. 4,140 % éch. 30/07/2026                                 | 5 150    | 5 133                            | 0,11                      | 20,677 % éch. 28/01/2027 (e)(f)                             | 3 581 800                           | 2 323                            | 0,05                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Evergy Missouri West, Inc. 4,230 % éch. 01/07/2026                   | 250      | 250                              | 0,01                      | 21,097 % éch. 07/07/2026 (e)(f)                             | 559 400                             | 407                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Fidelity National Information Services, Inc. 4,000 % éch. 07/07/2026 | 3 250    | 3 248                            | 0,07                      | 21,137 % éch. 06/10/2026 (e)(f)                             | 115 950                             | 80                               | 0,00                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 08/07/2026                                              | 2 550    | 2 548                            | 0,05                      | 21,241 % éch. 14/07/2026 (e)(f)                             | 289 876                             | 209                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 09/07/2026                                              | 3 300    | 3 297                            | 0,07                      | 21,322 % éch. 28/07/2026 (e)(f)                             | 139 141                             | 100                              | 0,00                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 10/07/2026                                              | 2 900    | 2 897                            | 0,06                      | 21,450 % éch. 07/07/2026 (e)(f)                             | 699 300                             | 508                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Glencore Funding LLC 4,040 % éch. 04/08/2026                         | 1 950    | 1 942                            | 0,04                      | 21,480 % éch. 28/07/2026 (e)(f)                             | 173 900                             | 125                              | 0,00                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,050 % éch. 10/08/2026                                              | 4 900    | 4 878                            | 0,11                      | 21,587 % éch. 04/08/2026 (e)(f)                             | 213 500                             | 152                              | 0,00                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,050 % éch. 11/08/2026                                              | 3 250    | 3 235                            | 0,07                      | 21,625 % éch. 11/08/2026 (e)(f)                             | 1 275 600                           | 906                              | 0,02                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| HCA, Inc. 4,270 % éch. 03/08/2026                                    | 5 750    | 5 726                            | 0,12                      |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,330 % éch. 27/07/2026                                              | 2 700    | 2 691                            | 0,06                      |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Jabil, Inc. 4,150 % éch. 06/07/2026                                  | 5 350    | 5 346                            | 0,12                      |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,150 % éch. 31/07/2026                                              | 3 350    | 3 338                            | 0,07                      |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,150 % éch. 18/08/2026                                              | 7 300    | 7 257                            | 0,16                      |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Jones Lang LaSalle Finance BV 4,130 % éch. 09/07/2026                | 1 300    | 1 299                            | 0,03                      |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                        | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOM                                   | 2,240 %         | 24/06/2026           | 02/07/2026         | CAD 100 000             | Province de l'Ontario 4,600 % échéance 02/12/2055                                  | \$ (72 470)         | \$ 70 485                                      | \$ 70 515                                                                      | 1,53                   |
|                                       | 2,240           | 10/06/2026           | 07/07/2026         | 330 000                 | Hydro-Québec 0,000 % échéance 15/02/2045                                           | (15 541)            | 232 599                                        | 232 901                                                                        | 5,04                   |
|                                       |                 |                      |                    |                         | Province de l'Ontario 0,000 % - 2,900 % échéance 02/06/2049 - 02/12/2050           | (227 004)           |                                                |                                                                                |                        |
| BPS                                   | 3,690           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 22 300               | Obligations du Trésor américain 3,000 % échéance 15/08/2048                        | (22 579)            | 22 300                                         | 22 302                                                                         | 0,48                   |
| BRC                                   | 3,720           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 71 500                  | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % échéance 15/04/2030 | (72 871)            | 71 500                                         | 71 507                                                                         | 1,55                   |
| CEW                                   | 2,250           | 26/06/2026           | 02/07/2026         | CAD 60 000              | Province de l'Ontario 3,750 % échéance 02/12/2053                                  | (31 161)            | 42 291                                         | 42 304                                                                         | 0,92                   |
|                                       |                 |                      |                    |                         | Province du Québec 4,400 % échéance 01/12/2055                                     | (12 160)            |                                                |                                                                                |                        |
|                                       | 2,270           | 25/06/2026           | 02/07/2026         | 20 000                  | Province de l'Ontario 2,800 % échéance 02/06/2048                                  | (14 347)            | 14 097                                         | 14 102                                                                         | 0,31                   |
| FICC                                  | 3,620           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 7 600                | Billets du Trésor américain 3,750 % échéance 15/05/2028                            | (7 752)             | 7 600                                          | 7 601                                                                          | 0,16                   |
| TOR                                   | 2,250           | 24/06/2026           | 14/07/2026         | CAD 140 000             | Province du Québec 3,500 % - 4,000 % échéance 01/09/2035 - 01/12/2045              | (101 568)           | 98 678                                         | 98 721                                                                         | 2,13                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                                    | \$ (577 453)        | \$ 559 550                                     | \$ 559 953                                                                     | 12,12                  |

(1) Comprend les intérêts courus.

## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                   | Long  | 12/2026           | 1 561              | \$ (345)                          | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2026           | 432                | (483)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois mars                            | Long  | 06/2027           | 608                | 907                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Long  | 09/2026           | 337                | 276                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026           | 1 228              | (722)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 551                | (847)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026           | 1 217              | (125)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre      | Court | 09/2026           | 195                | (447)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 4 355              | (657)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 9 673              | 1 111                             | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 5 235              | 4 749                             | 0,10                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 7 090              | (6 241)                           | (0,12)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 566                | (1 434)                           | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 116                | (385)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 328                | 885                               | 0,02                |
|                                                                                               |       |                   |                    | \$ (3 758)                        | (0,07)              |

#### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|----------|--------------|---------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | \$ 108,000      | 24/07/2026        | 68                 | \$ (19)  | \$ (5)       | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,500         | 24/07/2026        | 137                | (40)     | (18)         | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 109,500         | 24/07/2026        | 88                 | (20)     | (33)         | (0,01)              |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026     | 111,000         | 24/07/2026        | 293                | (71)     | (29)         | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,250         | 02/07/2026        | 68                 | (12)     | 0            | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750         | 02/07/2026        | 149                | (26)     | 0            | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250         | 02/07/2026        | 68                 | (13)     | (3)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500         | 02/07/2026        | 149                | (27)     | (3)          | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000         | 10/07/2026        | 58                 | (9)      | (5)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750         | 10/07/2026        | 58                 | (9)      | (2)          | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750         | 17/07/2026        | 83                 | (20)     | (10)         | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250         | 17/07/2026        | 86                 | (13)     | (19)         | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250         | 17/07/2026        | 83                 | (18)     | (17)         | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000         | 17/07/2026        | 86                 | (16)     | (5)          | 0,00                |
|                                                                                                           |                 |                   |                    | \$ (313) | \$ (149)     | (0,01)              |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                                |                 |                   |                    | \$       | (3 907)      | (0,08)              |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence      | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG         | 1,000 %              | 20/06/2030      | € 13 100                         | \$ 138                            | 0,01                |
| Deutsche Bank AG         | 1,000                | 20/12/2030      | 2 000                            | 12                                | 0,00                |
| General Electric Co.     | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 400                           | (3)                               | 0,00                |
| Lloyds Banking Group PLC | 1,000                | 20/12/2030      | € 5 600                          | 48                                | 0,00                |
|                          |                      |                 |                                  | \$ 195                            | 0,01                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | (5,000) %           | 20/12/2028      | \$ 43 718                        | \$ (381)                          | (0,01)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000 %              | 20/06/2031      | \$ 1 485                         | \$ 67                             | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 8 100                            | 39                                | 0,00                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 106                            | 0,00                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |        |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|--------|
| À payer                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £                 | 150 740                           | \$ (1 022)          | (0,02) |
| À recevoir                       | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,700     | 28/03/2034      |                   | 1 130                             | 55                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      |                   | 4 890                             | 148                 | 0,00   |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/03/2028      | ¥                 | 72 020 000                        | (546)               | (0,01) |
| À recevoir(4)                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2028      |                   | 39 879 000                        | (135)               | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 21/12/2052      | \$                | 24 100                            | 4 756               | 0,10   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,842     | 19/09/2053      |                   | 12 500                            | 884                 | 0,02   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,874     | 19/09/2053      |                   | 11 700                            | 848                 | 0,02   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,999     | 03/07/2053      |                   | 14 610                            | 4 741               | 0,10   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 10/12/2029      |                   | 40                                | 4                   | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,060     | 27/10/2053      |                   | 7 600                             | 2 588               | 0,06   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,250     | 20/06/2028      |                   | 104 830                           | (2 602)             | (0,06) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      |                   | 175 800                           | (956)               | (0,02) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031      |                   | 104 500                           | (211)               | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2055      |                   | 67 500                            | 1 325               | 0,03   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/12/2054      |                   | 4 000                             | 399                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,545     | 31/10/2030      |                   | 7 700                             | 123                 | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,550     | 31/10/2030      |                   | 1 400                             | 22                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      |                   | 5 400                             | 214                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,572     | 31/10/2030      |                   | 98 400                            | 1 453               | 0,03   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,592     | 31/10/2030      |                   | 80 660                            | 1 116               | 0,02   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,595     | 31/10/2030      |                   | 20 900                            | 286                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,601     | 31/10/2030      |                   | 18 500                            | 249                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,602     | 31/10/2030      |                   | 49 300                            | 659                 | 0,02   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,606     | 31/10/2030      |                   | 46 900                            | 619                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,623     | 31/10/2030      |                   | 20 300                            | 252                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,664     | 31/10/2030      |                   | 13 400                            | 141                 | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,677     | 31/10/2030      |                   | 10 900                            | 108                 | 0,00   |
| À recevoir(4)                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,679     | 15/02/2036      |                   | 1 850                             | 49                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,687     | 31/10/2030      |                   | 45 000                            | 425                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/10/2030      |                   | 21 300                            | 197                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,721     | 31/10/2030      |                   | 43 900                            | 345                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,739     | 31/10/2030      |                   | 15 700                            | 110                 | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 03/03/2036      |                   | 600                               | 14                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,749     | 31/10/2030      |                   | 29 000                            | 191                 | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      |                   | 117 800                           | (1 287)             | (0,03) |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      |                   | 118 230                           | 409                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2031      |                   | 58 800                            | 534                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      |                   | 168 500                           | 1 450               | 0,03   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      |                   | 73 800                            | 2 831               | 0,06   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2045      |                   | 16 300                            | 532                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      |                   | 7 000                             | 144                 | 0,00   |
| À recevoir(4)                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,800     | 14/07/2044      |                   | 4 150                             | 174                 | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,842     | 04/03/2030      |                   | 2 400                             | 10                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,870     | 05/03/2035      |                   | 1 500                             | 17                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,874     | 05/03/2035      |                   | 2 100                             | 23                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,884     | 25/03/2035      |                   | 3 500                             | 34                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,890     | 03/03/2035      |                   | 2 050                             | 20                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,899     | 11/03/2035      |                   | 2 300                             | 20                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 12/03/2035      |                   | 4 300                             | 34                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,908     | 04/03/2035      |                   | 3 800                             | 31                  | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 22/05/2036      |                   | 7 200                             | (12)                | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      |                   | 3 300                             | 9                   | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      |                   | 760                               | 27                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      |                   | 9 600                             | 3                   | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 26/02/2035      |                   | 3 000                             | 3                   | 0,00   |
| À recevoir(4)                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      |                   | 2 290                             | 3                   | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      |                   | 70 900                            | (702)               | (0,01) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,002     | 28/05/2036      |                   | 11 400                            | 17                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      |                   | 1 050                             | 35                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,015     | 15/11/2053      |                   | 1 050                             | 34                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,052     | 15/02/2056      |                   | 900                               | 21                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,059     | 15/02/2056      |                   | 1 900                             | 41                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,066     | 15/02/2046      |                   | 1 500                             | 32                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,076     | 15/02/2046      |                   | 2 200                             | 44                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,082     | 15/11/2053      |                   | 700                               | 15                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,083     | 15/11/2053      |                   | 4 100                             | 87                  | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 10,768    | 04/01/2027      | BRL               | 355 980                           | (4 149)             | (0,09) |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,175    | 02/01/2029      |                   | 236 940                           | (1 125)             | (0,02) |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,268    | 02/01/2029      |                   | 248 000                           | (811)               | (0,02) |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,354    | 02/01/2029      |                   | 1 446 600                         | (6 302)             | (0,14) |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 01/06/2032      | CAD               | 45 000                            | (401)               | (0,01) |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,500     | 28/04/2028      | COP               | 134 335 300                       | 1 859               | 0,04   |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,750     | 18/09/2030      |                   | 84 774 500                        | 1 280               | 0,03   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,650     | 17/12/2030      |                   | 3 464 600                         | (21)                | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,655     | 24/01/2035      |                   | 4 449 000                         | (25)                | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,725     | 17/12/2030      |                   | 1 689 300                         | (9)                 | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,788     | 17/12/2030      |                   | 3 378 200                         | (16)                | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,820     | 24/01/2035      |                   | 26 608 900                        | (77)                | 0,00   |
| À payer(4)                       | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,822     | 08/04/2036      | ZAR               | 17 500                            | 7                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,860     | 17/04/2036      |                   | 13 000                            | 7                   | 0,00   |



## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   |                       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel |         | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------|-----------|-----------------|-------------------|---------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,885 %   | 17/04/2036      | ZAR               | 11 000  | \$ 7                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500     | 18/09/2034      | AUD               | 278 720 | (5 481)                           | (0,12)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500     | 18/06/2035      |                   | 193 675 | (6 090)                           | (0,13)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,335     | 01/07/2036      | CZK               | 13 650  | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,375     | 01/07/2036      |                   | 13 650  | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,485     | 02/12/2035      |                   | 17 100  | 5                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,510     | 17/06/2036      |                   | 8 700   | 2                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,523     | 01/12/2035      |                   | 116 400 | 48                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,530     | 31/12/2035      |                   | 16 320  | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,700     | 23/03/2036      |                   | 3 600   | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | PRIBOR CZK à 6 mois   | 4,720     | 02/04/2036      |                   | 6 300   | (4)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois  | 0,650     | 12/04/2027      | €                 | 6 700   | (110)                             | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois  | 0,650     | 11/05/2027      |                   | 5 800   | (87)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois  | 0,700     | 11/04/2027      |                   | 3 400   | (56)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois  | 1,000     | 13/05/2027      |                   | 7 200   | (107)                             | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois  | 1,000     | 18/05/2027      |                   | 3 500   | (53)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois  | 2,415     | 09/07/2035      |                   | 81 800  | (1 313)                           | (0,03)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois  | 2,500     | 16/09/2031      |                   | 23 700  | (334)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois  | 2,750     | 16/09/2036      |                   | 61 600  | 168                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois  | 3,000     | 16/09/2056      |                   | 43 460  | 702                               | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois    | 4,625     | 01/07/2036      | PLN               | 2 450   | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois    | 4,665     | 01/07/2036      |                   | 2 450   | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois    | 4,685     | 02/12/2035      |                   | 3 000   | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois    | 4,723     | 01/12/2035      |                   | 20 940  | (42)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois    | 4,730     | 31/12/2035      |                   | 3 000   | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois    | 4,800     | 17/06/2036      |                   | 1 595   | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | WIBOR PLN à 6 mois    | 5,200     | 23/03/2036      |                   | 700     | 4                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | WIBOR PLN à 6 mois    | 5,230     | 02/04/2036      |                   | 1 200   | 7                                 | 0,00                |
|                                                    |                       |           |                 |                   |         | \$ (1 043)                        | (0,02)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                       |           |                 |                   |         | \$ (1 123)                        | (0,02)              |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 11 042                           | \$ 112   | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 5 758                            | 40       | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 26 009                           | 1 242    | 2 466        | 0,05                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 1 394 | \$ 2 466     | 0,05                |

##### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,255 %         | 16/08/2039        | 44 400                           | \$ 4 251  | \$ 2 820     | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,255           | 16/08/2039        | 44 400                           | 4 251     | 5 402        | 0,12                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,840           | 06/08/2026        | 15 600                           | 42        | 30           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,470           | 04/06/2035        | 14 500                           | 1 300     | 1 110        | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,470           | 04/06/2035        | 14 500                           | 1 300     | 1 176        | 0,03                |
| BPS          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,786           | 06/08/2026        | 20 500                           | 58        | 27           | 0,00                |
| DUB          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757           | 18/09/2026        | 308 500                          | 252       | 1 153        | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,111           | 28/05/2027        | 102 700                          | 337       | 330          | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,663           | 04/09/2026        | 9 400                            | 16        | 14           | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,808           | 31/07/2034        | 22 800                           | 2 000     | 1 268        | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,808           | 31/07/2034        | 22 800                           | 2 000     | 2 219        | 0,05                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757           | 18/09/2026        | 500 400                          | 385       | 1 871        | 0,04                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,110           | 28/05/2027        | 12 200                           | 40        | 39           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,800           | 12/07/2034        | 41 500                           | 3 587     | 2 280        | 0,05                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,800           | 12/07/2034        | 41 500                           | 3 587     | 4 029        | 0,09                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,819           | 06/08/2026        | 17 700                           | 48        | 29           | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 23 454 | \$ 23 797    | 0,52                |

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 11 042                           | \$ (39)    | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 5 758                            | (13)       | 0            | 0,00                |
| UAG          | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 52 018                           | (1 244)    | (2 059)      | (0,05)              |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 375,000     | 10/11/2026        | 7 667                            | (121)      | (66)         | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (1 417) | \$ (2 125)   | (0,05)              |

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004 %         | 08/07/2026        | 6 100                            | \$ (16) | \$ (15)      | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 6 100                            | (15)    | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (31) | \$ (15)      | 0,00                |

## OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                       | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GSC          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | \$ 95,188       | 06/08/2026        | 20 600                           | \$ (42)  | \$ (18)      | 0,00                |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 95,383          | 06/08/2026        | 23 500                           | (48)     | (17)         | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 95,531          | 06/08/2026        | 26 000                           | (60)     | (15)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,000 % éch. 01/09/2056 | 100,188         | 04/09/2026        | 13 600                           | (16)     | (11)         | 0,00                |
|              |                                                                                                                   |                 |                   |                                  | \$ (166) | \$ (61)      | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 %              | 17/11/2059      | \$ 487                           | \$ (14)                | \$ 14                            | \$ 0         | 0,00                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 6 694                            | 0                      | 6                                | 6            | 0,00                |
| UAG          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 6 633                            | (226)                  | 232                              | 6            | 0,00                |
|              |                             |                      |                 |                                  | \$ (240)               | \$ 252                           | \$ 12        | 0,00                |

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

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

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | À payer            | Apple, Inc.            | 200 000                      | 4,580 %       | \$ 59 126         | 13/07/2026      | \$ 0                   | \$ 1 397                         | \$ 1 397     | 0,03                |
|              | À payer            | Booking Holdings, Inc. | 356 000                      | 4,580         | 58 238            | 13/07/2026      | 0                      | (5 074)                          | (5 074)      | (0,11)              |
|              | À payer            | MercadoLibre, Inc.     | 35 700                       | 4,580         | 57 477            | 13/07/2026      | 0                      | (2 981)                          | (2 981)      | (0,06)              |
|              | À payer            | Nvidia Corp.           | 286 000                      | 4,580         | 58 593            | 13/07/2026      | 0                      | 1 509                            | 1 509        | 0,03                |
|              | À payer            | Ross Stores, Inc.      | 52 000                       | 4,580         | 12 434            | 13/07/2026      | 0                      | 1 396                            | 1 396        | 0,03                |
|              |                    |                        |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (3 753)                       | \$ (3 753)   | (0,08)              |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |      |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|------|
| AZD          | 07/2026              | AUD                | 133                  | \$ 92                 | \$ 0                     | \$ 0                                          | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | CNH                | 4 470                | 662                   | 3                        | 3                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | NZD                | 29 064               | 17 165                | 632                      | 632                                           | 0,01                   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 226                  | AUD 316               | 0                        | (7)                                           | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 14 552               | NZD 25 637            | 93                       | (62)                                          | 31                     | 0,00 |
|              | 08/2026              | NZD                | 23 584               | \$ 13 338             | 0                        | (93)                                          | (93)                   | 0,00 |
|              | 08/2026              | \$                 | 92                   | AUD 133               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 08/2026              |                    | 1 834                | CAD 2 599             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
| BOA          | 07/2026              | BRL                | 4 771                | \$ 918                | 0                        | (4)                                           | (4)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | £                  | 559                  | 747                   | 5                        | 5                                             | 5                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | IDR                | 167 473 098          | 9 300                 | 0                        | (18)                                          | (18)                   | 0,00 |
|              | 07/2026              | INR                | 1 530                | 16                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | NOK                | 14 575               | 1 474                 | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | PEN                | 27 900               | 8 285                 | 112                      | 0                                             | 112                    | 0,00 |

# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | SGD             | \$                | 51                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CNH               | 25 303             | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 13 964          | INR               | 1 322 992          | 9                     | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 634             | ¥                 | 100 787            | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 767           | KRW               | 2 706 485          | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 592           | NOK               | 24 075             | 0                     | (159)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 499             | PLN               | 1 886              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | \$                | 76                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             |                   | 2 508              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | ZAR               | 47 181             | 261                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | COP             | \$                | 14 396             | 0                     | (946)                                   | (0,02)              |
|              | 09/2026           | KZT             |                   | 27                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 10 906             | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 2 004              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 24 679             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 254             | PEN               | 862                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN             | \$                | 13 013             | 112                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             |                   | 1 420              | 7                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             |                   | 100 601            | 10                    | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             |                   | 4 043              | 100                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             |                   | 3 367              | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             |                   | 152                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               |                   | 11 172             | 0                     | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               |                   | 5 498              | 47                    | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             |                   | 14 703             | 16                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 3 734              | 39                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 8 250              | 0                     | (121)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             |                   | 1 232              | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             |                   | 271                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             |                   | 2 508              | 46                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 3 529              | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 532             | BRL               | 2 682              | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 397           | £                 | 4 815              | 24                    | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9 664           | INR               | 916 925            | 45                    | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 144           | ¥                 | 340 925            | 0                     | (46)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 516           | KRW               | 2 299 242          | 0                     | (31)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 186             | KWD               | 57                 | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 975           | TRY               | 285 743            | 75                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 790           | TWD               | 88 053             | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 15 777             | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             |                   | 499                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 24 533             | 0                     | (114)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | \$                | 953                | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 6 080              | 54                    | (39)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | IDR               | 260 621 695        | 16                    | (293)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 602             | THB               | 19 740             | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 05/2030           | KWD             | \$                | 3 900              | 200                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2030           | 243             |                   | 820                | 25                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2031           | 304             |                   | 1 024              | 30                    | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | CAD             |                   | 1 700              | 49                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 4 608              | 28                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             |                   | 24 966             | 951                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | TRY             |                   | 2 236              | 0                     | (27)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | TRY               | 2 006 304          | 328                   | 0                                       | 0,01                |
| BSH          | 07/2026           | ZAR             | \$                | 78 710             | 830                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | \$              | ZAR               | 22 764             | 90                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | \$                | 422                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | ¥                 | 1 806 623          | 0                     | (247)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 23 080          | NZD               | 40 849             | 157                   | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 08/2026           | NZD             | \$                | 23 106             | 0                     | (157)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | AUD               | 607                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | \$                | 94 895             | 0                     | (9 875)                                 | (0,21)              |
|              | 09/2026           | PEN             |                   | 21 053             | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             |                   | 1 077              | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             |                   | 34                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               |                   | 3 623              | 54                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             |                   | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 4 224              | 104                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 5 583              | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             |                   | 1 458              | 91                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 43 085             | 286                   | (166)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             |                   | 525                | 24                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CAD               | 2 823              | 0                     | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 366           | €                 | 4 602              | 0                     | (105)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 17 687          | HUF               | 5 394 510          | 0                     | (364)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 4 603           | IDR               | 82 590 241         | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 436           | INR               | 526 726            | 129                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 122           | KRW               | 4 792 463          | 0                     | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 27 495          | PEN               | 93 123             | 2                     | (193)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 177           | PLN               | 15 262             | 0                     | (116)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 997             | TWD               | 31 539             | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | \$                | 5 865              | 166                   | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 08/2026           | PEN             | 210 112           | \$ 59 579          | \$ 11                 | \$ (1 966)                              | \$ (1 955) (0,04)   |
|              | 08/2026           | \$              | 23                | COP 88 564         | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 1 217             | ILS 3 613          | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 09/2026           | CLP             | 3 431 906         | \$ 3 835           | 110                   | 0                                       | 110 0,00            |
|              | 09/2026           | IDR             | 175 558 833       | 9 725              | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 09/2026           | INR             | 53 118            | 553                | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 09/2026           | KZT             | 305 447           | 603                | 0                     | (20)                                    | (20) 0,00           |
|              | 09/2026           | MXN             | 8 784             | 507                | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 09/2026           | PEN             | 56 657            | 16 429             | 0                     | (138)                                   | (138) 0,00          |
|              | 09/2026           | THB             | 54 728            | 1 658              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 2 777             | COP 10 782 186     | 297                   | 0                                       | 297 0,01            |
|              | 09/2026           |                 | 3 048             | IDR 54 360 850     | 0                     | (35)                                    | (35) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 1 555             | MXN 27 817         | 27                    | 0                                       | 27 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 18                | PEN 61             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 10/2026           | PEN             | 22 014            | \$ 6 382           | 25                    | (70)                                    | (45) 0,00           |
|              | 11/2026           |                 | 10 819            | 3 163              | 9                     | 0                                       | 9 0,00              |
|              | 12/2026           |                 | 95 845            | 27 636             | 0                     | (292)                                   | (292) (0,01)        |
|              | 12/2026           | \$              | 5 122             | IDR 93 111 037     | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 01/2027           | PEN             | 47 039            | \$ 13 853          | 167                   | 0                                       | 167 0,00            |
|              | 07/2026           | CZK             | 3 421             | 164                | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 07/2026           | HUF             | 5 331             | 17                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | IDR             | 11 064 734        | 619                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | INR             | 203 398           | 2 154              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 07/2026           | SGD             | 4                 | 3                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 107               | CNY 731            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 437             | INR 138 644        | 25                    | 0                                       | 25 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 741               | NOK 6 882          | 0                     | (45)                                    | (45) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 8 188             | PEN 27 932         | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 4 172             | PLN 15 481         | 0                     | (54)                                    | (54) 0,00           |
|              | 07/2026           | ZAR             | 594 401           | \$ 36 719          | 510                   | 0                                       | 510 0,01            |
|              | 08/2026           | KZT             | 233 933           | 487                | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 08/2026           | PEN             | 142 066           | 42 092             | 511                   | 0                                       | 511 0,01            |
|              | 09/2026           | IDR             | 106 898 588       | 5 933              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 09/2026           | PEN             | 28 011            | 8 188              | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 1 871             | IDR 33 974 075     | 12                    | 0                                       | 12 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 2 154             | INR 204 777        | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
|              | 09/2026           | UZS             | 3 274 951         | \$ 257             | 0                     | (13)                                    | (13) 0,00           |
|              | 10/2026           |                 | 5 745 118         | 452                | 0                     | (19)                                    | (19) 0,00           |
|              | 11/2026           | KZT             | 286 482           | 578                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 12/2026           | UZS             | 5 031 000         | 387                | 0                     | (23)                                    | (23) 0,00           |
| FAR          | 07/2026           | AUD             | 281               | 195                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CAD             | 330 547           | 237 339            | 4 305                 | 0                                       | 4 305 0,09          |
|              | 07/2026           | CNH             | 22 668            | 3 351              | 11                    | 0                                       | 11 0,00             |
|              | 07/2026           | £               | 129 488           | 173 984            | 2 122                 | 0                                       | 2 122 0,05          |
|              | 07/2026           | INR             | 201 520           | 2 136              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 8 929 511         | 55 189             | 246                   | 0                                       | 246 0,01            |
|              | 07/2026           | PEN             | 9 410             | 2 783              | 25                    | 0                                       | 25 0,00             |
|              | 07/2026           | SGD             | 115 637           | 90 641             | 1 239                 | 0                                       | 1 239 0,03          |
|              | 07/2026           | \$              | 1 424             | CAD 1 983          | 0                     | (26)                                    | (26) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 9 266             | CNH 63 030         | 19                    | 0                                       | 19 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 5 022             | € 4 403            | 12                    | 0                                       | 12 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | £ 4                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 5 130             | HUF 1 584 809      | 0                     | (43)                                    | (43) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 2 112             | INR 201 520        | 17                    | 0                                       | 17 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 3 872             | ¥ 615 309          | 0                     | (86)                                    | (86) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 13 836            | PLN 50 897         | 0                     | (296)                                   | (296) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 298               | SEK 2 888          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 846 785           | \$ 51 312          | 0                     | (272)                                   | (272) (0,01)        |
|              | 08/2026           | CNH             | 62 891            | 9 266              | 0                     | (18)                                    | (18) 0,00           |
|              | 08/2026           | €               | 4 403             | 5 028              | 0                     | (12)                                    | (12) 0,00           |
| GLM          | 08/2026           | £               | 4                 | 5                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | ILS             | 7 050             | 2 462              | 94                    | 0                                       | 94 0,00             |
|              | 08/2026           | PEN             | 23 479            | 6 945              | 68                    | 0                                       | 68 0,00             |
|              | 08/2026           | SEK             | 2 883             | 298                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 195               | AUD 281            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 55 189            | ¥ 8 906 144        | 0                     | (247)                                   | (247) (0,01)        |
|              | 09/2026           | PEN             | 17 384            | \$ 5 057           | 0                     | (23)                                    | (23) 0,00           |
|              | 09/2026           | \$              | 1 032             | INR 98 878         | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 1 262             | MXN 22 287         | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | BRL             | 15                | \$ 3               | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 756 019         | 1 137              | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 13 142            | BRL 71 147         | 603                   | 0                                       | 603 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 4 409             | IDR 79 062 227     | 12                    | 0                                       | 12 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 1 137             | KRW 1 755 768      | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 88 560            | BRL 452 562        | 0                     | (1 805)                                 | (1 805) (0,04)      |
|              | 08/2026           |                 | 1 413             | INR 135 551        | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 09/2026           | CLP             | 2 706 703         | \$ 3 027           | 89                    | 0                                       | 89 0,00             |
|              | 09/2026           | DOP             | 28 267            | 460                | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 09/2026           | IDR             | 79 525 224        | 4 409              | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | MXN             | 15 820            | 908                | 9                     | 0                                       | 9 0,00              |
|              | 09/2026           | THB             | 298 154           | 9 239              | 208                   | 0                                       | 208 0,01            |
|              | 09/2026           | \$              | 10 429            | BRL 53 683         | 0                     | (212)                                   | (212) 0,00          |

# Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| IND JPM      | 09/2026           | \$              | 8 726             | IDR 156 680 676    | \$ 18                 | \$ (59)                                 | (41) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 7 528             | INR 721 780        | 53                    | (6)                                     | 47 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 1 790             | MXN 31 202         | 0                     | (16)                                    | (16) 0,00           |
|              | 07/2026           | DKK             | 385               | \$ 60              | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | AUD             | 9 476             | 6 628              | 64                    | 0                                       | 64 0,00             |
|              | 07/2026           | BRL             | 66 637            | 12 949             | 75                    | 0                                       | 75 0,00             |
|              | 07/2026           | CAD             | 24 549            | 17 264             | 0                     | (39)                                    | (39) 0,00           |
|              | 07/2026           | ILS             | 34 810            | 11 658             | 0                     | (27)                                    | (27) 0,00           |
|              | 07/2026           | INR             | 22 934            | 243                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | KRW             | 542 621           | 351                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | MXN             | 43 387            | 2 432              | 0                     | (48)                                    | (48) 0,00           |
|              | 07/2026           | NOK             | 12 403            | 1 253              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 831             | 1 673              | 62                    | 0                                       | 62 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 1 457             | AUD 2 042          | 0                     | (42)                                    | (42) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 2 367             | € 2 031            | 0                     | (45)                                    | (45) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 2 036             | £ 1 517            | 0                     | (22)                                    | (22) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 673               | IDR 12 100 920     | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 243               | INR 22 934         | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 526               | KRW 808 178        | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 2 136             | NZD 3 788          | 19                    | 0                                       | 19 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 5 388             | PLN 19 671         | 2                     | (156)                                   | (154) 0,00          |
|              | 07/2026           |                 | 2 446             | THB 81 773         | 16                    | 0                                       | 16 0,00             |
| MBC          | 08/2026           | HKD             | 2 219             | \$ 284             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | ILS             | 27 765            | 9 536              | 209                   | 0                                       | 209 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 6 624             | AUD 9 476          | 0                     | (63)                                    | (63) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 1 253             | NOK 12 409         | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | IDR             | 12 575 389        | \$ 696             | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | INR             | 58 574            | 614                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | MXN             | 21 398            | 1 213              | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 09/2026           | THB             | 236 192           | 7 235              | 105                   | (25)                                    | 80 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 2 985             | INR 284 590        | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           |                 | 5 057             | MXN 88 313         | 0                     | (35)                                    | (35) 0,00           |
|              | 10/2026           |                 | 12 949            | BRL 68 105         | 0                     | (75)                                    | (75) 0,00           |
|              | 10/2026           | UZS             | 1 054 712         | \$ 83              | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 12/2026           | MXN             | 198 021           | 11 218             | 37                    | 0                                       | 37 0,00             |
|              | 12/2026           | \$              | 108 296           | MXN 1 913 003      | 0                     | (286)                                   | (286) (0,01)        |
|              | 06/2027           | UZS             | 849 870           | \$ 63              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           | AUD             | 6 196             | 4 317              | 37                    | (13)                                    | 24 0,00             |
|              | 07/2026           | CHF             | 31 533            | 40 035             | 979                   | (36)                                    | 943 0,02            |
|              | 07/2026           | €               | 31 977            | 37 101             | 542                   | 0                                       | 542 0,01            |
|              | 07/2026           | £               | 2 446             | 3 277              | 30                    | 0                                       | 30 0,00             |
|              | 07/2026           | IDR             | 1 087 539         | 61                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | INR             | 204 202           | 2 162              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 07/2026           | NOK             | 4 000             | 402                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 7 819             | AUD 11 164         | 17                    | (101)                                   | (84) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 4 158             | CAD 5 826          | 4                     | (56)                                    | (52) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 119               | DKK 779            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| MYI          | 07/2026           |                 | 1 179             | £ 878              | 0                     | (13)                                    | (13) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 3 334             | INR 321 361        | 56                    | 0                                       | 56 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 10 595            | ¥ 1 683 406        | 0                     | (237)                                   | (237) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 1 774             | KRW 2 688 640      | 0                     | (37)                                    | (37) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 1 764             | NOK 16 356         | 0                     | (111)                                   | (111) 0,00          |
|              | 07/2026           |                 | 2 166             | NZD 3 838          | 18                    | 0                                       | 18 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 181               | SEK 1 763          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 08/2026           | DKK             | 778               | \$ 119             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | SEK             | 1 760             | 181                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 3 130             | AUD 4 539          | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 08/2026           |                 | 402               | NOK 4 002          | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 09/2026           | THB             | 778 365           | \$ 24 215          | 637                   | 0                                       | 637 0,01            |
|              | 09/2026           | \$              | 1 127             | CLP 1 006 734      | 0                     | (34)                                    | (34) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 9 048             | INR 865 595        | 43                    | (12)                                    | 31 0,00             |
|              | 07/2026           | €               | 66                | \$ 75              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | £               | 1 012             | 1 339              | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 18                | CHF 14             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 636             | £ 1 219            | 1                     | (19)                                    | (18) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 4 104             | IDR 73 181 634     | 0                     | (11)                                    | (11) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 3 371             | INR 324 347        | 52                    | 0                                       | 52 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 644               | TRY 30 342         | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 09/2026           | IDR             | 73 592 052        | \$ 4 104           | 25                    | 0                                       | 25 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 1 865             | IDR 33 188 486     | 0                     | (25)                                    | (25) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 3 366             | AUD 4 731          | 0                     | (89)                                    | (89) 0,00           |
| RYL          | 07/2026           |                 | 1 369             | CAD 1 889          | 0                     | (37)                                    | (37) 0,00           |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 493             | \$ 1 050           | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 07/2026           | £               | 227               | 305                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 251               | CNY 1 712          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 564             | IDR 28 067 505     | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 4 437             | INR 425 302        | 52                    | 0                                       | 52 0,00             |
|              | 08/2026           | HKD             | 2 094             | \$ 268             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 3 514             | INR 336 686        | 28                    | 0                                       | 28 0,00             |
| SCX          | 09/2026           | IDR             | 83 966 974        | \$ 4 651           | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 09/2026           | KZT             | 4 425             | 9                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | THB             | 106 162           | 3 288              | 72                    | 0                                       | 72 0,00             |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 09/2026           | \$              | 4 755             | IDR 85 360 965     | \$ 6                  | \$ (30)                                 | (24) 0,00           |
|              | 07/2026           | AUD             | 3 574             | \$ 2 466           | 0                     | (10)                                    | (10) 0,00           |
|              | 07/2026           | CAD             | 140 698           | 99 200             | 11                    | (32)                                    | (21) 0,00           |
|              | 07/2026           | CNH             | 38 406            | 5 677              | 19                    | 0                                       | 19 0,00             |
|              | 07/2026           | DKK             | 404               | 63                 | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | €               | 527 134           | 614 922            | 12 252                | 0                                       | 12 252 0,27         |
|              | 07/2026           | SGD             | 170               | 131                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 45                | CHF 36             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 635 426           | € 558 616          | 3 240                 | (1)                                     | 3 239 0,07          |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | £ 4                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 27 593            | ¥ 4 383 564        | 0                     | (621)                                   | (621) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 89 479            | SGD 115 876        | 107                   | 0                                       | 107 0,00            |
|              | 08/2026           | CHF             | 36                | \$ 45              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | €               | 558 592           | 636 260            | 0                     | (3 234)                                 | (3 234) (0,07)      |
|              | 08/2026           | £               | 4                 | 5                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | SGD             | 115 615           | 89 479             | 0                     | (112)                                   | (112) 0,00          |
|              | 08/2026           | \$              | 2 465             | AUD 3 574          | 10                    | 0                                       | 10 0,00             |
|              | 08/2026           |                 | 131               | SGD 170            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CAD             | 65 731            | \$ 47 642          | 1 312                 | 0                                       | 1 312 0,03          |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 094             | 1 391              | 36                    | 0                                       | 36 0,00             |
| SSB          | 07/2026           | €               | 2 480             | 2 814              | 0                     | (22)                                    | (22) 0,00           |
|              | 07/2026           | \$              | 173 337           | £ 131 131          | 707                   | 0                                       | 707 0,02            |
|              | 08/2026           | €               | 1 741             | \$ 1 988           | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 08/2026           | £               | 131 131           | 173 333            | 0                     | (706)                                   | (706) (0,01)        |
|              | 07/2026           | CAD             | 61 004            | 43 031             | 33                    | 0                                       | 33 0,00             |
| UAG          | 07/2026           | \$              | 4 247             | PLN 15 520         | 0                     | (118)                                   | (118) 0,00          |
|              | 09/2026           | COP             | 24 112 452        | \$ 6 461           | 0                     | (412)                                   | (412) (0,01)        |
|              | 09/2026           | MXN             | 9 036             | 515                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | THB             | 13 300            | 405                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 11/2026           | HUF             | 636 212           | € 1 765            | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
| WST          | 07/2026           | \$              | 44 304            | CHF 35 771         | 41                    | 0                                       | 41 0,00             |
|              | 08/2026           | CHF             | 35 643            | \$ 44 304          | 0                     | (41)                                    | (41) 0,00           |
|              |                   |                 |                   | \$ 37 295          | \$ (26 469)           | \$ 10 826                               | 0,23                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD             | 1 403             | \$ 987             | \$ 0                  | \$ (2)                                  | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 987               | CAD 1 401          | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
| BPS          | 07/2026           |                 | 1 684             | 2 329              | 0                     | (43)                                    | (43) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 47                | 65                 | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
| MBC          | 07/2026           |                 | 41                | 58                 | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 1 821             | 2 514              | 0                     | (49)                                    | (49) 0,00           |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 829               | \$ 585             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 1 816             | CAD 2 504          | 0                     | (51)                                    | (51) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 585               | 828                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              |                   |                 |                   | \$ 2               | \$ (147)              | \$ (145)                                | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | \$              | 3 213             | CHF 2 511          | \$ 0                  | \$ (100)                                | (100) (0,01)        |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 46                | \$ 57              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 3 670             | CHF 2 875          | 0                     | (106)                                   | (106) 0,00          |
| MYI          | 08/2026           | CHF             | 14                | \$ 18              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 2 743             | 3 391              | 0                     | (10)                                    | (10) 0,00           |
| SSB          | 08/2026           | \$              | 3 391             | CHF 2 733          | 10                    | 0                                       | 10 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 3 489             | 2 743              | 0                     | (89)                                    | (89) 0,00           |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 2 736             | \$ 3 389           | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 3 389             | CHF 2 726          | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              |                   |                 |                   | \$ 13              | \$ (308)              | \$ (295)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et G Détail en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 28                | € 24               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0 0,00              |
| BPS          | 07/2026           | €               | 545               | \$ 621             | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 53 787            | € 46 169           | 0                     | (1 002)                                 | (1 002) (0,02)      |

## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BSH          | 07/2026           | €               | \$                | 54                 | \$                    | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | €                 | 42 973             |                       | 0                                       | (0,02)              |
| CBK          | 07/2026           |                 |                   | 441                |                       | (973)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | \$                | 42 550             |                       | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | €                 | 48 594             |                       | (119)                                   | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | €               | \$                | 50 945             |                       | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | €                 | 58 026             |                       | (333)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 |                   | 2 783              |                       | (219)                                   | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | €               | \$                | 44 410             |                       | (54)                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | €                 | 50 509             |                       | 0                                       | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 |                   | 44 410             |                       | (258)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$              | €                 | 53 858             |                       | (1 073)                                 | 0,01                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 44 410             |                       | 0                                       |                     |
|              |                   |                 |                   | 257                |                       | 257                                     |                     |
|              |                   |                 |                   | \$ 824             | \$ (3 823)            | \$ (2 999)                              | (0,06)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |             |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|-------------|--------|
| AZD          | 07/2026              | \$                 | £                    | 1 196 764             | 891 430                  | \$ 0                                          | (13 616)               | \$ (13 616) | (0,30) |
| BOA          | 07/2026              |                    |                      | 1 078                 | 805                      | 0                                             | (9)                    | (9)         | 0,00   |
| BPS          | 07/2026              | £                  | \$                   | 791 918               | 1 044 385                | 0                                             | (6 687)                | (6 687)     | (0,14) |
|              | 07/2026              | \$                 | £                    | 597 922               | 446 206                  | 16                                            | (5 711)                | (5 695)     | (0,12) |
|              | 08/2026              |                    |                      | 1 044 787             | 792 243                  | 6 693                                         | 0                      | 6 693       | 0,14   |
| BRC          | 07/2026              |                    |                      | 989                   | 748                      | 4                                             | 0                      | 4           | 0,00   |
| CBK          | 07/2026              |                    |                      | 5 642                 | 4 202                    | 0                                             | (65)                   | (65)        | 0,00   |
| FAR          | 07/2026              | £                  | \$                   | 29                    | 39                       | 0                                             | 0                      | 0           | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | £                    | 713 779               | 530 795                  | 0                                             | (9 282)                | (9 282)     | (0,20) |
|              | 08/2026              |                    |                      | 39                    | 29                       | 0                                             | 0                      | 0           | 0,00   |
| JPM          | 07/2026              |                    |                      | 1 246 847             | 929 199                  | 0                                             | (13 570)               | (13 570)    | (0,29) |
| MBC          | 07/2026              |                    |                      | 29 373                | 21 895                   | 0                                             | (313)                  | (313)       | (0,01) |
| MYI          | 07/2026              |                    |                      | 22 868                | 17 027                   | 0                                             | (269)                  | (269)       | (0,01) |
| NSL          | 07/2026              | £                  | \$                   | 203 865               | 268 292                  | 0                                             | (2 287)                | (2 287)     | (0,05) |
|              | 08/2026              | \$                 | £                    | 268 285               | 203 865                  | 2 288                                         | 0                      | 2 288       | 0,05   |
| SCX          | 07/2026              | £                  | \$                   | 919 704               | 1 217 320                | 0                                             | (3 356)                | (3 356)     | (0,07) |
|              | 07/2026              | \$                 | £                    | 582                   | 434                      | 0                                             | (7)                    | (7)         | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    |                      | 1 217 271             | 919 704                  | 3 378                                         | 0                      | 3 378       | 0,07   |
| SOG          | 07/2026              | £                  | \$                   | 915 288               | 1 209 095                | 0                                             | (5 720)                | (5 720)     | (0,12) |
|              | 08/2026              | \$                 | £                    | 1 209 063             | 915 288                  | 5 726                                         | 0                      | 5 726       | 0,12   |
| SSB          | 07/2026              | £                  | \$                   | 11 890                | 15 717                   | 0                                             | (64)                   | (64)        | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | £                    | 15 717                | 11 890                   | 64                                            | 0                      | 64          | 0,00   |
|              |                      |                    |                      |                       |                          | \$ 18 169                                     | \$ (60 956)            | \$ (42 787) | (0,93) |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir |    | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|----|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | NOK               | 43 | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 |                   | 26 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           |                 |                   | 31 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | NOK             | \$                | 3  | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | NOK               | 33 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NOK             | \$                | 4  | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | NOK               | 27 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 42 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           |                 |                   | 1  | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   |    | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |



Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA                                                | 07/2026           | \$              | 1 633             | SEK                | 15 098                | \$                                      | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | SEK             | 207               | \$                 | 22                    | \$                                      | 0,00                |
| CBK                                                | 07/2026           | \$              | 1 730             | SEK                | 15 985                | \$                                      | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | SEK             | 9 457             | \$                 | 975                   | \$                                      | 0,00                |
| MBC                                                | 08/2026           | \$              | 975               | SEK                | 9 440                 | \$                                      | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | SEK             | 14 523            | \$                 | 1 492                 | \$                                      | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 1 719             | SEK                | 15 966                | \$                                      | 0,00                |
| MYI                                                | 08/2026           |                 | 1 468             |                    | 14 269                |                                         | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 35                |                    | 332                   |                                         | 0,00                |
| RYL                                                | 07/2026           | SEK             | 101               | \$                 | 11                    | \$                                      | 0,00                |
| SSB                                                | 08/2026           | \$              | 1                 | SEK                | 7                     | \$                                      | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$                 | 12                    | \$                                      | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$                 | (232)                 | \$                                      | (220)               |
|                                                    |                   |                 |                   |                    |                       |                                         | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$                                      | (15 300)            |
|                                                    |                   |                 |                   |                    |                       |                                         | (0,33)              |

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                     | \$ 10 500                     | \$ 3 701                   | 0,08                |
| Total des Autres actifs financiers                             |                               |                            |                     |
|                                                                |                               | \$ 3 701                   | 0,08                |
| <b>TITRES VENDUS À DÉCOUVERT</b>                               |                               |                            |                     |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 2,000 % éch. 01/07/2056                                        | 1 900                         | (1 517)                    | (0,04)              |
| 2,000 % éch. 01/08/2056                                        | 99 000                        | (79 045)                   | (1,70)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               |                            |                     |
|                                                                |                               | \$ (80 562)                | (1,74)              |
| Total des Investissements                                      |                               |                            |                     |
|                                                                |                               | \$ 7 050 637               | 152,71              |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               |                            |                     |
|                                                                |                               | \$ (2 433 734)             | (52,71)             |
| Actif net                                                      |                               |                            |                     |
|                                                                |                               | \$ 4 616 903               | 100,00              |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à rémunération en nature.
- (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (e) Titre à coupon zéro.
- (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (i) Affilié au Fonds.
- (j) Titre convertible conditionnel.
- (k) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,19 %) :

| Description de l'émetteur                                       | Date d'achat | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| Chick-fil-A Inc, 4,800 % éch. 21/07/2031                        | 23/04/2026   | \$ 7 000  | \$ 6 926     | 0,15                |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071 | 10/06/2022   | 0         | 0            | 0,00                |
| Hardwood Funding LLC 4,840 % éch. 07/06/2028                    | 11/03/2025   | 1 200     | 1 197        | 0,03                |
| Hardwood Funding LLC 4,980 % éch. 07/06/2030                    | 11/03/2025   | 1 600     | 1 593        | 0,03                |
| Hardwood Funding LLC 5,160 % éch. 07/06/2032                    | 11/03/2025   | 1 400     | 1 399        | 0,03                |
| Hardwood Funding LLC 5,430 % éch. 07/06/2037                    | 11/03/2025   | 1 500     | 1 509        | 0,03                |
| Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032                          | 29/07/2022   | 2 802     | 2 686        | 0,06                |
|                                                                 |              | \$ 15 502 | \$ 15 310    | 0,33                |

(l) Un titre d'une juste valeur globale de 930 \$ (31 décembre 2025 : 4 558 \$) et un montant en numéraire de 5 719 \$ (31 décembre 2025 : 1 813 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 2 263 \$) et un montant en numéraire de 1 088 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

Un montant en numéraire de 75 010 \$ (31 décembre 2025 : 74 594 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 60 590 \$ (31 décembre 2025 : 16 350 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 255 536                                                                        | \$ 5 742 045                                         | \$ 140 024                                        | \$ 6 137 605        |
| Fonds d'investissement                        | 450 673                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 450 673             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 559 550                                              | 0                                                 | 559 550             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (419)                                                                             | (19 911)                                             | 0                                                 | (20 330)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 3 701                                                | 0                                                 | 3 701               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (80 562)                                             | 0                                                 | (80 562)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 705 790</b>                                                                 | <b>\$ 6 204 823</b>                                  | <b>\$ 140 024</b>                                 | <b>\$ 7 050 637</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1 245                                                                          | \$ 5 533 710                                         | \$ 67 918                                         | \$ 5 602 873        |
| Fonds d'investissement                        | 444 796                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 444 796             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 1 412 243                                            | 0                                                 | 1 412 243           |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 3 306                                                                             | 94 682                                               | 0                                                 | 97 988              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 3 098                                                | 0                                                 | 3 098               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (81 567)                                             | 0                                                 | (81 567)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 449 347</b>                                                                 | <b>\$ 6 962 166</b>                                  | <b>\$ 67 918</b>                                  | <b>\$ 7 479 431</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 1,850 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (817)          | \$ (935)                                 | (0,02)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (935)</b>                          | <b>(0,02)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

|              | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
| Contrepartie | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (13 050)                                                | \$ 17 880               | \$ 4 830                          | \$ 28 874                                                  | \$ (32 800)             | \$ (3 926)                        |
| BOA          | 10 146                                                     | 830                     | 10 976                            | 11 031                                                     | 0                       | 11 031                            |
| BPS          | (10 497)                                                   | 9 280                   | (1 217)                           | 285                                                        | 0                       | 285                               |
| BRC          | 2 252                                                      | (2 690)                 | (438)                             | 34 866                                                     | (37 000)                | (2 134)                           |
| BSH          | (11 118)                                                   | 10 960                  | (158)                             | (5 517)                                                    | 5 410                   | (107)                             |
| CBK          | (2 135)                                                    | 2 040                   | (95)                              | (2 922)                                                    | 3 430                   | 508                               |
| DUB          | 2 403                                                      | (2 540)                 | (137)                             | (1 901)                                                    | 1 740                   | (161)                             |
| FAR          | (2 129)                                                    | 2 440                   | 311                               | (1 199)                                                    | 1 610                   | 411                               |
| GLM          | (1 101)                                                    | 380                     | (721)                             | (273)                                                      | 1 170                   | 897                               |
| GSC          | (35)                                                       | 0                       | (35)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| GST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| IND          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (10 500)                                                   | 15 930                  | 5 430                             | 3 137                                                      | 840                     | 3 977                             |
| MBC          | 1 304                                                      | (1 520)                 | (216)                             | (1 265)                                                    | 1 360                   | 95                                |
| MYC          | 8 248                                                      | (1 280)                 | 6 968                             | 6 707                                                      | 440                     | 7 147                             |
| MYI          | (286)                                                      | 350                     | 64                                | (40)                                                       | 70                      | 30                                |
| NSL          | 45                                                         | 0                       | 45                                | 176                                                        | 0                       | 176                               |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 22                                                         | 280                     | 302                               |
| RYL          | (126)                                                      | 0                       | (126)                             | (2)                                                        | 0                       | (2)                               |
| SCX          | 145                                                        | (170)                   | (25)                              | 1 779                                                      | (1 690)                 | 89                                |
| SOG          | 10 513                                                     | (10 970)                | (457)                             | 22 955                                                     | (23 890)                | (935)                             |
| SSB          | 1 181                                                      | (1 100)                 | 81                                | 2 544                                                      | (2 860)                 | (316)                             |
| UAG          | (561)                                                      | 500                     | (61)                              | 546                                                        | 0                       | 546                               |
| WST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | (218)                                                      | 0                       | (218)                             |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 19,79            | 15,85                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 35,89            | 30,63                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,56             | 0,10                 |
| Fonds d'investissement                                           | 4,13             | 3,70                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 5,13             | 11,74                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,07             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,31             | 0,20                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,80             | 1,14                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,03             | 0,03                 |
| Autres actifs                                                    | 33,29            | 36,53                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 1,12             | 1,08                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 26,61            | 21,70                |
| Obligations et billets municipaux                                                                        | 0,16             | 0,16                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 58,06            | 59,30                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 7,47             | 9,18                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 4,89             | 5,09                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 9,09             | 8,41                 |
| Émissions souveraines                                                                                    | 17,58            | 16,18                |
| Actions ordinaires                                                                                       | 5,54             | 0,11                 |
| Bons de souscription                                                                                     | 0,00             | 0,00                 |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,03             | 0,03                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 2,37             | 1,76                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 9,76             | 9,76                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 12,12            | 31,00                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | (0,07)           | 0,17                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | (0,01)           | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,02)           | (0,19)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,05             | 0,05                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,52             | 0,46                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,05)           | (0,05)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Options sur titres                                                                                       | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | (0,08)           | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,23             | (0,47)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,00)           | 2,20                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,08             | 0,07                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (1,74)           | (1,79)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (52,71)          | (64,20)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                    |                                     |                                  |                           | CHILI                                             |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |
| ARGENTINE                                                                             |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                             |                                     |                                  |                           | 28/11/2040                                                      |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                 |                                     |                                  |                           | e la Tesoreria de la Republica en Pesos           |                                     |                                  |                           | COP                                                             |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                                    |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 01/09/2030                           | CLP 73 980 000                      | \$79 225                         | 1,20                      | 13,250 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                                               | \$                                  | 9 500                            | \$7 623                   | 5,000 % éch. 01/10/2028                           | 66 530 000                          | 72 726                           | 1,11                      | 09/02/2033                                                      | 167 913 300                         | 51 391                           | 0,78                      |
| AZERBAÏDJAN                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/03/2035                           | 15 000 000                          | 15 851                           | 0,24                      | Total Colombie                                                  |                                     | 693 524                          | 10,54                     |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                       |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 01/10/2029                           | 89 905 000                          | 100 342                          | 1,52                      | COSTA RICA                                                      |                                     |                                  |                           |
| State Oil, Inc.                                                                       |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 01/10/2034                           | 400 000                             | 445                              | 0,01                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                           |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 24/03/2031                                                                 | 13 700                              | 13 549                           | 0,21                      | 6,000 % éch. 01/04/2033                           | 35 090 000                          | 39 418                           | 0,60                      | Obligation internationale du gouvernement costaricain           |                                     |                                  |                           |
| BRÉSIL                                                                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/01/2043                           | 1 480 000                           | 1 682                            | 0,03                      | 5,500 % éch. 21/11/2030                                         | €                                   | 11 000                           | 13 232                    |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                         |                                     |                                  |                           | 6,200 % éch. 01/10/2040                           | 6 980 000                           | 8 166                            | 0,12                      | 5,950 % éch. 27/04/2033                                         |                                     | 2 800                            | 3 415                     |
| Banco do Brasil S.A.                                                                  |                                     |                                  |                           | Total Chili                                       |                                     | 317 855                          | 4,83                      | 6,001 % éch. 16/01/2036                                         |                                     | 11 750                           | 14 224                    |
| 8,500 % éch. 29/07/2026                                                               | MXN                                 | 241 000                          | 13 837                    | ACTIONS                                           |                                     |                                  |                           | Total Costa Rica                                                |                                     | 30 871                           | 0,47                      |
| Vale S.A.                                                                             |                                     |                                  |                           | CHINE                                             |                                     |                                  |                           | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE                                              |                                     |                                  |                           |
| 0,000 %                                                                               | BRL                                 | 99 420                           | 7 709                     | ACTIONS ORDINAIRES                                |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 21 546                    | Kaisa Group Holdings Ltd. (b)                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République tchèque |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 0,33                      | 8 174 305                                         | 49                                  | 0,00                             | 1,200 % éch. 13/03/2031   |                                                                 |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                       |                                     |                                  |                           | VALEUR NOMINALE (en milliers)                     |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 23/06/2032 (h)                                     |                                     |                                  |                           |
| Oi S.A.                                                                               |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                     |                                     |                                  |                           | 1,950 % éch. 30/07/2037                                         |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 30/12/2050                                                               | \$                                  | 11 660                           | 0                         | Flourish Century                                  |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 13/10/2033                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 0,00                      | 6,600 % éch.                                      |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 03/03/2033                                         |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                 |                                     |                                  |                           | 04/02/2049 ^ (g)                                  |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 03/06/2036                                         |                                     |                                  |                           |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional                                                      | BRL                                 | 106 700                          | 19 017                    | ÉMISSIONS SOUVERAINES                             |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 24/10/2034                                         |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 01/01/2029                                                              |                                     |                                  | 0,29                      | Banque de développement chinois                   |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 11/11/2032 (h)                                     |                                     |                                  |                           |
| Total Brésil                                                                          |                                     |                                  | 40 563                    | 1,870 % éch. 05/09/2035                           |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 14/04/2034                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 0,62                      | 2,630 % éch. 08/01/2034                           |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/09/2030 (h)                                     |                                     |                                  |                           |
| ÎLES CAÏMANS                                                                          |                                     |                                  |                           | 2,820 % éch. 22/05/2033                           |                                     |                                  |                           | Total République tchèque                                        |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement chinois |                                     |                                  |                           | 236 282                                                         |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 1,650 % éch. 15/05/2035                           |                                     |                                  |                           | 3,59                                                            |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2026 (c)                                                           | \$                                  | 447                              | 1                         | 2,190 % éch. 25/09/2054                           |                                     |                                  |                           | DANEMARK                                                        |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (c)                                                           |                                     | 559                              | 4                         | 3,120 % éch. 25/10/2052                           |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                   |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (c)                                                           |                                     | 894                              | 7                         | 3,810 % éch. 14/09/2050                           |                                     |                                  |                           | Jyske Realkredit A/S                                            |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (c)                                                           |                                     | 894                              | 7                         | Total Chine                                       |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2053                                         |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (c)                                                           |                                     | 1 118                            | 7                         | 394 590                                           |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (c)                                                           |                                     | 1 118                            | 4                         | 394 639                                           |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (c)                                                           |                                     | 1 945                            | 6                         | COLOMBIE                                          |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 36                        | ÉMISSIONS SOUVERAINES                             |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 0,00                      | Bogota Distrito Capital                           |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                         |                                     |                                  |                           | 13,140 % éch. 05/11/2035                          |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Fish Pond Re Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch.                                      |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,570 % éch. 08/01/2027                                                               | 1 000                               | 1 006                            | 0,02                      | 22/01/2031 (e)                                    |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 26/03/2031                           |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               | 108                                 | 6                                | 0,00                      | 9,250 % éch. 28/05/2042                           |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 22/08/2029                          |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 28/12/2028 (a)                                                           | 752                                 | 17                               | 0,00                      | 11,750 % éch. 24/01/2035                          |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 12,000 % éch. 13/03/2058                          |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 28/12/2029 (a)                                                           | 1 259                               | 28                               | 0,00                      | 12,500 % éch. 27/02/2030                          |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 28/12/2030 (a)                                                           | 1 517                               | 27                               | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 28/12/2031 (a)                                                           | 2 286                               | 39                               | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 28/12/2032 (a)                                                           | 2 149                               | 43                               | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,721 % éch. 28/12/2028 (a)                                                           | 514                                 | 10                               | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Peru Payroll Deduction Finance Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 01/11/2029 (a)(c)                                                        | 1 707                               | 1 536                            | 0,02                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| QNB Finance Ltd.                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,538 % éch. 19/09/2027                                                               | 17 900                              | 17 895                           | 0,27                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                                                               | 26 900                              | 27 035                           | 0,41                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Red Dorsal Finance Ltd.                                                               |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 12/10/2031                                                               | 2 350                               | 2 316                            | 0,04                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.                                            |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 6,551 % éch. 15/11/2034                                                               | 5 550                               | 5 638                            | 0,09                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| VD DPR Finance Co.                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| 6,833 % éch. 15/03/2035                                                               | 10 900                              | 11 153                           | 0,17                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 66 749                    |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 1,02                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
| Total Îles Caïmans                                                                    |                                     |                                  | 66 785                    |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  | 1,02                      |                                                   |                                     |                                  |                           | 0                                                               |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                         | VALEUR                    |                         | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR                    |                         | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | ACTIONS                                             | JUSTE                   |                         | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|-------------------------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------------|-------------|-----------------------------------------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|------|
|                                     | NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) |                           |                                                     | NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) |                           |             |                                                     | VALEUR<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) |                           |      |
| ALLEMAGNE                           |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| Deutsche Bank AG                    |                           |                         |                           | 7,125 % éch. 15/08/2040                             | IDR                       | 482 923 000             | \$26 782                  | 0,41        | LUXEMBOURG                                          |                         |                         |                           |      |
| 8,010 % éch. 18/07/2034             | INR                       | 6 014 000               | \$62 201                  | 0,95                                                | 7,125 % éch. 15/06/2043   |                         | 13 786 000                | 763         | 0,01                                                | ACTIONS ORDINAIRES      |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     | 7,125 % éch. 15/08/2045   |                         | 587 013 000               | 32 571      | 0,49                                                | DrillCo Holding         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     | 7,500 % éch. 15/05/2038   |                         | 146 812 000               | 8 359       | 0,13                                                | Lux S.A. (g)            | 7 882                   | \$181                     | 0,00 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     | 7,500 % éch. 15/04/2040   |                         | 209 641 000               | 11 991      | 0,18                                                | Foresea Holding S.A.    | 3 120                   | 71                        | 0,00 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     | 8,375 % éch. 15/04/2039   |                         | 156 963 000               | 9 609       | 0,14                                                |                         |                         | 252                       | 0,00 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     | Total Indonésie           |                         |                           | 314 095     | 4,77                                                |                         |                         |                           |      |
| INTERNATIONALES                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | State Oil, Inc.                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 6,232 % éch. 22/07/2030                             | \$                        | 2 200                   | 2 193                     | 0,03        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                         |                         |                           |      |
| IRLANDE                             |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS          |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | BNPP AM Euro CLO DAC                                |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 2,804 % éch. 15/04/2031                             | €                         | 309                     | 352                       | 0,01        | FORESEA Holding S.A.                                |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | Dryden Euro CLO DAC                                 |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 3,143 % éch. 15/05/2034                             |                           | 2 056                   | 2 351                     | 0,03        | 7,500 % éch. 15/06/2030                             | \$                      | 137                     | 136                       | 0,00 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         | 2 703                     | 0,04        | Luminis S.A.                                        |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 9,649 % éch. 15/09/2038                             |                         | 11 900                  | 13 899                    | 0,21 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | Poinsettia Finance Ltd.                             |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 6,625 % éch. 17/06/2031                             |                         | 5 638                   | 5 556                     | 0,09 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         | 19 591                    | 0,30 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | Total Luxembourg                                    |                         |                         | 19 843                    | 0,30 |
| MALAISIE                            |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES               |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | Obligation internationale du gouvernement malaisien |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 3,582 % éch. 15/07/2032                             | MYR                       | 20 500                  | 5 058                     | 0,08        | LUMINIS S.A.                                        |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 3,844 % éch. 15/04/2033                             |                           | 669 950                 | 167 755                   | 2,55        | 9,649 % éch. 15/09/2038                             |                         | 11 900                  | 13 899                    | 0,21 |
|                                     |                           |                         |                           | 3,917 % éch. 15/07/2055                             |                           | 38 960                  | 9 275                     | 0,14        | Poinsettia Finance Ltd.                             |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 3,987 % éch. 23/04/2046                             |                           | 125 570                 | 31 015                    | 0,47        | 6,625 % éch. 17/06/2031                             |                         | 5 638                   | 5 556                     | 0,09 |
|                                     |                           |                         |                           | 4,054 % éch. 18/04/2039                             |                           | 262 152                 | 65 646                    | 1,00        |                                                     |                         |                         | 19 591                    | 0,30 |
|                                     |                           |                         |                           | 4,065 % éch. 15/06/2050                             |                           | 34 445                  | 8 457                     | 0,13        | Total Luxembourg                                    |                         |                         | 19 843                    | 0,30 |
|                                     |                           |                         |                           | 4,180 % éch. 16/05/2044                             |                           | 9 540                   | 2 411                     | 0,04        | MALAISIE                                            |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 4,254 % éch. 31/05/2035                             |                           | 2 850                   | 733                       | 0,01        | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 4,457 % éch. 31/03/2053                             |                           | 114 970                 | 29 923                    | 0,45        | Obligation internationale du gouvernement malaisien |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 4,696 % éch. 15/10/2042                             |                           | 47 547                  | 12 738                    | 0,19        | 3,582 % éch. 15/07/2032                             | MYR                     | 20 500                  | 5 058                     | 0,08 |
|                                     |                           |                         |                           | 4,762 % éch. 07/04/2037                             |                           | 150 498                 | 40 257                    | 0,61        | 3,844 % éch. 15/04/2033                             |                         | 669 950                 | 167 755                   | 2,55 |
|                                     |                           |                         |                           | 4,893 % éch. 08/06/2038                             |                           | 59 810                  | 16 168                    | 0,25        | 3,917 % éch. 15/07/2055                             |                         | 38 960                  | 9 275                     | 0,14 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 3,987 % éch. 23/04/2046                             |                         | 125 570                 | 31 015                    | 0,47 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,054 % éch. 18/04/2039                             |                         | 262 152                 | 65 646                    | 1,00 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,065 % éch. 15/06/2050                             |                         | 34 445                  | 8 457                     | 0,13 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,180 % éch. 16/05/2044                             |                         | 9 540                   | 2 411                     | 0,04 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,254 % éch. 31/05/2035                             |                         | 2 850                   | 733                       | 0,01 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,457 % éch. 31/03/2053                             |                         | 114 970                 | 29 923                    | 0,45 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,696 % éch. 15/10/2042                             |                         | 47 547                  | 12 738                    | 0,19 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,762 % éch. 07/04/2037                             |                         | 150 498                 | 40 257                    | 0,61 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,893 % éch. 08/06/2038                             |                         | 59 810                  | 16 168                    | 0,25 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | Émission d'investissement du gouvernement malaisien |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 3,612 % éch. 30/04/2035                             |                         | 1 900                   | 466                       | 0,01 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 3,974 % éch. 16/07/2040                             |                         | 73 020                  | 18 122                    | 0,28 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,291 % éch. 14/08/2043                             |                         | 49 210                  | 12 567                    | 0,19 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,417 % éch. 30/09/2041                             |                         | 1 203                   | 313                       | 0,00 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 4,662 % éch. 31/03/2038                             |                         | 30 600                  | 8 112                     | 0,12 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 5,357 % éch. 15/05/2052                             |                         | 5 917                   | 1 744                     | 0,03 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | Total Malaisie                                      |                         |                         | 430 760                   | 6,55 |
| MEXIQUE                             |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| ACTIONS ORDINAIRES                  |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | Hipootecaria Su Casita S.A.                         |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | de C.V. (b)                                         |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 212 074                                             |                         | 0                       | 0,00                      |      |
| VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | Corp. GEO S.A.B. de C.V.                            |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,875 % éch. 25/09/2014 ^                           | \$                        | 250                     | 0                         | 0,00        | MEXIQUE                                             |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 9,250 % éch. 30/06/2020 ^                           |                           | 700                     | 0                         | 0,00        | ACTIONS ORDINAIRES                                  |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.                  |                           |                         |                           |             | Obligation internationale du gouvernement mexicain  |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 9,620 % éch. 28/06/2018                             | MXN                       | 22 130                  | 0                         | 0,00        | 4,000 % éch. 24/08/2034 (e)                         |                         | 374                     | 21                        | 0,00 |
|                                     |                           |                         |                           | Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.             |                           |                         |                           |             | 7,500 % éch. 26/05/2033                             |                         | 664 200                 | 35 542                    | 0,54 |
|                                     |                           |                         |                           | 8,790 % éch. 09/12/2014 ^                           |                           | 29 700                  | 0                         | 0,00        | 7,750 % éch. 29/05/2031                             |                         | 496 900                 | 27 650                    | 0,42 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 7,750 % éch. 23/11/2034                             |                         | 991 000                 | 52 801                    | 0,80 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 7,750 % éch. 13/11/2042                             |                         | 1 570 977               | 76 880                    | 1,17 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 8,000 % éch. 15/04/2032                             |                         | 542 600                 | 30 131                    | 0,46 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 8,000 % éch. 21/02/2036                             |                         | 471 800                 | 25 217                    | 0,38 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 8,000 % éch. 07/11/2047                             |                         | 776 729                 | 38 215                    | 0,58 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 8,000 % éch. 31/07/2053                             |                         | 768 180                 | 37 320                    | 0,57 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 8,000 % éch. 29/04/2055                             |                         | 390 300                 | 18 876                    | 0,29 |
|                                     |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             | 8,500 % éch. 01/03/2029                             |                         | 1 702 210               | 98 883                    | 1,50 |
| MISSIONS SOUVERAINES                |                           |                         |                           |                                                     |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain  |                           |                         |                           |             |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 4,000 % éch. 24/08/2034 (e)                         |                           | 374                     | 21                        | 0,00        | KENYA                                               |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 7,500 % éch. 26/05/2033                             |                           | 664 200                 | 35 542                    | 0,54        | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 7,750 % éch. 29/05/2031                             |                           | 496 900                 | 27 650                    | 0,42        | République du Kenya                                 |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 7,750 % éch. 23/11/2034                             |                           | 991 000                 | 52 801                    | 0,80        | 9,086 % éch. 05/04/2028                             | \$                      | 2 667                   | \$2 678                   | 0,04 |
|                                     |                           |                         |                           | 7,750 % éch. 13/11/2042                             |                           | 1 570 977               | 76 880                    | 1,17        |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,000 % éch. 15/04/2032                             |                           | 542 600                 | 30 131                    | 0,46        |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,000 % éch. 21/02/2036                             |                           | 471 800                 | 25 217                    | 0,38        |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,000 % éch. 07/11/2047                             |                           | 776 729                 | 38 215                    | 0,58        |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,000 % éch. 31/07/2053                             |                           | 768 180                 | 37 320                    | 0,57        |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,000 % éch. 29/04/2055                             |                           | 390 300                 | 18 876                    | 0,29        |                                                     |                         |                         |                           |      |
|                                     |                           |                         |                           | 8,500 % éch. 01/03/2029                             |                           | 1 702 210               | 98 883                    | 1,50        |                                                     |                         |                         |                           |      |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 8,500 % éch. 31/05/2029                              | MXN                                 | 1 833 800                        | 1,62                      | <b>PHILIPPINES</b>                                  |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                       |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 28/02/2030                              |                                     | 1 499 800                        | 1,31                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | Transnet SOC Ltd.                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     | 634 448                          | 9,64                      | Obligation internationale du gouvernement philippin | PHP                                 | 212 010                          | 0,05                      | 10,658 % éch. 02/03/2028                                     | ZAR                                 | 80 686                           | \$ 4 919 0,08             |
| Total Mexique                                        |                                     | 634 448                          | 9,64                      | 6,250 % éch. 14/01/2036                             |                                     | 1 129 000                        | 0,26                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>PAYS-BAS</b>                                      |                                     |                                  |                           | Total Philippines                                   |                                     | 20 544                           | 0,31                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                      |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/03/2036                                      |                                     | 1 014 200                        | 53 049 0,81               |
| Douro Finance BV                                     |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/02/2031                                      |                                     | 530 346                          | 31 255 0,47               |
| 0,000 % éch. 04/06/2031                              | €                                   | 3 900                            | 3 939 0,06                | Obligation internationale du gouvernement polonais  |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 31/03/2032 (h)                                  |                                     | 145 500                          | 8 976 0,14                |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>               |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 25/04/2032 (h)                         | PLN                                 | 168 000                          | 0,58                      | 8,500 % éch. 31/01/2037 (h)                                  |                                     | 2 054 500                        | 124 876 1,90              |
| 7,924 % éch. 25/03/2027                              | \$                                  | 7 800                            | 7 790 0,12                | 2,000 % éch. 25/08/2036 (e)                         |                                     | 35 344                           | 0,13                      | 8,750 % éch. 31/01/2044 (h)                                  |                                     | 208 500                          | 12 490 0,19               |
| Total Pays-Bas                                       |                                     | 11 729                           | 0,18                      | 4,500 % éch. 25/07/2030 (h)                         |                                     | 911 500                          | 3,69                      | 8,875 % éch. 28/02/2035 (h)                                  |                                     | 2 687 000                        | 169 899 2,58              |
| <b>NIGERIA</b>                                       |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 25/07/2029 (h)                         |                                     | 416 400                          | 1,71                      | 9,000 % éch. 31/01/2040 (h)                                  |                                     | 2 054 200                        | 126 788 1,93              |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 25/01/2030 (h)                         |                                     | 80 400                           | 0,33                      | 9,875 % éch. 31/03/2039                                      |                                     | 177 600                          | 11 727 0,18               |
| Dangote Fertiliser Ltd.                              |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 25/10/2034 (h)                         |                                     | 57 770                           | 0,23                      | 10,125 % éch. 31/03/2042                                     |                                     | 153 400                          | 10 272 0,15               |
| 7,750 % éch. 05/05/2031                              |                                     | 8 500                            | 8 556 0,13                | 5,000 % éch. 25/10/2035                             |                                     | 527 780                          | 2,10                      | Total Afrique du Sud                                         |                                     | 566 407                          | 8,61                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>               |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/04/2029 (h)                         |                                     | 89 900                           | 0,38                      | <b>SUPRANATIONALES</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| Bank of Industry Ltd.                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/10/2033 (h)                         |                                     | 193 110                          | 0,83                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                           |
| 3,895 % éch. 23/08/2027                              | €                                   | 4 375                            | 4 991 0,08                | Total Pologne                                       |                                     | 656 552                          | 9,98                      | Banque arabe pour le développement économique en Afrique     |                                     |                                  |                           |
| Nigeria                                              |                                     |                                  |                           | <b>QATAR</b>                                        |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 25/01/2027                                      | €                                   | 500                              | 575 0,01                  |
| 11,300 % éch. 19/12/2032                             | \$                                  | 10 000                           | 10 137 0,15               | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | Banque de développement asiatique                            |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     | 15 128                           | 0,23                      | QatarEnergy                                         |                                     |                                  |                           | 15,500 % éch. 16/03/2029                                     | KZT                                 | 5 395 900                        | 11 447 0,17               |
| Total Nigeria                                        |                                     | 23 684                           | 0,36                      | 4,625 % éch. 23/06/2029                             | \$                                  | 14 200                           | 14 113 0,22               | Banque Ouest Africaine de Développement                      |                                     |                                  |                           |
| <b>PARAGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 14/10/2040                                      | €                                   | 9 900                            | 10 851 0,17               |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement qatari    |                                     | 9 200                            | 9 250 0,14                | Banque européenne pour la reconstruction et le développement |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen |                                     |                                  |                           | Total Qatar                                         |                                     | 23 363                           | 0,36                      | 6,050 % éch. 08/05/2029                                      | AZN                                 | 6 700                            | 3 941 0,06                |
| 7,900 % éch. 09/02/2031                              | PYG                                 | 52 285 000                       | 8 273 0,12                | <b>ROUMANIE</b>                                     |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 16/01/2029                                      |                                     | 2 000                            | 1 177 0,02                |
| 8,500 % éch. 04/03/2035                              |                                     | 80 755 000                       | 12 890 0,20               | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | Banque européenne d'investissement                           |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 04/04/2038                              |                                     | 27 702 000                       | 4 388 0,07                | Obligation internationale du gouvernement roumain   |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 15/11/2029                                      | PLN                                 | 108 500                          | 27 571 0,42               |
| Total Paraguay                                       |                                     | 25 551                           | 0,39                      | 4,150 % éch. 26/01/2028                             | RON                                 | 6 300                            | 1 334 0,02                | 4,125 % éch. 25/07/2030                                      |                                     | 88 800                           | 23 270 0,35               |
| <b>PÉROU</b>                                         |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 28/04/2036                             |                                     | 299 300                          | 54 095 0,82               | Total Supranationales                                        |                                     | 78 832                           | 1,20                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 11/10/2034                             |                                     | 14 900                           | 2 869 0,04                | <b>TANZANIE</b>                                              |                                     |                                  |                           |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.         |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 25/04/2035                             |                                     | 22 000                           | 4 829 0,07                | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                       |                                     |                                  |                           |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                              | PEN                                 | 36 800                           | 11 562 0,18               | 7,100 % éch. 31/07/2034                             |                                     | 95 200                           | 21 336 0,32               | Ministère des finances de Tanzanie                           |                                     |                                  |                           |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                             |                                     | 115 102                          | 37 134 0,56               | 7,350 % éch. 28/04/2031                             |                                     | 155 000                          | 34 901 0,53               | 7,859 % éch. 26/04/2028                                      | €                                   | 3 273                            | 3 746 0,06                |
|                                                      |                                     | 48 696                           | 0,74                      | 7,650 % éch. 27/07/2031                             |                                     | 33 000                           | 7 530 0,12                | <b>THAÏLANDE</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 29/04/2030                             |                                     | 5 400                            | 1 237 0,02                | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien   |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 29/09/2032                             |                                     | 21 000                           | 4 963 0,08                | Obligation internationale du gouvernement thaïlandais        |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 12/08/2040                              |                                     | 70 500                           | 18 057 0,27               | Total Roumanie                                      |                                     | 133 094                          | 2,02                      | 2,000 % éch. 17/06/2042                                      | THB                                 | 177 340                          | 4 834 0,07                |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                              |                                     | 181 300                          | 51 961 0,79               | <b>SERBIE</b>                                       |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch.                                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                              |                                     | 233 951                          | 74 310 1,13               | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | 17/06/2040 (h)                                               |                                     | 1 375 560                        | 42 479 0,65               |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                              |                                     | 180 200                          | 55 619 0,85               | Obligation internationale du gouvernement serbe     |                                     |                                  |                           | 2,980 % éch. 17/06/2045                                      |                                     | 820 815                          | 24 791 0,38               |
| 6,850 % éch. 12/02/2042                              |                                     | 18 900                           | 5 717 0,09                | 4,500 % éch. 20/08/2032                             | RSD                                 | 419 800                          | 3 946 0,06                | 3,450 % éch. 17/06/2043                                      |                                     | 1 092 447                        | 35 421 0,54               |
| 6,900 % éch. 12/08/2037                              |                                     | 7 200                            | 2 164 0,03                | 5,250 % éch. 27/07/2035                             |                                     | 2 072 400                        | 20 053 0,30               | 4,000 % éch. 17/06/2066                                      |                                     | 1 000                            | 35 0,00                   |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                              |                                     | 44 982                           | 15 007 0,23               | Total Serbie                                        |                                     | 23 999                           | 0,36                      | Total Thaïlande                                              |                                     | 107 560                          | 1,64                      |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                              |                                     | 359 000                          | 118 035 1,79              | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                               |                                     |                                  |                           | <b>TURQUIE</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,600 % éch. 12/08/2039                              |                                     | 106 900                          | 33 677 0,51               | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     | 374 547                          | 5,69                      | Eskom Holdings                                      |                                     |                                  |                           | SOCAR Turkey Enerji A/S                                      |                                     |                                  |                           |
| Total Pérou                                          |                                     | 423 243                          | 6,43                      | 0,000 % éch. 18/08/2027 (c)                         | ZAR                                 | 100 100                          | 5 193 0,08                | 5,558 % éch. 11/08/2026                                      | €                                   | 12 200                           | 13 935 0,21               |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2032 (c)                         |                                     | 254 000                          | 6 724 0,10                | Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.                              |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Transnet                                            |                                     |                                  |                           | 5,401 % éch. 15/12/2028                                      |                                     | 3 900                            | 4 476 0,07                |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 13,500 % éch. 18/04/2028                            |                                     | 3 600                            | 239 0,00                  |                                                              |                                     | 18 411                           | 0,28                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 12 156                           | 0,18                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement turc               |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 19/08/2026                                     | TRY                                 | 59 500                           | 1 279 0,02                |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 17/05/2028                                     |                                     | 1 315 656                        | 28 470 0,43               |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     | 29 749                           | 0,45                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | Total Turquie                                                |                                     | 48 160                           | 0,73                      |



| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| ÉMIRATS ARABES UNIS                                  |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                  |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 25/10/2037 \$ 4 221 \$2 641 0,04         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement colombien    |                                     |                                  |                           |
| ADCB Finance Cayman Ltd.                             |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 22/08/2029 COP 59 912 000 \$16 869 0,26   |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/10/2029 IDR 29 000 000 \$1 601 0,02  |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/07/2036 1 300 1 275 0,02              |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 24/01/2035 161 760 900 46 075 0,70        |                                     |                                  |                           |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement indonésien   |                                     |                                  |                           |
| 4,789 % éch. 03/06/2031 \$ 12 800 12 819 0,20        |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/03/2031 IDR 1 976 300 000 105 294 1,60 |                                     |                                  |                           |
| Total Émirats arabes unis 14 420 0,22                |                                     |                                  |                           | 13 970 0,21                                           |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/07/2035 92 225 000 5 016 0,07          |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/08/2040 175 421 000 9 728 0,15         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 182 982 2,78                                           |                                     |                                  |                           |
| ROYAUME-UNI                                          |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                        |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045 10 800 10 770 0,16            |                                     |                                  |                           | Obligations du Trésor américain                        |                                     |                                  |                           |
| ICBC Standard Bank PLC                               |                                     |                                  |                           | Ecopetrol S.A.                                        |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/08/2045 (h) \$ 1 357 1 347 0,02        |                                     |                                  |                           |
| 20,000 % éch. 18/09/2029 UZS 358 032 000 29 793 0,45 |                                     |                                  |                           | 5,843 % éch. 18/12/2027 7 500 7 527 0,12              |                                     |                                  |                           | Billets du Trésor américain                            |                                     |                                  |                           |
| 20,000 % éch. 13/12/2029 137 983 000 11 482 0,18     |                                     |                                  |                           | Ministère des finances de l'Angola                    |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/08/2035 (h) 2 140 2 113 0,03           |                                     |                                  |                           |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC       |                                     |                                  |                           | 9,388 % éch. 16/02/2027 6 000 6 015 0,09              |                                     |                                  |                           | 3 460 0,05                                             |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 05/04/2032 (c) \$ 35 700 29 080 0,44    |                                     |                                  |                           | Stepstone Group Midco GmbH                            |                                     |                                  |                           | Total États-Unis 260 150 3,95                          |                                     |                                  |                           |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                 |                                     |                                  |                           | 6,885 % éch. 26/04/2032 € 10 800 10 137 0,15          |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 10/10/2027 £ 1 600 2 255 0,03           |                                     |                                  |                           | Ziraat Bank                                           |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 6,764 % éch. 15/06/2034 \$ 8 400 8 554 0,13           |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |



## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 11,950 % éch.<br>05/08/2031 ^                     | \$ 1 410                            | \$769                            | 0,01                      | 26,220 % éch.<br>14/07/2026 (c)(d) EGP | 813 450                             | \$16 402                         | 0,25                      | <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAÎN</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                   |                                     | 18 195                           | 0,28                      |                                        |                                     | 82 064                           | 1,25                      | 7,400 % éch.<br>07/10/2026 (c)(d) ZAR                                                    | 34 200                              | \$2 051                          | 0,03                      |
| Total Venezuela                                   |                                     | 25 545                           | 0,39                      |                                        |                                     |                                  |                           | Total des Instruments à court terme                                                      |                                     | 270 370                          | 4,11                      |
| <b>ZAMBIE</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>         |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                                                             |                                     | \$ 6 897 391                     | 104,85                    |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                      |                                     |                                  |                           | 18,779 % éch.<br>21/07/2026 (c)(d) NGN | 1 598 320                           | 1 150                            | 0,02                      | <b>ACTIONS</b>                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement zambien |                                     |                                  |                           | 20,537 % éch.<br>14/01/2027 (c)(d)     | 40 687 871                          | 26 620                           | 0,40                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| 12,000 % éch. 03/05/2028 ZMW                      | 5 600                               | 299                              | 0,00                      | 20,607 % éch.<br>21/01/2027 (c)(d)     | 39 110 439                          | 25 475                           | 0,39                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| 22,000 % éch. 22/01/2029                          | 5 150                               | 330                              | 0,01                      | 20,677 % éch.<br>28/01/2027 (c)(d)     | 39 233 705                          | 25 441                           | 0,39                      | PIMCO Funds: Global                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 23,000 % éch. 22/01/2031                          | 21 310                              | 1 471                            | 0,02                      | 21,064 % éch.<br>13/10/2026 (c)(d)     | 13 002 700                          | 8 918                            | 0,14                      | Investors Series plc -<br>Fonds Asia Strategic<br>Interest Bond Fund (f)                 | 250 000                             | 2 813                            | 0,04                      |
| Total Zambie                                      |                                     | 2 100                            | 0,03                      | 21,150 % éch.<br>20/10/2026 (c)(d)     | 13 003 100                          | 8 893                            | 0,13                      | PIMCO Funds: Global                                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                  |                                     |                                  |                           | 21,186 % éch.<br>07/07/2026 (c)(d)     | 2 453 873                           | 1 783                            | 0,03                      | Investors Series plc -<br>Fonds Emerging Local<br>Bond ESG Fund (f)                      | 740 626                             | 11 687                           | 0,18                      |
| <b>BILLETS À COURT TERME</b>                      |                                     |                                  |                           | 21,265 % éch.<br>20/10/2026 (c)(d)     | 13 002 700                          | 8 892                            | 0,13                      | PIMCO Funds: Global                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Kona Spc Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | 21,270 % éch.<br>01/09/2026 (c)(d)     | 7 203 000                           | 5 061                            | 0,08                      | Investors Series plc -<br>Fonds PIMCO Emerging<br>Markets Opportunities<br>Fund (f)      | 1 886 327                           | 29 521                           | 0,45                      |
| 5,718 % éch. 15/09/2026                           | € 14 900                            | 17 042                           | 0,26                      | 21,310 % éch.<br>20/10/2026 (c)(d)     | 1 846 212                           | 1 263                            | 0,02                      | PIMCO Select Funds plc -<br>Fonds PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating NAV<br>Fund (f) | 11 083 241                          | 110 525                          | 1,68                      |
| <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                    |                                     |                                  |                           | 21,323 % éch.<br>20/10/2026 (c)(d)     | 2 600 600                           | 1 779                            | 0,03                      | PIMCO Specialty Funds                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 23,700 % éch.                                     |                                     |                                  |                           | 21,333 % éch.<br>15/09/2026 (c)(d)     | 6 233 000                           | 4 344                            | 0,07                      | Ireland p.l.c. - Fonds<br>PIMCO China Bond<br>Fund (f)                                   | 384 409                             | 6 020                            | 0,09                      |
| 15/09/2026 (c)(d) EGP                             | 343 900                             | 6 681                            | 0,10                      | 21,380 % éch.<br>03/11/2026 (c)(d)     | 9 489 900                           | 6 442                            | 0,10                      | Total des Fonds d'investissement                                                         |                                     | \$160 566                        | 2,44                      |
| 24,001 % éch.                                     |                                     |                                  |                           | 21,445 % éch.<br>27/10/2026 (c)(d)     | 8 783 400                           | 5 977                            | 0,09                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (c)(d)                                 | 727 100                             | 13 875                           | 0,21                      | 21,488 % éch.<br>03/11/2026 (c)(d)     | 9 114 200                           | 6 187                            | 0,09                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,050 % éch.                                     |                                     |                                  |                           | 21,531 % éch.<br>04/08/2026 (c)(d)     | 15 660 000                          | 11 163                           | 0,17                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 20/10/2026 (c)(d)                                 | 188 650                             | 3 584                            | 0,06                      | 21,539 % éch.<br>21/07/2026 (c)(d)     | 6 882 500                           | 4 952                            | 0,07                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,060 % éch.                                     |                                     |                                  |                           | 21,590 % éch.<br>21/07/2026 (c)(d)     | 9 076 000                           | 6 530                            | 0,10                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 20/10/2026 (c)(d)                                 | 31 700                              | \$ 602                           | 0,01                      | 21,645 % éch.<br>04/08/2026 (c)(d)     | 1 084 000                           | 773                              | 0,01                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,200 % éch.                                     |                                     |                                  |                           | 21,702 % éch.<br>18/08/2026 (c)(d)     | 10 696 300                          | 7 570                            | 0,11                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 22/09/2026 (c)(d)                                 | 206 900                             | 4 001                            | 0,06                      |                                        |                                     | 169 213                          | 2,57                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,299 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/09/2026 (c)(d)                                 | 14 500                              | 282                              | 0,00                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,326 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (c)(d)                                 | 68 900                              | 1 315                            | 0,02                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,449 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 10/11/2026 (c)(d)                                 | 242 425                             | 4 548                            | 0,07                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,451 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (c)(d)                                 | 188 550                             | 3 598                            | 0,06                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,451 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 17/11/2026 (c)(d)                                 | 962 500                             | 17 973                           | 0,27                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,651 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 10/11/2026 (c)(d)                                 | 394 625                             | 7 404                            | 0,11                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 24,686 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (c)(d)                                 | 94 300                              | 1 799                            | 0,03                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                     | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre       | Court | 09/2026              | 66                    | \$ (101)                                | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 95                    | (74)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre  | Long  | 09/2026              | 189                   | 260                                     | 0,00                   |
|                                                                                 |       |                      |                       | \$ 85                                   | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé      |       |                      |                       | \$ 85                                   | 0,00                   |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %      | 18/03/2028         | £ 3 900              | \$ (5)                                  | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 16/09/2028         | 1 400                | (3)                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,500        | 16/09/2036         | INR 6 182 190        | 7                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 17/06/2027         | ¥ 159 560 000        | (391)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 17/12/2027         | 96 840 000           | 1 589                                   | 0,02                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/03/2028         | 89 195 000           | (712)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 17/06/2028         | 2 350 000            | (10)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 16/09/2028         | 53 944 000           | (696)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,403        | 30/12/2026         | 807 190              | (1 365)                                 | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | 223 120              | (1 036)                                 | (0,02)                 |

| taux variable à payer/à recevoir |                               | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |        |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|--------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | THOR THB composé-OIS à 1 jour | 1,250 %   | 16/09/2028      | THB               | 3 395 300                         | \$ (138)            | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | THOR THB composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2031      |                   | 726 000                           | 81                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | THOR THB composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      |                   | 3 857 570                         | 1 426               | 0,02   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | THOR THB composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2031      |                   | 976 720                           | 356                 | 0,01   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | THOR THB composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2036      |                   | 752 300                           | 144                 | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 17/06/2028      | \$                | 1 603 000                         | (1 423)             | (0,02) |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 16/09/2028      |                   | 175 700                           | 229                 | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 21/06/2028      |                   | 26 400                            | 591                 | 0,01   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2030      |                   | 142 900                           | (1 514)             | (0,02) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2034      |                   | 21 500                            | 459                 | 0,01   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2034      |                   | 11 600                            | (71)                | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 20/12/2053      |                   | 4 000                             | 146                 | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/12/2028      |                   | 33 690                            | (610)               | (0,01) |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      |                   | 3 900                             | (112)               | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      |                   | 114 800                           | (2 403)             | (0,04) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      |                   | 4 460                             | 231                 | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 17/01/2034      |                   | 1 000                             | 28                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/12/2028      |                   | 28 100                            | 78                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      |                   | 143 500                           | 2 996               | 0,05   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      |                   | 146 000                           | (3 221)             | (0,05) |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      |                   | 403 100                           | 8 444               | 0,13   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      |                   | 87 030                            | (1 980)             | (0,03) |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      |                   | 500                               | 16                  | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035      |                   | 1 900                             | 37                  | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035      |                   | 34 200                            | (367)               | (0,01) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      |                   | 152 200                           | (4 133)             | (0,06) |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/06/2036      |                   | 310 500                           | (1 954)             | (0,03) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2036      |                   | 100                               | (2)                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 16/09/2036      |                   | 84 100                            | (239)               | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2036      |                   | 4 700                             | 32                  | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2045      |                   | 10 900                            | 427                 | 0,01   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2055      |                   | 58 200                            | 1 569               | 0,02   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 17/10/2053      |                   | 2 000                             | (101)               | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 16/10/2053      |                   | 500                               | (24)                | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,994     | 02/07/2034      |                   | 6 300                             | 5                   | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      |                   | 17 700                            | (423)               | (0,01) |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2056      |                   | 25 000                            | 119                 | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/06/2056      |                   | 4 200                             | (99)                | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060     | 02/07/2034      |                   | 2 500                             | (11)                | 0,00   |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 05/06/2034      |                   | 4 300                             | (19)                | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,086     | 13/01/2055      |                   | 100 500                           | (2 604)             | (0,04) |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155     | 02/10/2033      |                   | 5 080                             | 99                  | 0,00   |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170     | 03/10/2033      |                   | 7 000                             | 144                 | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 6,151     | 04/01/2027      | BRL               | 528 200                           | (23 287)            | (0,35) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,630     | 04/01/2027      |                   | 85 900                            | (1 543)             | (0,02) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 9,783     | 04/01/2027      |                   | 498 300                           | 8 504               | 0,13   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,795     | 04/01/2027      |                   | 227 500                           | (3 826)             | (0,06) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,815     | 04/01/2027      |                   | 156 000                           | (2 557)             | (0,04) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 9,840     | 04/01/2027      |                   | 185 700                           | (3 081)             | (0,05) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 9,840     | 04/01/2027      |                   | 195 800                           | 3 232               | 0,05   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,842     | 04/01/2027      |                   | 234 800                           | (3 818)             | (0,06) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,044    | 02/01/2029      |                   | 153 100                           | (3 072)             | (0,05) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,076    | 04/01/2027      |                   | 325 100                           | (5 829)             | (0,09) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,235    | 04/01/2027      |                   | 98 900                            | (1 405)             | (0,02) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,512    | 04/01/2027      |                   | 115 000                           | (1 556)             | (0,02) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,565    | 04/01/2027      |                   | 141 200                           | (1 781)             | (0,03) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,602    | 04/01/2027      |                   | 259 100                           | (3 890)             | (0,06) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 10,671    | 04/01/2027      |                   | 311 000                           | 3 767               | 0,06   |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 10,768    | 04/01/2027      |                   | 59 800                            | 729                 | 0,01   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,792    | 04/01/2027      |                   | 356 400                           | (4 405)             | (0,07) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 10,872    | 04/01/2027      |                   | 135 200                           | 1 572               | 0,02   |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 10,880    | 04/01/2027      |                   | 441 200                           | 4 909               | 0,08   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,064    | 04/01/2027      |                   | 259 100                           | (2 760)             | (0,04) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,133    | 04/01/2027      |                   | 102 100                           | 1 029               | 0,02   |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,135    | 04/01/2027      |                   | 96 300                            | 969                 | 0,02   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,169    | 04/01/2027      |                   | 96 950                            | (604)               | (0,01) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,490    | 02/01/2029      |                   | 132 400                           | (1 842)             | (0,03) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,510    | 04/01/2027      |                   | 399 700                           | 3 390               | 0,05   |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,513    | 04/01/2027      |                   | 198 100                           | 1 732               | 0,03   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,523    | 02/01/2029      |                   | 206 300                           | (2 789)             | (0,04) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,575    | 03/01/2028      |                   | 102 600                           | 1 141               | 0,02   |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,600    | 04/01/2027      |                   | 283 100                           | 2 294               | 0,04   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,695    | 03/01/2028      |                   | 223 200                           | (2 337)             | (0,04) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,730    | 02/01/2029      |                   | 274 000                           | (3 380)             | (0,05) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 11,736    | 04/01/2027      |                   | 164 500                           | 1 331               | 0,02   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,880    | 02/01/2031      |                   | 300 400                           | (2 737)             | (0,04) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,940    | 03/01/2033      |                   | 155 600                           | (2 177)             | (0,03) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,140    | 02/01/2031      |                   | 127 200                           | (1 485)             | (0,02) |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 12,243    | 02/01/2029      |                   | 269 500                           | 2 583               | 0,04   |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 12,255    | 02/01/2029      |                   | 64 700                            | 622                 | 0,01   |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,320    | 02/01/2029      |                   | 163 500                           | (1 503)             | (0,02) |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,670    | 02/01/2029      |                   | 400 000                           | (2 027)             | (0,03) |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,716 %  | 02/01/2029      | BRL               | 658 600 \$                        | (3 764) (0,06)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,750    | 02/01/2029      |                   | 257 400                           | (1 435) (0,02)      |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,760    | 02/01/2029      |                   | 399 000                           | 2 705 0,04          |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,780    | 02/01/2029      |                   | 21 000                            | 114 0,00            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,808    | 02/01/2029      |                   | 585 100                           | 3 109 0,05          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,867    | 02/01/2031      |                   | 538 700                           | (3 366) (0,05)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,905    | 02/01/2029      |                   | 71 900                            | (344) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,985    | 02/01/2031      |                   | 305 800                           | (1 737) (0,03)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,040    | 02/01/2029      |                   | 430 000                           | (1 796) (0,03)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,041    | 02/01/2031      |                   | 722 800                           | (3 648) (0,06)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,055    | 02/01/2029      |                   | 566 200                           | (2 807) (0,04)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,056    | 02/01/2029      |                   | 730 600                           | (3 499) (0,05)      |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,060    | 02/01/2029      |                   | 702 300                           | 3 124 0,05          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,115    | 02/01/2029      |                   | 268 000                           | (1 176) (0,02)      |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,120    | 02/01/2029      |                   | 159 100                           | 531 0,01            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,156    | 02/01/2031      |                   | 104 000                           | 446 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,183    | 02/01/2029      |                   | 100 000                           | (431) (0,01)        |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,189    | 02/01/2031      |                   | 93 900                            | 369 0,01            |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,200    | 02/01/2031      |                   | 11 000                            | (43) 0,00           |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,235    | 02/01/2031      |                   | 35 100                            | (131) 0,00          |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,235    | 02/01/2035      |                   | 532 300                           | (2 169) (0,03)      |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,250    | 02/01/2031      |                   | 210 400                           | (756) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,253    | 02/01/2029      |                   | 275 000                           | (1 014) (0,02)      |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,255    | 02/01/2031      |                   | 105 200                           | (382) (0,01)        |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,270    | 02/01/2029      |                   | 158 100                           | 683 0,01            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,289    | 02/01/2029      |                   | 1 272 200                         | 4 024 0,06          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,291    | 02/01/2029      |                   | 405 900                           | (1 802) (0,03)      |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,296    | 02/01/2031      |                   | 690 400                           | 2 472 0,04          |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,300    | 02/01/2031      |                   | 15 800                            | (54) 0,00           |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,310    | 02/01/2031      |                   | 468 500                           | 1 627 0,03          |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,315    | 02/01/2031      |                   | 122 400                           | (409) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,320    | 02/01/2029      |                   | 43 300                            | (186) 0,00          |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,335    | 02/01/2029      |                   | 53 900                            | 216 0,00            |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,340    | 02/01/2029      |                   | 671 800                           | 1 719 0,03          |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,350    | 02/01/2031      |                   | 73 000                            | (240) 0,00          |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,357    | 02/01/2029      |                   | 687 900                           | 2 293 0,04          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,405    | 02/01/2029      |                   | 398 400                           | (1 495) (0,02)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,425    | 02/01/2029      |                   | 120 100                           | (438) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,430    | 02/01/2029      |                   | 235 600                           | (854) (0,01)        |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,435    | 02/01/2029      |                   | 230 200                           | 505 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,470    | 02/01/2031      |                   | 102 500                           | (351) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,500    | 02/01/2029      |                   | 297 400                           | (1 031) (0,02)      |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,520    | 02/01/2031      |                   | 231 000                           | (574) (0,01)        |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      |                   | 59 800                            | (134) 0,00          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      |                   | 189 200                           | (408) (0,01)        |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,564    | 02/01/2031      |                   | 492 800                           | (1 098) (0,02)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,575    | 02/01/2031      |                   | 21 800                            | (66) 0,00           |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,580    | 02/01/2031      |                   | 20 700                            | (62) 0,00           |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,589    | 02/01/2029      |                   | 388 400                           | 1 141 0,02          |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,605    | 02/01/2031      |                   | 169 700                           | (341) (0,01)        |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,670    | 02/01/2031      |                   | 30 800                            | (53) 0,00           |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,680    | 02/01/2029      |                   | 323 700                           | (811) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,698    | 02/01/2031      |                   | 109 300                           | (167) 0,00          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,700    | 02/01/2031      |                   | 123 900                           | (170) 0,00          |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,790    | 02/01/2031      |                   | 65 100                            | (61) 0,00           |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,844    | 02/01/2029      |                   | 1 300                             | 2 0,00              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,882    | 02/01/2031      |                   | 169 300                           | (87) 0,00           |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,890    | 02/01/2031      |                   | 258 300                           | 152 0,00            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,923    | 02/01/2029      |                   | 225 900                           | 335 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,926    | 04/01/2027      |                   | 253 000                           | (401) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,927    | 04/01/2027      |                   | 1 079 800                         | (1 707) (0,03)      |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,998    | 02/01/2029      |                   | 465 300                           | (529) (0,01)        |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,013    | 02/01/2029      |                   | 30 000                            | (32) 0,00           |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,015    | 02/01/2031      |                   | 137 400                           | 15 0,00             |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,020    | 04/01/2027      |                   | 166 400                           | 216 0,00            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,026    | 02/01/2029      |                   | 158 200                           | 158 0,00            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,028    | 04/01/2027      |                   | 158 300                           | 203 0,00            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,035    | 02/01/2031      |                   | 92 800                            | 168 0,00            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,060    | 02/01/2031      |                   | 396 800                           | 124 0,00            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,087    | 02/01/2029      |                   | 77 100                            | 11 0,00             |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,140    | 02/01/2029      |                   | 152 100                           | (67) 0,00           |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,140    | 02/01/2031      |                   | 106 700                           | 72 0,00             |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,185    | 02/01/2029      |                   | 291 300                           | (44) 0,00           |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,245    | 02/01/2029      |                   | 36 500                            | (2) 0,00            |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,247    | 02/01/2031      |                   | 113 500                           | (131) 0,00          |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,334    | 02/01/2031      |                   | 139 500                           | (215) 0,00          |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,350    | 04/01/2027      |                   | 588 000                           | 250 0,00            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,370    | 02/01/2029      |                   | 161 100                           | 188 0,00            |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,375    | 02/01/2031      |                   | 23 300                            | 40 0,00             |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,455    | 02/01/2029      |                   | 290 300                           | (353) (0,01)        |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,505    | 02/01/2031      |                   | 296 200                           | (682) (0,01)        |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,514    | 02/01/2031      |                   | 285 200                           | (668) (0,01)        |

| taux variable à payer/à recevoir |                                   | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | Indice de taux variable           |           |                 |                   |                                   |                     |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,524 %  | 02/01/2029      | BRL               | 3 500                             | \$ (5) 0,00         |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,570    | 02/01/2029      |                   | 125 700                           | 203 0,00            |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,620    | 02/01/2029      |                   | 418 700                           | 815 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,695    | 02/01/2029      |                   | 405 400                           | 885 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,995    | 04/01/2027      |                   | 283 200                           | 433 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 15,036    | 02/01/2029      |                   | 167 900                           | 685 0,01            |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 15,065    | 02/01/2029      |                   | 161 900                           | 745 0,01            |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 17/06/2028      | CAD               | 571 700                           | (1 387) (0,02)      |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 17/06/2036      |                   | 129 500                           | 1 170 0,02          |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 16/09/2031      | CNY               | 492 545                           | 315 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 4,115     | 01/02/2031      | COP               | 14 558 000                        | 429 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 4,120     | 01/02/2031      |                   | 10 388 000                        | 307 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 5,675     | 18/06/2031      |                   | 20 000 000                        | 951 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,105     | 26/09/2029      |                   | 15 461 500                        | (417) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,140     | 26/09/2029      |                   | 63 562 000                        | (1 698) (0,03)      |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,290     | 22/01/2029      |                   | 65 042 000                        | (1 580) (0,02)      |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,390     | 05/09/2029      |                   | 57 712 100                        | (1 447) (0,02)      |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,400     | 09/09/2029      |                   | 32 137 300                        | (802) (0,01)        |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,410     | 09/08/2028      |                   | 27 919 200                        | 580 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,410     | 30/09/2031      |                   | 11 364 700                        | 213 0,00            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,498     | 28/04/2028      |                   | 37 947 620                        | 728 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,520     | 13/08/2031      |                   | 25 415 600                        | 781 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,530     | 02/01/2029      |                   | 16 771 600                        | (317) 0,00          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,540     | 09/08/2031      |                   | 27 300 000                        | 834 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,580     | 09/08/2031      |                   | 27 142 600                        | 816 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,650     | 12/08/2031      |                   | 20 330 800                        | 594 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,705     | 26/03/2031      |                   | 62 868 510                        | 1 667 0,03          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,750     | 18/12/2029      |                   | 13 699 000                        | (312) 0,00          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,760     | 21/11/2029      |                   | 68 819 000                        | (1 593) (0,02)      |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,765     | 05/12/2029      |                   | 19 609 600                        | (449) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,770     | 18/07/2029      |                   | 177 931 600                       | (4 041) (0,06)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,830     | 02/08/2029      |                   | 33 701 500                        | 743 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,900     | 28/04/2028      |                   | 25 279 200                        | 431 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,930     | 17/05/2029      |                   | 70 869 400                        | 1 436 0,02          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,950     | 18/06/2028      |                   | 108 440 700                       | (1 767) (0,03)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,970     | 28/04/2028      |                   | 58 558 000                        | 977 0,02            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,990     | 12/06/2029      |                   | 50 723 000                        | 990 0,02            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,990     | 25/11/2034      |                   | 88 471 800                        | 2 800 0,04          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,010     | 30/07/2029      |                   | 18 250 500                        | 377 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,020     | 04/12/2030      |                   | 24 925 400                        | 573 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,085     | 16/05/2029      |                   | 75 630 200                        | (1 445) (0,02)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,090     | 21/06/2029      |                   | 20 565 500                        | 383 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,140     | 18/06/2030      |                   | 37 816 000                        | (778) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,150     | 19/03/2027      |                   | 1 901 600                         | (13) 0,00           |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,150     | 28/04/2028      |                   | 54 611 800                        | 860 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,152     | 25/04/2029      |                   | 100 846 700                       | (1 907) (0,03)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,155     | 24/06/2029      |                   | 40 481 600                        | 735 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,168     | 17/06/2029      |                   | 28 186 700                        | (512) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,180     | 05/07/2029      |                   | 36 000 000                        | (707) (0,01)        |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,180     | 16/12/2029      |                   | 60 262 400                        | 1 160 0,02          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,200     | 18/06/2030      |                   | 70 650 800                        | 1 414 0,02          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,210     | 05/11/2029      |                   | 56 599 000                        | (1 108) (0,02)      |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,210     | 18/06/2030      |                   | 23 495 000                        | (468) (0,01)        |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,215     | 14/11/2028      |                   | 29 612 100                        | 586 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,250     | 18/06/2030      |                   | 7 036 000                         | 138 0,00            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,260     | 26/12/2027      |                   | 81 641 400                        | 1 013 0,02          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,260     | 18/06/2030      |                   | 11 803 000                        | (230) 0,00          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,280     | 18/06/2030      |                   | 44 652 000                        | 861 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,300     | 20/12/2029      |                   | 37 342 200                        | 677 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,300     | 18/06/2030      |                   | 88 944 100                        | (1 698) (0,03)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,340     | 20/12/2029      |                   | 23 365 600                        | 416 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,342     | 17/09/2027      |                   | 129 177 000                       | (1 360) (0,02)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,350     | 18/06/2030      |                   | 78 510 600                        | 1 413 0,02          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,360     | 17/09/2028      |                   | 109 778 200                       | 1 636 0,03          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,360     | 31/05/2029      |                   | 64 790 200                        | 1 100 0,02          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,370     | 26/04/2029      |                   | 105 284 000                       | 1 820 0,03          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,375     | 19/03/2030      |                   | 41 217 200                        | (739) (0,01)        |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,400     | 17/09/2028      |                   | 134 007 300                       | 1 966 0,03          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,400     | 23/12/2029      |                   | 54 000 000                        | 935 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,415     | 04/06/2029      |                   | 66 242 000                        | 1 093 0,02          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,430     | 15/05/2030      |                   | 26 162 500                        | 480 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,460     | 23/12/2029      |                   | 9 860 600                         | 166 0,00            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,498     | 16/05/2030      |                   | 103 299 000                       | 1 823 0,03          |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,510     | 29/04/2029      |                   | 27 597 500                        | 448 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,535     | 18/06/2030      |                   | 70 770 000                        | (1 196) (0,02)      |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,540     | 19/03/2030      |                   | 42 204 000                        | 695 0,01            |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,565     | 30/12/2027      |                   | 65 850 600                        | 735 0,01            |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,598     | 17/09/2030      |                   | 15 891 000                        | (264) 0,00          |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,611     | 19/03/2030      |                   | 60 831 300                        | (964) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,630     | 09/09/2030      |                   | 23 088 700                        | (411) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,630     | 17/09/2030      |                   | 30 780 100                        | (501) (0,01)        |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,650     | 19/03/2030      |                   | 51 456 000                        | (797) (0,01)        |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable      | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,650 %   | 17/09/2030      | COP | 37 806 000        | \$ 610                            | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,687     | 19/03/2030      |     | 49 104 200        | (745)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,690     | 26/12/2031      |     | 6 412 000         | (108)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,700     | 17/09/2030      |     | 20 843 000        | 328                               | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,710     | 17/09/2030      |     | 131 991 100       | (2 046)                           | (0,03)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,725     | 10/06/2030      |     | 11 230 000        | (171)                             | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,740     | 26/12/2031      |     | 86 000 000        | (1 393)                           | (0,02)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,755     | 17/09/2030      |     | 24 990 300        | (376)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,770     | 10/06/2030      |     | 33 683 000        | (499)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,790     | 19/03/2030      |     | 37 527 000        | (535)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,790     | 10/06/2030      |     | 22 456 000        | (328)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,800     | 18/06/2030      |     | 106 647 000       | 1 526                             | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,933     | 22/08/2029      |     | 116 705 300       | 1 522                             | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,980     | 17/12/2030      |     | 42 216 400        | 547                               | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,000     | 17/12/2030      |     | 80 000 000        | 1 020                             | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,045     | 30/12/2031      |     | 33 177 900        | (416)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,110     | 17/09/2035      |     | 54 467 500        | (799)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,155     | 17/09/2035      |     | 45 037 200        | (626)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,300     | 17/12/2030      |     | 44 856 000        | (434)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,300     | 26/03/2031      |     | 35 440 700        | 338                               | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,329     | 17/12/2035      |     | 122 028 200       | 1 356                             | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,490     | 30/06/2032      |     | 6 936 040         | (50)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,525     | 18/06/2035      |     | 38 158 000        | 279                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,650     | 17/12/2030      |     | 83 246 500        | (507)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,655     | 24/01/2035      |     | 13 863 000        | (78)                              | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,725     | 17/12/2030      |     | 36 164 000        | (193)                             | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,788     | 17/12/2030      |     | 72 329 000        | (339)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,820     | 27/02/2033      |     | 9 049 540         | 26                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,820     | 24/01/2035      |     | 51 267 600        | (149)                             | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,700    | 17/06/2031      |     | 7 661 400         | 45                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,710    | 17/06/2031      |     | 7 462 500         | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,720    | 18/03/2035      |     | 54 531 800        | (666)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,720    | 05/06/2036      |     | 26 214 800        | 349                               | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,720    | 09/06/2036      |     | 71 209 000        | 948                               | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,725    | 24/01/2035      |     | 43 522 400        | 531                               | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,730    | 17/06/2031      |     | 7 628 300         | 48                                | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,730    | 09/06/2036      |     | 1 308 000         | 18                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,740    | 17/06/2031      |     | 8 291 500         | 53                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,745    | 17/06/2031      |     | 15 256 500        | 98                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,750    | 18/03/2031      |     | 33 475 200        | (196)                             | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,755    | 05/06/2036      |     | 25 996 400        | 362                               | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,770    | 17/06/2031      |     | 15 256 500        | 102                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,776    | 18/03/2031      |     | 127 003 300       | (777)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,840    | 09/02/2033      |     | 64 189 900        | 720                               | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,200    | 17/06/2029      |     | 11 442 500        | 48                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,210    | 17/06/2029      |     | 11 774 100        | 50                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,250    | 17/06/2028      |     | 68 574 400        | 87                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,425    | 17/06/2028      |     | 16 251 600        | 28                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,450    | 17/06/2028      |     | 50 578 800        | 94                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,500    | 17/06/2031      |     | 54 797 700        | 999                               | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,550    | 17/06/2028      |     | 48 588 900        | 116                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,634    | 17/06/2028      |     | 104 071 300       | 293                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,645    | 17/06/2031      |     | 121 031 000       | (1 988)                           | (0,03)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,700    | 17/06/2031      |     | 17 307 000        | (295)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,720    | 17/06/2031      |     | 16 404 000        | (283)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,730    | 17/06/2031      |     | 16 733 000        | (291)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,870    | 17/06/2031      |     | 39 740 000        | (752)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,885    | 17/06/2031      |     | 79 872 000        | (1 525)                           | (0,02)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,910    | 17/06/2031      |     | 39 740 000        | (770)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,925    | 17/06/2033      |     | 55 059 000        | (1 498)                           | (0,02)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,930    | 17/06/2033      |     | 30 803 000        | (840)                             | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,000    | 17/06/2027      |     | 373 881 400       | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,170    | 18/03/2029      |     | 22 284 000        | (220)                             | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,220    | 17/06/2027      |     | 32 336 200        | 11                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,230    | 17/06/2027      |     | 32 337 600        | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,250    | 17/06/2027      |     | 64 675 700        | 27                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,330    | 18/03/2028      |     | 31 716 000        | (158)                             | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,340    | 17/06/2027      |     | 62 769 500        | 41                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | KORIBOR KRW à 3 mois         | 3,500     | 16/09/2036      | KRW | 172 870 400       | (986)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | KORIBOR KRW à 3 mois         | 3,750     | 16/09/2028      |     | 730 727 205       | 1 454                             | 0,02                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | KLIBOR MYR à 3 mois          | 3,500     | 16/09/2028      | MYR | 100 550           | (4)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | KLIBOR MYR à 3 mois          | 3,500     | 16/09/2031      |     | 344 780           | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | STIBOR SEK à 3 mois          | 2,021     | 07/10/2029      | SEK | 739 100           | 122                               | 0,00                |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois          | 2,298     | 07/10/2029      |     | 744 300           | 723                               | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TAIBOR TWD à 3 mois          | 2,250     | 16/09/2031      | TWD | 10                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,510     | 26/05/2031      | ZAR | 327 700           | (405)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,522     | 29/01/2031      |     | 372 300           | (740)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,610     | 28/04/2031      |     | 228 200           | (360)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,640     | 02/04/2031      |     | 230 200           | (336)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,673     | 14/04/2031      |     | 214 700           | (296)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,715     | 26/02/2031      |     | 313 500           | 593                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,745     | 06/03/2028      |     | 1 232 700         | 695                               | 0,01                |



| Taux variable à payer/à recevoir |                       | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,770 %   | 10/03/2028      | ZAR | 4 908 800         | \$ 189                            | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,770     | 12/11/2030      |     | 228 900           | (295)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,780     | 06/03/2028      |     | 734 300           | 388                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,815     | 08/12/2030      |     | 204 300           | 252                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,860     | 15/10/2030      |     | 90 400            | (95)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,880     | 17/09/2030      |     | 145 700           | (147)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,885     | 04/02/2031      |     | 223 100           | 331                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,910     | 30/10/2030      |     | 60 400            | 57                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 6,920     | 06/03/2031      |     | 75 600            | 80                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,040     | 22/09/2030      |     | 438 792           | 287                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,040     | 23/12/2030      |     | 244 750           | 274                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,070     | 04/12/2030      |     | 297 600           | 278                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,080     | 31/12/2030      |     | 264 550           | 271                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,091     | 17/02/2036      |     | 384 986           | 551                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,155     | 26/11/2030      |     | 41 300            | (16)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,160     | 26/11/2030      |     | 286 000           | 239                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,180     | 04/12/2030      |     | 139 850           | (52)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,210     | 22/04/2027      |     | 137 000           | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,220     | 02/09/2030      |     | 351 100           | 171                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,270     | 26/08/2030      |     | 440 900           | 146                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,310     | 02/09/2030      |     | 266 900           | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,310     | 02/10/2030      |     | 513 500           | 131                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,360     | 09/03/2031      |     | 264 300           | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,370     | 26/08/2030      |     | 1 197 700         | (602)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,370     | 27/01/2036      |     | 222 600           | (333)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,381     | 12/01/2036      |     | 162 700           | (231)                             | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,410     | 02/10/2030      |     | 217 790           | 57                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,520     | 02/04/2031      |     | 1 312 800         | (26)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,560     | 23/08/2029      |     | 210 700           | 30                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,560     | 22/09/2030      |     | 193 990           | 97                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,570     | 27/05/2030      |     | 150 000           | 86                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,700     | 08/06/2028      |     | 681 600           | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,700     | 18/06/2030      |     | 783 890           | (392)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,730     | 12/03/2030      |     | 460 400           | 446                               | 0,01                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,770     | 19/11/2027      |     | 66 300            | (14)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,775     | 18/03/2030      |     | 355 000           | (329)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,780     | 20/11/2027      |     | 52 700            | (11)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,790     | 31/01/2030      |     | 61 800            | 64                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,810     | 20/06/2030      |     | 152 280           | 157                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,822     | 08/04/2036      |     | 332 500           | 55                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,860     | 18/06/2030      |     | 436 900           | 453                               | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,950     | 07/05/2036      |     | 72 500            | 65                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 7,980     | 31/01/2030      |     | 546 600           | 777                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,000     | 03/01/2031      |     | 120 500           | 196                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,020     | 28/02/2031      |     | 203 700           | 341                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,070     | 30/11/2028      |     | 83 300            | (91)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,080     | 24/04/2036      |     | 1 176 400         | 880                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,160     | 31/03/2032      |     | 97 500            | 201                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,180     | 02/04/2036      |     | 120 900           | 241                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,190     | 31/03/2032      |     | 195 600           | 419                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,355     | 31/01/2030      |     | 177 700           | (168)                             | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,440     | 02/11/2028      |     | 254 500           | 401                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,599     | 05/06/2029      |     | 126 100           | (82)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,735     | 31/01/2030      |     | 110 200           | (325)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,820     | 31/01/2030      |     | 804 500           | (869)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 8,872     | 24/07/2034      |     | 386 900           | 1 570                             | 0,02                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois    | 10,150    | 18/05/2033      |     | 121 800           | 1 079                             | 0,02                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,420     | 01/09/2030      | CLP | 1 005 150         | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,410     | 01/09/2030      |     | 2 839 400         | 30                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,490     | 01/10/2028      |     | 9 945 000         | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,580     | 01/10/2028      |     | 24 240 400        | (76)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,590     | 01/10/2029      |     | 49 658 200        | (391)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,620     | 01/10/2029      |     | 907 000           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,675     | 18/03/2029      |     | 59 436 000        | (320)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,676     | 01/09/2030      |     | 1 964 000         | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,690     | 18/06/2030      |     | 10 090 800        | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,710     | 01/10/2029      |     | 15 580 000        | (85)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,740     | 18/03/2029      |     | 16 298 000        | (121)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,750     | 10/04/2030      |     | 28 532 500        | (163)                             | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,765     | 18/06/2030      |     | 4 336 000         | 21                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,805     | 17/06/2031      |     | 3 882 700         | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,855     | 18/12/2033      |     | 5 907 500         | (78)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,875     | 17/06/2031      |     | 31 424 800        | 244                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,890     | 01/10/2034      |     | 5 270 800         | (30)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,920     | 13/02/2034      |     | 2 120 600         | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,955     | 17/06/2031      |     | 24 222 000        | 283                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,960     | 19/03/2027      |     | 12 968 000        | (69)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,970     | 18/06/2032      |     | 8 384 100         | 83                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,005     | 17/06/2031      |     | 27 200 000        | 385                               | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,020     | 01/09/2030      |     | 2 050 000         | (35)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,030     | 20/03/2033      |     | 5 309 140         | (86)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,030     | 23/02/2034      |     | 11 055 300        | 200                               | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,060 %   | 18/03/2031      | CLP | 8 845 000         | \$ (162)                          | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,120     | 18/06/2035      |     | 4 560 900         | 34                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,140     | 01/03/2035      |     | 5 540 100         | (70)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 18/06/2030      |     | 14 129 300        | 292                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 17/06/2031      |     | 57 544 600        | (1 284)                           | (0,02)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 01/03/2035      |     | 8 600 000         | 107                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,180     | 18/06/2030      |     | 10 667 500        | 236                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,190     | 17/06/2031      |     | 5 504 000         | 128                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,210     | 01/03/2035      |     | 7 012 000         | (128)                             | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,215     | 18/03/2036      |     | 20 834 000        | 257                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,220     | 01/10/2028      |     | 4 896 800         | (98)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,240     | 01/09/2030      |     | 3 103 000         | (84)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,245     | 18/03/2036      |     | 5 736 000         | 86                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 17/06/2031      |     | 1 888 800         | 44                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 13/05/2033      |     | 6 921 100         | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,280     | 28/02/2030      |     | 47 124 800        | (649)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,300     | 18/05/2033      |     | 2 475 470         | (75)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,313     | 25/04/2034      |     | 10 208 500        | 287                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,325     | 17/06/2031      |     | 21 000 000        | (628)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,345     | 17/06/2031      |     | 19 001 000        | (587)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,350     | 01/10/2034      |     | 6 370 000         | 193                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,360     | 18/05/2033      |     | 2 594 000         | (85)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,360     | 26/04/2034      |     | 8 585 800         | 271                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 01/04/2033      |     | 3 613 700         | (133)                             | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 16/11/2033      |     | 4 525 900         | 158                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 03/07/2034      |     | 6 190 500         | 229                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,440     | 28/02/2035      |     | 11 706 000        | 437                               | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,450     | 28/06/2034      |     | 11 513 000        | (468)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,500     | 13/11/2028      |     | 8 851 800         | 65                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,550     | 01/10/2028      |     | 3 722 930         | (31)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,560     | 01/04/2033      |     | 4 616 000         | 220                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,660     | 01/04/2033      |     | 8 265 000         | 448                               | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,730     | 19/03/2035      |     | 3 083 000         | 186                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,750     | 13/05/2034      |     | 7 085 400         | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,780     | 03/10/2028      |     | 4 803 000         | (164)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,790     | 06/10/2033      |     | 8 590 000         | (570)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,820     | 01/09/2030      |     | 1 514 470         | (98)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,870     | 11/10/2033      |     | 4 522 700         | (312)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,940     | 20/10/2033      |     | 1 991 300         | (147)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,990     | 20/10/2033      |     | 18 919 110        | (1 462)                           | (0,02)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,000     | 02/10/2028      |     | 3 721 000         | (146)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,146     | 30/10/2032      |     | 32 521 400        | (2 688)                           | (0,04)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,235     | 26/10/2033      |     | 5 823 100         | (549)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 1,025     | 29/07/2030      | CZK | 92 800            | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,130     | 09/04/2030      |     | 623 500           | 849                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,145     | 09/04/2030      |     | 95 400            | (130)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,258     | 05/05/2030      |     | 232 600           | 332                               | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,290     | 30/04/2030      |     | 189 100           | 258                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,325     | 06/05/2030      |     | 656 700           | 857                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,363     | 29/05/2030      |     | 1 146 800         | (1 315)                           | (0,02)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,365     | 28/11/2029      |     | 175 200           | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,405     | 14/05/2030      |     | 236 800           | 277                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,445     | 01/08/2034      |     | 1 750 540         | (301)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,475     | 31/07/2034      |     | 95 050            | 134                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,480     | 15/07/2029      |     | 362 600           | (232)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,485     | 16/05/2030      |     | 218 200           | 225                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,513     | 30/09/2030      |     | 198 000           | (52)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,524     | 16/02/2034      |     | 334 600           | 654                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,525     | 13/03/2031      |     | 177 400           | (209)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,528     | 29/07/2034      |     | 235 400           | 286                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,530     | 15/07/2029      |     | 94 900            | (9)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,550     | 24/01/2030      |     | 102 500           | (87)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,554     | 11/06/2030      |     | 883 264           | 735                               | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,566     | 30/07/2034      |     | 95 200            | 102                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,575     | 03/07/2030      |     | 2 396 849         | (1 642)                           | (0,02)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,645     | 01/02/2029      |     | 1 498 300         | (792)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,670     | 09/02/2031      |     | 506 750           | (461)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,680     | 29/01/2031      |     | 604 400           | (486)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,705     | 12/08/2030      |     | 235 200           | 53                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,708     | 13/08/2030      |     | 1 187 800         | 276                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,720     | 12/02/2031      |     | 637 500           | (514)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,735     | 05/08/2030      |     | 92 200            | 28                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,736     | 12/08/2030      |     | 1 149 700         | 335                               | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,745     | 12/01/2031      |     | 402 450           | (268)                             | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,761     | 20/10/2030      |     | 454 400           | 128                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,765     | 09/01/2029      |     | 425 000           | (257)                             | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,767     | 17/10/2030      |     | 439 500           | 131                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,773     | 10/04/2031      |     | 720 300           | 479                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,777     | 15/10/2030      |     | 173 950           | 55                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,790     | 31/10/2030      |     | 255 600           | 54                                | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,840     | 12/02/2031      |     | 200 000           | (104)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,845     | 05/03/2031      |     | 276 800           | 128                               | 0,00                |



| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |        |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|--------|
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,850 %   | 03/03/2036      | CZK               | 146 600                           | \$ (186)            | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,920     | 09/02/2031      |                   | 202 700                           | 58                  | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,930     | 22/05/2036      |                   | 328 700                           | 41                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,950     | 10/04/2031      |                   | 1 359 200                         | (225)               | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,963     | 27/11/2030      |                   | 250 100                           | 172                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,970     | 12/02/2031      |                   | 255 200                           | 48                  | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,980     | 04/12/2030      |                   | 272 000                           | 258                 | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,981     | 01/12/2030      |                   | 294 400                           | 217                 | 0,00   |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,999     | 14/11/2030      |                   | 238 600                           | (186)               | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,000     | 17/06/2036      |                   | 2 165 500                         | 2 455               | 0,04   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,018     | 25/11/2030      |                   | 294 900                           | 240                 | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,049     | 12/12/2030      |                   | 42 750                            | 6                   | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,070     | 23/11/2028      |                   | 255 900                           | 25                  | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,071     | 22/04/2031      |                   | 230 800                           | (5)                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,085     | 12/02/2031      |                   | 60 000                            | (4)                 | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,090     | 29/06/2031      |                   | 959 000                           | (57)                | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,100     | 30/06/2031      |                   | 537 300                           | (20)                | 0,00   |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,130     | 03/06/2029      |                   | 335 900                           | (33)                | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,130     | 20/07/2031      |                   | 3 583 900                         | (2 368)             | (0,04) |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,130     | 01/10/2035      |                   | 495 800                           | 580                 | 0,01   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 18/04/2029      |                   | 396 300                           | (383)               | (0,01) |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 27/04/2031      |                   | 1 007 300                         | (356)               | (0,01) |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,335     | 16/06/2031      |                   | 475 400                           | 234                 | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,335     | 01/07/2036      |                   | 92 540                            | (2)                 | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,364     | 25/06/2036      |                   | 396 850                           | 13                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,375     | 01/07/2036      |                   | 92 540                            | 5                   | 0,00   |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,388     | 15/11/2028      |                   | 1 295 400                         | 15                  | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,395     | 10/03/2036      |                   | 211 900                           | (175)               | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,485     | 02/12/2035      |                   | 278 200                           | 88                  | 0,00   |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,505     | 16/03/2036      |                   | 230 700                           | (285)               | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,510     | 17/06/2036      |                   | 63 200                            | 18                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,523     | 01/12/2035      |                   | 1 524 460                         | 584                 | 0,01   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,530     | 31/12/2035      |                   | 600 900                           | 124                 | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,560     | 23/11/2027      |                   | 155 900                           | 31                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,668     | 16/06/2036      |                   | 200 300                           | 112                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,700     | 23/03/2036      |                   | 79 100                            | (51)                | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,720     | 02/04/2036      |                   | 165 400                           | (112)               | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | €                 | 3 500                             | (5)                 | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      |                   | 6 300                             | 47                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      |                   | 6 200                             | 131                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      |                   | 19 480                            | 49                  | 0,00   |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,100     | 20/09/2030      |                   | 18 000                            | 93                  | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 1,760     | 21/01/2030      | HUF               | 1 296 900                         | 650                 | 0,01   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 2,420     | 02/08/2026      |                   | 3 964 700                         | (101)               | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 2,680     | 29/06/2031      |                   | 1 938 800                         | (215)               | 0,00   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,670     | 24/10/2035      |                   | 3 505 800                         | 48                  | 0,00   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,675     | 24/10/2035      |                   | 2 334 500                         | 27                  | 0,00   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,685     | 24/10/2035      |                   | 3 930 300                         | 39                  | 0,00   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,690     | 24/11/2032      |                   | 2 680 800                         | 27                  | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 4,790     | 17/01/2027      |                   | 5 742 020                         | 63                  | 0,00   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 5,440     | 15/01/2029      |                   | 2 611 700                         | (33)                | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,610     | 23/04/2032      |                   | 1 003 200                         | 126                 | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,690     | 24/04/2032      |                   | 2 013 410                         | 280                 | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,735     | 22/04/2032      |                   | 6 066 500                         | 885                 | 0,01   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,750     | 17/06/2031      |                   | 10 700 100                        | 1 090               | 0,02   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,845     | 27/04/2032      |                   | 3 486 000                         | 574                 | 0,01   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,850     | 06/05/2030      |                   | 637 500                           | 63                  | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,890     | 09/05/2030      |                   | 24 791 300                        | 2 784               | 0,04   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,990     | 21/04/2032      |                   | 5 162 800                         | 968                 | 0,02   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,040     | 12/02/2034      |                   | 163 400                           | (42)                | 0,00   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,070     | 15/04/2036      |                   | 12 055 800                        | 2 299               | 0,04   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,079     | 22/10/2029      |                   | 7 213 600                         | 1 842               | 0,03   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,080     | 12/02/2034      |                   | 2 607 500                         | 868                 | 0,01   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,090     | 21/10/2029      |                   | 26 235 400                        | 6 490               | 0,10   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,100     | 08/02/2034      |                   | 2 716 000                         | (728)               | (0,01) |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,110     | 30/12/2030      |                   | 12 052 250                        | 2 861               | 0,04   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,190     | 18/11/2030      |                   | 13 432 682                        | (3 953)             | (0,06) |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,210     | 26/06/2030      |                   | 29 002 700                        | (4 405)             | (0,07) |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,250     | 09/04/2030      |                   | 7 830 700                         | (1 106)             | (0,02) |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,265     | 08/04/2030      |                   | 6 467 400                         | (899)               | (0,01) |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,265     | 28/04/2032      |                   | 6 409 000                         | (1 500)             | (0,02) |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,270     | 16/06/2030      |                   | 8 974 000                         | 1 387               | 0,02   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,350     | 14/11/2030      |                   | 1 893 500                         | (532)               | (0,01) |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,363     | 31/01/2030      |                   | 9 453 400                         | 1 387               | 0,02   |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,392     | 11/03/2030      |                   | 8 878 000                         | 1 333               | 0,02   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,400     | 21/11/2030      |                   | 3 433 500                         | (1 002)             | (0,01) |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,430     | 04/02/2030      |                   | 6 173 700                         | 959                 | 0,02   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,430     | 21/11/2030      |                   | 16 924 600                        | (5 012)             | (0,08) |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,450     | 06/06/2029      |                   | 3 099 500                         | (380)               | (0,01) |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,511     | 05/02/2030      |                   | 16 980 100                        | 2 672               | 0,04   |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,580     | 16/05/2035      |                   | 1 988 000                         | (831)               | (0,01) |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,650     | 13/03/2030      |                   | 3 144 500                         | 585                 | 0,01   |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir |                    | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|--------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois   | 7,330 %   | 06/11/2028      | HUF               | 4 993 600 \$                      | 616 0,01            |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois   | 7,840     | 07/02/2033      |                   | 15 225 500 (4 744)                | (0,07)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois   | 8,740     | 28/04/2028      |                   | 58 061 820 (2 750)                | (0,04)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois   | 9,230     | 26/08/2032      |                   | 1 440 400 1 338                   | 0,02                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 0,925     | 16/10/2030      | PLN               | 23 400                            | 185 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 2,585     | 14/10/2029      |                   | 15 200                            | 38 0,00             |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 2,920     | 13/12/2031      |                   | 3 800                             | 38 0,00             |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 3,710     | 25/07/2030      |                   | 91 100                            | 189 0,00            |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 3,750     | 17/06/2031      |                   | 229 000                           | 1 462 0,02          |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 3,952     | 29/07/2030      |                   | 45 300                            | 337 0,01            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 3,962     | 06/05/2030      |                   | 69 100                            | (37) 0,00           |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,015     | 17/04/2030      |                   | 50 500                            | (55) 0,00           |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,019     | 18/04/2030      |                   | 49 900                            | (56) 0,00           |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,048     | 18/04/2030      |                   | 25 100                            | (35) 0,00           |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,049     | 18/04/2030      |                   | 3 900                             | 3 0,00              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,065     | 18/04/2030      |                   | 24 900                            | (39) 0,00           |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,065     | 24/11/2030      |                   | 642 830 (2 394)                   | (0,04)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,075     | 07/03/2027      |                   | 37 000                            | (25) 0,00           |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,091     | 23/02/2036      |                   | 45 600                            | (124) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,125     | 20/05/2036      |                   | 28 180                            | 79 0,00             |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,135     | 20/05/2036      |                   | 24 900                            | (6) 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,136     | 25/07/2029      |                   | 301 700                           | (1 846) (0,03)      |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,161     | 03/03/2036      |                   | 96 900                            | 185 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,180     | 15/05/2029      |                   | 205 200                           | (467) (0,01)        |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,180     | 22/05/2036      |                   | 214 300 (1 284)                   | (0,02)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,195     | 29/09/2030      |                   | 28 800                            | (245) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,200     | 13/05/2036      |                   | 27 950                            | 29 0,00             |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,207     | 30/01/2036      |                   | 6 100                             | (99) 0,00           |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,223     | 04/02/2036      |                   | 55 300                            | 11 0,00             |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,230     | 15/04/2036      |                   | 31 800                            | 73 0,00             |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,235     | 27/11/2035      |                   | 12 000                            | 70 0,00             |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,259     | 08/08/2029      |                   | 36 900                            | (339) (0,01)        |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,275     | 02/03/2036      |                   | 39 700                            | 54 0,00             |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,285     | 19/12/2035      |                   | 44 100                            | 301 0,01            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,313     | 25/07/2029      |                   | 19 100                            | (185) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,320     | 25/07/2029      |                   | 14 400                            | (140) 0,00          |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,325     | 20/05/2036      |                   | 61 400                            | 158 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,328     | 25/07/2029      |                   | 19 300                            | (190) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,340     | 12/12/2035      |                   | 3 300                             | (27) 0,00           |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,348     | 05/03/2036      |                   | 51 900                            | (148) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,349     | 06/03/2036      |                   | 32 400                            | (92) 0,00           |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,353     | 23/10/2035      |                   | 10 400                            | 91 0,00             |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,356     | 17/10/2035      |                   | 24 820                            | 220 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,360     | 25/07/2028      |                   | 76 900                            | (697) (0,01)        |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,370     | 25/11/2035      |                   | 29 200                            | 257 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,370     | 05/03/2036      |                   | 33 100                            | (110) 0,00          |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,380     | 22/05/2036      |                   | 62 600                            | 173 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,385     | 06/02/2036      |                   | 25 300                            | (22) 0,00           |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,388     | 09/08/2029      |                   | 12 400                            | (129) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,393     | 16/10/2035      |                   | 30 120                            | (284) 0,00          |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,400     | 13/05/2036      |                   | 60 100                            | 265 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,415     | 12/08/2029      |                   | 65 700                            | (705) (0,01)        |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,430     | 10/11/2035      |                   | 34 000                            | (351) (0,01)        |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,434     | 03/11/2035      |                   | 5 200                             | (54) 0,00           |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,440     | 19/09/2035      |                   | 81 100                            | 969 0,02            |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,445     | 22/12/2035      |                   | 15 000                            | 65 0,00             |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,450     | 24/02/2036      |                   | 24 600                            | (59) 0,00           |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,463     | 09/03/2036      |                   | 24 600                            | (131) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,475     | 26/11/2035      |                   | 52 950                            | (385) (0,01)        |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,480     | 13/04/2036      |                   | 63 400                            | 332 0,01            |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,495     | 22/11/2029      |                   | 31 500                            | 479 0,01            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,510     | 25/04/2029      |                   | 116 000                           | (551) (0,01)        |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,520     | 20/04/2036      |                   | 75 000                            | (646) (0,01)        |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,545     | 25/04/2029      |                   | 60 800                            | (305) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,560     | 06/11/2028      |                   | 262 600                           | (2 676) (0,04)      |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,560     | 02/09/2029      |                   | 125 700                           | 1 460 0,02          |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,574     | 10/03/2036      |                   | 29 900                            | (232) 0,00          |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,625     | 01/07/2036      |                   | 17 850                            | 1 0,00              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,650     | 28/04/2036      |                   | 340 400                           | (3 020) (0,05)      |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,660     | 19/02/2029      |                   | 43 700                            | 267 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,665     | 27/04/2036      |                   | 36 700                            | (336) (0,01)        |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,665     | 01/07/2036      |                   | 17 850                            | (6) 0,00            |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,680     | 03/11/2028      |                   | 14 200                            | (185) 0,00          |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,680     | 25/04/2029      |                   | 35 500                            | 214 0,00            |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,685     | 02/12/2035      |                   | 49 400                            | (73) 0,00           |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,685     | 10/03/2036      |                   | 18 300                            | (186) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,685     | 29/04/2036      |                   | 45 900                            | (439) (0,01)        |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,695     | 28/03/2030      |                   | 22 400                            | 3 0,00              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,710     | 25/05/2027      |                   | 73 900                            | (145) 0,00          |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois | 4,710     | 29/04/2036      |                   | 32 400                            | (327) (0,01)        |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois | 4,723     | 01/12/2035      |                   | 254 370                           | (469) (0,01)        |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois | 4,730     | 16/02/2029      |                   | 41 100                            | 271 0,00            |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |        |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|--------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,730 %   | 31/12/2035      | PLN               | 35 800                            | \$(64)              | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,735     | 09/10/2028      |                   | 62 400                            | (731)               | (0,01) |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,740     | 25/10/2033      |                   | 46 000                            | (804)               | (0,01) |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,750     | 02/08/2029      |                   | 38 000                            | 532                 | 0,01   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,760     | 25/10/2033      |                   | 14 700                            | 262                 | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,789     | 28/05/2036      |                   | 187 800                           | (1 962)             | (0,03) |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,800     | 17/06/2036      |                   | 17 220                            | (29)                | 0,00   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,810     | 16/02/2029      |                   | 49 600                            | 357                 | 0,01   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,820     | 25/07/2029      |                   | 80 200                            | (1 185)             | (0,02) |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,828     | 17/03/2036      |                   | 15 500                            | (170)               | 0,00   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,845     | 02/04/2036      |                   | 64 800                            | 859                 | 0,01   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,850     | 25/10/2033      |                   | 33 300                            | 649                 | 0,01   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,855     | 10/02/2030      |                   | 225 000                           | 1 895               | 0,03   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,860     | 11/03/2036      |                   | 27 700                            | (385)               | (0,01) |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,865     | 18/07/2029      |                   | 47 600                            | 725                 | 0,01   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,910     | 25/07/2027      |                   | 29 920                            | (317)               | 0,00   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,923     | 22/03/2029      |                   | 167 900                           | 1 411               | 0,02   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,930     | 25/07/2029      |                   | 58 600                            | (931)               | (0,01) |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,960     | 16/06/2036      |                   | 36 040                            | (116)               | 0,00   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,970     | 21/03/2029      |                   | 96 300                            | 776                 | 0,01   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,970     | 25/10/2033      |                   | 8 000                             | 174                 | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,000     | 25/04/2029      |                   | 83 600                            | (702)               | (0,01) |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,010     | 25/07/2029      |                   | 79 300                            | (1 323)             | (0,02) |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,020     | 21/03/2029      |                   | 26 100                            | 225                 | 0,00   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,055     | 25/10/2033      |                   | 48 300                            | 1 124               | 0,02   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,060     | 25/04/2032      |                   | 112 790                           | (114)               | 0,00   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,105     | 12/07/2029      |                   | 78 700                            | 1 379               | 0,02   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,155     | 25/10/2034      |                   | 76 900                            | 1 722               | 0,03   |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,158     | 22/03/2027      |                   | 339 900                           | 1 371               | 0,02   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,200     | 23/03/2036      |                   | 14 900                            | 89                  | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,220     | 20/03/2033      |                   | 4 100                             | (78)                | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,230     | 02/04/2036      |                   | 25 200                            | 157                 | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,310     | 21/03/2033      |                   | 40 800                            | (667)               | (0,01) |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,430     | 16/03/2028      |                   | 1 752 600                         | 4 137               | 0,06   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,870     | 22/04/2027      |                   | 1 000                             | (5)                 | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,960     | 25/04/2027      |                   | 67 900                            | (359)               | (0,01) |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,456     | 25/05/2027      |                   | 20 800                            | (134)               | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,480     | 25/05/2027      |                   | 45 100                            | (294)               | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,560     | 25/05/2027      |                   | 15 800                            | (106)               | 0,00   |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 7,310     | 30/06/2027      |                   | 15 300                            | (133)               | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 6,880     | 02/03/2028      | MXN               | 966 000                           | (118)               | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 6,882     | 02/03/2028      |                   | 1 370 800                         | (165)               | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      |                   | 6 862 900                         | 864                 | 0,01   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,230     | 14/03/2029      |                   | 640 800                           | 66                  | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,350     | 31/01/2031      |                   | 243 300                           | (72)                | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,415     | 18/11/2030      |                   | 363 300                           | 176                 | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,430     | 02/03/2028      |                   | 118 700                           | (46)                | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,450     | 13/09/2028      |                   | 1 247 600                         | (399)               | (0,01) |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,460     | 27/08/2030      |                   | 309 100                           | (68)                | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,480     | 11/06/2031      |                   | 357 600                           | 166                 | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,495     | 04/02/2031      |                   | 228 300                           | (64)                | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,500     | 11/09/2030      |                   | 460 200                           | (79)                | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,520     | 16/04/2031      |                   | 793 500                           | 249                 | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,545     | 12/03/2031      |                   | 206 900                           | 44                  | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 02/03/2028      |                   | 1 329 100                         | (660)               | (0,01) |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 29/01/2031      |                   | 255 100                           | (48)                | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 30/01/2031      |                   | 298 400                           | (57)                | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 02/05/2031      |                   | 228 300                           | 54                  | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,555     | 31/05/2029      |                   | 479 200                           | 120                 | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,555     | 24/01/2031      |                   | 182 100                           | (30)                | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,560     | 02/03/2028      |                   | 388 000                           | (196)               | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,580     | 02/03/2028      |                   | 63 100                            | (33)                | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,582     | 02/04/2030      |                   | 544 400                           | 90                  | 0,00   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,600     | 04/04/2031      |                   | 255 200                           | 66                  | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,610     | 20/09/2030      |                   | 566 500                           | 115                 | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,620     | 18/04/2031      |                   | 255 100                           | 22                  | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,645     | 24/04/2031      |                   | 298 700                           | 12                  | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,650     | 18/04/2031      |                   | 612 600                           | (9)                 | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,660     | 18/04/2031      |                   | 542 500                           | (5)                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIIE MXN à 28 jours     | 7,680     | 05/03/2031      |                   | 420 000                           | (50)                | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,680     | 07/04/2031      |                   | 480 100                           | 41                  | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIIE MXN à 28 jours     | 7,681     | 05/03/2031      |                   | 1 214 600                         | (149)               | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,700     | 24/12/2030      |                   | 240 800                           | 46                  | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,710     | 12/03/2031      |                   | 135 000                           | (23)                | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,720     | 01/04/2030      |                   | 250 300                           | 109                 | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,735     | 11/09/2030      |                   | 733 800                           | (272)               | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,740     | 20/09/2030      |                   | 232 200                           | 84                  | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,748     | 02/04/2030      |                   | 116 800                           | 57                  | 0,00   |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 13/06/2029      |                   | 1 021 100                         | (599)               | (0,01) |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 01/04/2030      |                   | 382 100                           | 172                 | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 12/03/2031      |                   | 425 900                           | (59)                | 0,00   |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 11/06/2031      |                   | 818 800                           | 152                 | 0,00   |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,753 %   | 16/04/2030      | MXN 701 400       | \$ 322                            | 0,01                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,763     | 11/06/2031      | 90 300            | (20)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,768     | 12/06/2030      | 481 100           | (218)                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,771     | 12/03/2031      | 485 200           | (151)                             | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,775     | 01/04/2030      | 349 800           | 189                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,775     | 12/06/2030      | 390 300           | (183)                             | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,775     | 13/12/2030      | 558 700           | 75                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,790     | 31/05/2029      | 435 000           | 304                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,790     | 01/04/2030      | 149 900           | 86                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,800     | 12/06/2030      | 292 800           | (152)                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,800     | 15/04/2032      | 512 925           | (41)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,820     | 31/05/2029      | 451 000           | 336                               | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours     | 7,820     | 02/05/2031      | 473 500           | 275                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,825     | 31/05/2029      | 428 900           | 323                               | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,936     | 12/06/2030      | 26 300            | (16)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      | 73 900            | 99                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,071     | 05/09/2035      | 484 000           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,075     | 17/03/2027      | 788 800           | 491                               | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,150     | 04/06/2036      | 13 400            | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,200     | 11/06/2031      | 578 600           | (727)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,215     | 04/06/2036      | 1 869 000         | (726)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,240     | 11/06/2031      | 561 400           | 766                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,250     | 01/03/2029      | 247 100           | (145)                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,267     | 28/02/2030      | 1 393 400         | (1 988)                           | (0,03)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,270     | 07/03/2035      | 76 100            | 66                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,285     | 06/06/2035      | 232 600           | (203)                             | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,290     | 27/02/2032      | 126 700           | 178                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,295     | 11/06/2031      | 180 700           | 271                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,330     | 01/03/2029      | 21 800            | (32)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,340     | 11/06/2031      | 256 200           | 411                               | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,365     | 28/03/2035      | 81 700            | 102                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,485     | 31/05/2029      | 411 100           | (269)                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,495     | 31/05/2029      | 5 600             | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 31/05/2029      | 1 130 000         | (2 044)                           | (0,03)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 04/06/2036      | 103 800           | 155                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,515     | 22/02/2035      | 194 100           | (338)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,545     | 23/11/2034      | 113 600           | 216                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,550     | 22/02/2035      | 129 900           | (243)                             | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,620     | 05/12/2029      | 578 600           | 1 184                             | 0,02                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,640     | 07/03/2035      | 155 600           | (349)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,650     | 31/01/2030      | 246 600           | 524                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,655     | 07/03/2035      | 193 100           | (443)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,665     | 11/12/2029      | 399 600           | (880)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,740     | 07/03/2035      | 18 900            | (49)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,800     | 12/12/2029      | 769 700           | 1 475                             | 0,02                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,820     | 23/11/2034      | 271 100           | (782)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,855     | 09/02/2035      | 598 400           | (1 808)                           | (0,03)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,065     | 01/03/2029      | 73 600            | 183                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,150     | 31/12/2029      | 56 000            | 169                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 9,180     | 08/01/2030      | 72 300            | (229)                             | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,295     | 30/10/2028      | 83 600            | 153                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,295     | 28/12/2034      | 223 100           | 1 015                             | 0,02                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,295     | 29/12/2034      | 441 900           | 2 009                             | 0,03                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,370     | 21/12/2034      | 278 500           | 1 351                             | 0,02                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (63 120)                       | (0,96)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (63 120)                       | (0,96)              |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - EUR contre BRL hors cote | BRL 5,850       | 19/08/2026        | 56 716                           | \$ 833   | \$ 287       | 0,00                |
|              | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 06/08/2026        | 2 100                            | 8        | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 69 214                           | 3 398    | 6 562        | 0,10                |
| BPS          | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 101 085                          | 397      | 166          | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 101 085                          | 218      | 353          | 0,01                |
| MYI          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 06/08/2026        | 22 602                           | 88       | 4            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 4 942 | \$ 7 372     | 0,11                |

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | KLIBOR MYR à 3 mois     | À recevoir                       | 3,600 %         | 17/03/2027        | 420 000                          | \$ 874   | \$ 682       | 0,01                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | JIBAR ZAR à 3 mois      | À payer                          | 7,750           | 20/11/2026        | 2 108 200                        | 461      | 604          | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | PRIBOR CZK à 6 mois     | À payer                          | 4,550           | 19/11/2026        | 3 235 700                        | 494      | 791          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | WIBOR PLN à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 09/12/2026        | 260 300                          | 206      | 501          | 0,01                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | JIBAR ZAR à 3 mois      | À payer                          | 7,750           | 19/11/2026        | 1 323 800                        | 264      | 377          | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 5,250           | 20/01/2028        | 145 500                          | 3 161    | 1 953        | 0,03                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 5 460 | \$ 4 908     | 0,08                |

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre BRL hors cote  | BRL 6,250       | 19/08/2026        | 56 716                           | \$ (877)   | \$ (334)     | (0,01)              |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 38 462                           | (506)      | (105)        | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 14 414                           | (185)      | (51)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre TRY hors cote  | TRY 53,100      | 07/08/2026        | 26 397                           | (456)      | (91)         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 138 429                          | (3 436)    | (5 480)      | (0,08)              |
| BPS          | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 101 085                          | (527)      | (1 014)      | (0,02)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 3 245                            | (42)       | (10)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 28 662                           | (454)      | (246)        | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (6 483) | \$ (7 331)   | (0,11)              |

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,500 %         | 23/07/2026        | 101 200                          | \$ (25)    | \$ (17)      | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,800           | 28/07/2026        | 123 100                          | (48)       | (86)         | 0,00                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,250           | 20/11/2026        | 4 216 400                        | (333)      | (510)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | PRIBOR CZK à 6 mois     | À recevoir                       | 3,930           | 16/07/2026        | 603 500                          | (161)      | (35)         | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | PRIBOR CZK à 6 mois     | À recevoir                       | 4,050           | 19/11/2026        | 6 470 300                        | (308)      | (644)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | WIBOR PLN à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 09/12/2026        | 520 600                          | (131)      | (513)        | (0,01)              |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,250           | 19/11/2026        | 2 646 900                        | (189)      | (317)        | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (1 195) | \$ (2 122)   | (0,03)              |

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000) %           | 20/12/2028      | \$ 6 400                         | \$ (126)               | \$ 8                             | \$ (118)     | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000)             | 20/12/2029      | 1 200                            | (23)                   | (5)                              | (28)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/12/2033      | 27 300                           | (67)                   | (284)                            | (351)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/06/2034      | 14 400                           | (126)                  | (40)                             | (166)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/12/2034      | 6 750                            | (24)                   | (45)                             | (69)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/12/2035      | 600                              | 0                      | (5)                              | (5)          | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/12/2035      | 2 900                            | 7                      | (30)                             | (23)         | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000)             | 20/12/2029      | 2 700                            | (52)                   | (10)                             | (62)         | 0,00                |
|              |                                                    |                     |                 |                                  | \$ (411)               | \$ (411)                         | \$ (822)     | (0,01)              |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000 %              | 20/12/2026      | \$ 1 700                         | \$ 29                  | \$ 7                             | \$ 36        | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 1 700                            | 28                     | 8                                | 36           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain   | 1,000                | 20/12/2027      | 6 800                            | 14                     | 49                               | 63           | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 2 222                            | 13                     | 34                               | 47           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 4 610                            | 55                     | 108                              | 163          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérien   | 1,000                | 20/06/2027      | 1 800                            | (20)                   | 15                               | (5)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien   | 1,000                | 20/06/2030      | 72 700                           | 1 025                  | 343                              | 1 368        | 0,02                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien   | 1,000                | 20/12/2030      | 1 000                            | 16                     | 3                                | 19           | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 2 877                            | 23                     | 37                               | 60           | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                  | 1,000                | 20/12/2026      | 2 900                            | (28)                   | 30                               | 2            | 0,00                |
| DUB          | Eskom                                                | 4,650                | 30/06/2029      | 10 267                           | 0                      | 526                              | 526          | 0,01                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 8 262                            | 43                     | 131                              | 174          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 4 145                            | (449)                  | 596                              | 147          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien   | 1,000                | 20/12/2030      | 4 800                            | 73                     | 16                               | 89           | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 2 700                            | 37                     | 58                               | 95           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien | 5,000                | 20/06/2027      | 17 750                           | 586                    | 85                               | 671          | 0,01                |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Entité de référence                                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin | 5,000 %              | 20/06/2027      | \$ 32 050                        | \$ 308                 | \$ 825                           | \$ 1 133     | 0,02                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian | 1,000                | 20/12/2030      | 3 200                            | (286)                  | 101                              | (185)        | 0,00                |
|              | SoftBank Group Corp.                               | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 2 746 100                      | (285)                  | 174                              | (111)        | 0,00                |
|              |                                                    |                      |                 |                                  | \$ 1 182               | \$ 3 146                         | \$ 4 328     | 0,07                |

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

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

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

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,140 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2033      | \$ 69 819                            | CNH 470 577                           | \$ 448                 | \$ (198)                         | \$ 250       | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,150 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2036      | 23 055                               | 155 275                               | 132                    | (182)                            | (50)         | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,150 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2038      | 38 222                               | 257 426                               | 218                    | (196)                            | 22           | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,598 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | IDR 1 435 110 870                    | \$ 84 072                             | 1 402                  | (2 733)                          | (1 331)      | (0,02)              |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,606 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 243 770 130                          | 14 306                                | 208                    | (421)                            | (213)        | 0,00                |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         |                 |                                      |                                       |                        |                                  |              |                     |
| BPS          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,594 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 505 426 950                          | 29 550                                | 428                    | (1 010)                          | (582)        | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,683 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | \$ 21 182                            | IDR 387 231 110                       | (427)                  | (1)                              | (428)        | (0,01)              |
| CBK          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,562 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 15/09/2028      | IDR 1 515 890 960                    | \$ 89 496                             | 3 247                  | (767)                            | 2 480        | 0,04                |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,689 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 928 669 720                          | 51 693                                | 538                    | 162                              | 700          | 0,02                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,690 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | \$ 52 569                            | IDR 958 603 640                       | (1 346)                | (147)                            | (1 493)      | (0,02)              |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         |                 |                                      |                                       |                        |                                  |              |                     |



| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GLM          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,596 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | IDR 585 852 290                      | \$ 34 399                             | \$ 536                 | \$ (1 112)                        | \$ (576)     | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,692 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2031      | \$ 62 461                            | IDR 1 131 659 980                     | (973)                  | (234)                             | (1 207)      | (0,02)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,700 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 25 884                               | 467 103 710                           | (95)                   | (201)                             | (296)        | (0,01)              |
| GST          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,135 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2036      | 37 460                               | CNH 252 790                           | 408                    | 249                               | 657          | 0,01                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,585 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR PHP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 32 321                               | PHP 2 001 670                         | (121)                  | (645)                             | (766)        | (0,01)              |
| JPM          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,604 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | IDR 545 218 870                      | \$ 31 978                             | 485                    | (973)                             | (488)        | (0,01)              |
| SCX          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,605 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 623 961 680                          | 36 639                                | 513                    | (1 092)                           | (579)        | (0,01)              |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         |                 |                                      |                                       | \$ 5 601               | \$ (9 501)                        | \$ (3 900)   | (0,06)              |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable      | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À recevoir                        | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 5,050 %   | 18/03/2031      | CLP 10 300 000    | \$ 0                   | \$ (184)                          | \$ (184)     | 0,00                |
| BSH          | À recevoir                        | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 3,300     | 21/06/2029      | 3 450 000         | 0                      | 131                               | 131          | 0,00                |
| CBK          | À recevoir                        | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 5,960     | 10/05/2029      | COP 27 236 900    | 0                      | 954                               | 954          | 0,01                |
|              | À payer                           | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 3,763     | 24/05/2029      | CLP 1 841 700     | 10                     | (54)                              | (44)         | 0,00                |
| GLM          | À payer                           | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 3,265     | 14/06/2029      | 4 122 200         | 0                      | (162)                             | (162)        | 0,00                |
|              | À payer                           | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 3,830     | 22/05/2029      | 7 729 900         | 0                      | (170)                             | (170)        | 0,00                |
|              | À payer                           | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,095     | 01/06/2027      | 12 230 000        | 0                      | (50)                              | (50)         | 0,00                |
|              | À payer                           | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,319     | 22/05/2029      | 19 808 000        | 0                      | (131)                             | (131)        | 0,00                |
| JPM          | À recevoir                        | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 3,540     | 04/06/2029      | 4 115 000         | 0                      | 127                               | 127          | 0,00                |
| MYC          | À payer                           | CDI BRL à un an              | 7,813     | 04/01/2027      | BRL 12 200        | 17                     | (358)                             | (341)        | (0,01)              |
|              |                                   |                              |           |                 |                   | \$ 27                  | \$ 103                            | \$ 130       | 0,00                |

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MBC          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 6,680 %       | INR 1 356 800     | 05/11/2026      | \$ 0                   | \$ 731                            | \$ 731       | 0,01                |
|              | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 7,240         | 1 195 860         | 23/09/2026      | 0                      | 128                               | 128          | 0,00                |
| SCX          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 6,680         | 7 276 980         | 30/10/2026      | 0                      | 3 084                             | 3 084        | 0,05                |
|              |                    |                                                        |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ 3 943                          | \$ 3 943     | 0,06                |



# Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | \$                | 29                 | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             |                   | 412                | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 519                | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | CAD               | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | NZD               | 626                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | \$                | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             |                   | 354                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | AUD               | 42                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | \$                | 4 860              | 26                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             |                   | 89 332             | 54                    | (277)                                   | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | DOP             |                   | 2 561              | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               |                   | 11 653             | 206                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               |                   | 2 137              | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             |                   | 5 213              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 81                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             |                   | 1 854              | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             |                   | 22 666             | 99                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 37 519             | 299                   | (407)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | PHP             |                   | 16 052             | 0                     | (122)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             |                   | 1 833              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CNH               | 136 753            | 0                     | (77)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | COP               | 39 856 901         | 0                     | (59)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | £                 | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ILS               | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | MYR               | 154 912            | 201                   | (89)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | NOK               | 66 396             | 0                     | (462)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | PEN               | 29 678             | 86                    | (45)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 684 000            | 85                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK             | €                 | 482                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP             | \$                | 15 819             | 148                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             |                   | 26                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 342 766            | 247                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | ILS               | 207                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | ZAR               | 147 921            | 808                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | ZAR             | \$                | 7 304              | 0                     | (563)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | COP             |                   | 17 777             | 14                    | (1 773)                                 | (0,03)              |
|              | 09/2026           | KZT             |                   | 1 838              | 0                     | (47)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 18 858             | 51                    | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             |                   | 28 498             | 248                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             |                   | 59 463             | 0                     | (110)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 1 700              | 29                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | BRL               | 764 637            | 0                     | (2 202)                                 | (0,03)              |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 192 692 197        | 73                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | MXN               | 48 342             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | \$                | 11 566             | 51                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | HUF             | €                 | 2 594              | 0                     | (80)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | BRL               | 49 127             | 23                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | \$                | 46 789             | 0                     | (4 949)                                 | (0,07)              |
|              | 12/2026           | MYR             |                   | 13 921             | 76                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 03/2030           | \$              | IDR               | 246 110 438        | 210                   | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | ARS             | \$                | 2 071              | 1                     | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | €                 | 34 484             | 0                     | (94)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | \$                | 22 129             | 253                   | (52)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             |                   | 23 169             | 72                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               |                   | 33 813             | 0                     | (250)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             |                   | 16 332             | 62                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 54 208             | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 34 350             | 289                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             |                   | 6 514              | 22                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PHP             |                   | 1 490              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             |                   | 21 654             | 216                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | ARS               | 5 575 685          | 350                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | BRL               | 449 098            | 0                     | (1 397)                                 | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | CNY               | 887                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | CZK               | 1 341 886          | 0                     | (1 258)                                 | (0,02)              |
|              | 07/2026           | £               |                   | 947                | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             |                   | 6 771 311          | 0                     | (48)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ILS               | 401                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 2 899 695          | 97                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | KRW               | 51 013 385         | 0                     | (501)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | KWD               | 1 014              | 0                     | (45)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 84 623             | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | BRL               | 160 945            | 0                     | (748)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | £                 | 31 813             | 173                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | \$                | 17 288             | 0                     | (849)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 12 157             | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             |                   | 9 169              | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 21 283             | 277                   | (16)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | COP               | 90 145 190         | 421                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 2 172 515 650      | 227                   | (1 859)                                 | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 13 251 251         | 684                   | (40)                                    | 0,01                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net    |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| BRC          | 09/2026           | \$              | PEN               | 200 407            | \$ 194                | \$ 0                                    | 194 0,00               |
|              | 09/2026           |                 | THB               | 603 114            | 0                     | (587)                                   | (587) (0,01)           |
|              | 10/2026           |                 | BRL               | 46 451             | 52                    | 0                                       | 52 0,00                |
|              | 12/2026           | MYR             | \$                | 21 815             | 164                   | 0                                       | 164 0,00               |
|              | 12/2026           | \$              | IDR               | 221 332 743        | 31                    | 0                                       | 31 0,00                |
|              | 06/2027           |                 | KWD               | 986                | 0                     | (42)                                    | (42) 0,00              |
|              | 05/2029           | KWD             | \$                | 48 857             | 2 508                 | 0                                       | 2 508 0,04             |
|              | 07/2029           |                 |                   | 5 859              | 302                   | 0                                       | 302 0,00               |
|              | 05/2030           |                 |                   | 34 422             | 1 764                 | 0                                       | 1 764 0,03             |
|              | 08/2030           |                 |                   | 2 085              | 215                   | 0                                       | 215 0,00               |
|              | 01/2031           |                 |                   | 12 555             | 1 246                 | 0                                       | 1 246 0,02             |
|              | 06/2031           |                 |                   | 7 403              | 673                   | 0                                       | 673 0,01               |
|              | 12/2040           | CNH             |                   | 136 484            | 0                     | (303)                                   | (303) 0,00             |
|              | 07/2026           | €               | RON               | 23 111             | 69                    | 0                                       | 69 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | \$                | 62 965             | 0                     | (216)                                   | (216) 0,00             |
|              | 07/2026           | NZD             |                   | 1 013              | 23                    | 0                                       | 23 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 61 272             | 126                   | (5)                                     | 121 0,00               |
|              | 07/2026           | TWD             |                   | 612                | 0                     | 0                                       | 0 0,00                 |
|              | 07/2026           | \$              | CNH               | 49 369             | 0                     | (157)                                   | (157) 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | CZK               | 7 782              | 0                     | (166)                                   | (166) 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | MYR               | 111 350            | 0                     | (1 095)                                 | (1 095) (0,02)         |
|              | 07/2026           |                 | TRY               | 91 427             | 4 377 841             | 1 320                                   | 1 320 0,02             |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 25 412             | 412 758               | 0                                       | (268) 0,00             |
|              | 08/2026           | COP             | \$                | 15 894 466         | 4 209                 | 0                                       | (366) (0,01)           |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 536 787            | 16 543                | 283                                     | 283 0,00               |
| BSH          | 09/2026           | \$              | IDR               | 131                | 2 385 891             | 2                                       | 2 0,00                 |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 80 260             | 7 726 260             | 825                                     | 825 0,01               |
|              | 09/2026           |                 | THB               | 13 734             | 443 746               | 0                                       | (293) 0,00             |
|              | 07/2026           | AUD             | \$                | 190                | 132                   | 0                                       | 0 0,00                 |
|              | 07/2026           | BRL             |                   | 304 367            | 59 071                | 267                                     | 267 0,00               |
|              | 07/2026           | €               |                   | 3 308              | 3 847                 | 65                                      | 65 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 232 025            | 1 459                 | 32                                      | 32 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 16 075             | 4 699                 | 35                                      | (49) 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | NZD               | 613                | 1 085                 | 4                                       | 4 0,00                 |
|              | 07/2026           |                 | PEN               | 15 746             | 54 346                | 189                                     | 189 0,00               |
|              | 08/2026           | NZD             | \$                | 1 085              | 614                   | 0                                       | (4) 0,00               |
|              | 08/2026           | \$              | AUD               | 132                | 190                   | 0                                       | 0 0,00                 |
|              | 09/2026           | CLP             | \$                | 13 974 780         | 15 870                | 703                                     | 703 0,01               |
|              | 09/2026           | PEN             |                   | 114 849            | 33 552                | 0                                       | (38) 0,00              |
|              | 10/2026           |                 |                   | 21 433             | 6 253                 | 0                                       | (8) 0,00               |
| CBK          | 12/2026           | CLP             |                   | 156 938 510        | 174 154               | 3 727                                   | 3 727 0,06             |
|              | 12/2026           | PEN             |                   | 73 377             | 21 369                | 63                                      | (78) 0,00              |
|              | 12/2026           | \$              | PEN               | 10 234             | 34 630                | 0                                       | (145) 0,00             |
|              | 01/2027           | PEN             | \$                | 23 612             | 6 951                 | 82                                      | 82 0,00                |
|              | 07/2026           | ARS             |                   | 8 916 677          | 5 651                 | 0                                       | (353) (0,01)           |
|              | 07/2026           | BRL             |                   | 42 305             | 8 155                 | 7                                       | (25) 0,00              |
|              | 07/2026           | COP             |                   | 108 370 514        | 29 340                | 0                                       | (1 962) (0,03)         |
|              | 07/2026           | EGP             |                   | 141 178            | 2 817                 | 0                                       | (49) 0,00              |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 471 950            | 138 740               | 1 467                                   | (1 031) 436 0,01       |
|              | 07/2026           | PHP             |                   | 731 305            | 11 817                | 0                                       | (95) 0,00              |
|              | 07/2026           | PYG             |                   | 35 694 819         | 5 622                 | 0                                       | (230) 0,00             |
|              | 07/2026           | SEK             |                   | 14 602             | 1 580                 | 72                                      | 72 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             |                   | 244 756            | 7 738                 | 60                                      | 60 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | ARS               | 3 986              | 6 446 610             | 359                                     | 0 359 0,01             |
|              | 07/2026           |                 | BRL               | 24 376             | 123 332               | 0                                       | (548) (548) (0,01)     |
|              | 07/2026           |                 | CNH               | 26 997             | 182 639               | 0                                       | (90) 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | COP               | 47 640             | 165 704 864           | 325                                     | (114) 211 0,00         |
|              | 07/2026           |                 | EGP               | 5 104              | 279 932               | 554                                     | 0 554 0,01             |
|              | 07/2026           |                 | HUF               | 74 087             | 22 778 498            | 46                                      | (996) (950) (0,01)     |
|              | 07/2026           |                 | IDR               | 9 910              | 178 548 470           | 34                                      | 0 34 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | ILS               | 154                | 447                   | 0                                       | (4) 0,00               |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 27 599             | 2 627 660             | 130                                     | 0 130 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | PEN               | 94 765             | 327 781               | 1 612                                   | (274) 1 338 0,02       |
|              | 07/2026           |                 | PHP               | 29 650             | 1 814 596             | 0                                       | (93) (93) 0,00         |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 38 859             | 142 000               | 0                                       | (1 083) (1 083) (0,02) |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 5 510              | 91 707                | 77                                      | 0 77 0,00              |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 994 055            | 60 372                | 0                                       | (182) (182) 0,00       |
|              | 07/2026           | ZMW             |                   | 24 600             | 1 163                 | 0                                       | (196) (196) 0,00       |
|              | 08/2026           | ILS             |                   | 24 922             | 8 836                 | 464                                     | 0 464 0,01             |
|              | 08/2026           | PEN             |                   | 155 249            | 45 705                | 262                                     | 0 262 0,00             |
|              | 08/2026           | \$              | ILS               | 141                | 415                   | 0                                       | (2) 0,00               |
|              | 09/2026           | COP             | \$                | 133 107 231        | 34 667                | 0                                       | (3 273) (3 273) (0,05) |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 2 133 099 508      | 118 359               | 182                                     | (63) 119 0,00          |
|              | 09/2026           | INR             |                   | 319 663            | 3 326                 | 0                                       | (29) 0,00              |
|              | 09/2026           | KZT             |                   | 1 931 000          | 3 826                 | 0                                       | (110) (110) 0,00       |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 191 709            | 10 718                | 0                                       | (184) (184) 0,00       |
|              | 09/2026           | PEN             |                   | 20 736             | 6 040                 | 0                                       | (25) 0,00              |
|              | 09/2026           | PHP             |                   | 1 823 527          | 29 733                | 107                                     | 0 107 0,00             |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 512 877            | 15 792                | 257                                     | 0 257 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | COP               | 59 131             | 215 820 649           | 2 384                                   | 0 2 384 0,04           |
|              | 09/2026           |                 | EGP               | 2 817              | 145 059               | 40                                      | 0 40 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 25 070             | 447 106 263           | 0                                       | (287) (287) 0,00       |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------|--------|
| DUB          | 09/2026           | \$              | 18 310            | INR                | 1 733 040             | \$ 0                                    | \$ (122)            | (122)   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 3 444             | MXN                | 59 692                | 0                                       | (50)                | (50)    | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 10 068            | PEN                | 34 813                | 110                                     | 0                   | 110     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 106             | RSD                | 112 103               | 0                                       | (15)                | (15)    | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 49 912            | THB                | 1 610 375             | 0                                       | (1 132)             | (1 132) | (0,02) |
|              | 10/2026           | COP             | 102 447 997       | \$                 | 28 974                | 98                                      | (53)                | 45      | 0,00   |
|              | 10/2026           | PEN             | 147 351           |                    | 43 314                | 303                                     | (29)                | 274     | 0,00   |
|              | 10/2026           | UGX             | 6 900 000         |                    | 1 875                 | 37                                      | 0                   | 37      | 0,00   |
|              | 10/2026           | \$              | 24 153            | PEN                | 83 633                | 274                                     | (5)                 | 269     | 0,00   |
|              | 10/2026           |                 | 1 959             | UGX                | 7 624 223             | 72                                      | 0                   | 72      | 0,00   |
|              | 10/2026           | UZS             | 10 624 100        | \$                 | 811                   | 0                                       | (61)                | (61)    | 0,00   |
|              | 11/2026           | COP             | 67 512 852        |                    | 18 666                | 0                                       | (292)               | (292)   | 0,00   |
|              | 11/2026           | NGN             | 1 084 568         |                    | 664                   | 0                                       | (81)                | (81)    | 0,00   |
|              | 11/2026           | PEN             | 38 776            |                    | 11 480                | 171                                     | 0                   | 171     | 0,00   |
|              | 12/2026           | COP             | 107 813 683       |                    | 27 881                | 0                                       | (2 191)             | (2 191) | (0,03) |
|              | 12/2026           | \$              | 56 358            | IDR                | 1 024 321 916         | 46                                      | 0                   | 46      | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 14 352            | PEN                | 50 168                | 267                                     | 0                   | 267     | 0,00   |
|              | 01/2027           | PEN             | 14 343            | \$                 | 4 239                 | 67                                      | 0                   | 67      | 0,00   |
|              | 03/2027           |                 | 97 940            |                    | 28 280                | 0                                       | (162)               | (162)   | 0,00   |
|              | 03/2028           | \$              | 39 332            | IDR                | 682 016 159           | 0                                       | (2 994)             | (2 994) | (0,05) |
|              | 07/2026           | CNH             | 39 683            | \$                 | 5 837                 | 3                                       | (12)                | (9)     | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 1 548 203         |                    | 16 395                | 54                                      | 0                   | 54      | 0,00   |
|              | 07/2026           | KZT             | 4 108 768         |                    | 8 665                 | 135                                     | 0                   | 135     | 0,00   |
|              | 07/2026           | MYR             | 104 892           |                    | 26 226                | 548                                     | 0                   | 548     | 0,01   |
|              | 07/2026           | NGN             | 1 362 200         |                    | 973                   | 0                                       | (9)                 | (9)     | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             | 22 552            |                    | 6 640                 | 28                                      | 0                   | 28      | 0,00   |
|              | 07/2026           | RON             | 215               |                    | 48                    | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 167 221           |                    | 5 094                 | 57                                      | 0                   | 57      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 9 030             | CNH                | 60 974                | 0                                       | (48)                | (48)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 69 645            | CZK                | 1 450 057             | 0                                       | (1 327)             | (1 327) | (0,02) |
|              | 07/2026           |                 | 140 038           | HUF                | 43 384 622            | 0                                       | (728)               | (728)   | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 23 277            | IDR                | 419 230 409           | 72                                      | 0                   | 72      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 861             | INR                | 468 878               | 85                                      | 0                   | 85      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 77 596            | MYR                | 314 934               | 0                                       | (499)               | (499)   | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 17 752            | NOK                | 164 942               | 0                                       | (1 084)             | (1 084) | (0,02) |
|              | 07/2026           |                 | 53 655            | PEN                | 183 043               | 0                                       | (32)                | (32)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 38 805            | PLN                | 143 985               | 0                                       | (501)               | (501)   | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 25 071            | RON                | 113 375               | 0                                       | (359)               | (359)   | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 11 759            | ZAR                | 190 355               | 0                                       | (163)               | (163)   | 0,00   |
|              | 08/2026           | KZT             | 4 502 097         | \$                 | 9 326                 | 38                                      | 0                   | 38      | 0,00   |
|              | 08/2026           | PEN             | 69 651            |                    | 20 651                | 257                                     | 0                   | 257     | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 12 701            | KZT                | 6 786 108             | 1 309                                   | 0                   | 1 309   | 0,02   |
|              | 09/2026           | IDR             | 259 298 448       | \$                 | 14 468                | 94                                      | 0                   | 94      | 0,00   |
|              | 09/2026           | INR             | 2 133 243         |                    | 22 378                | 27                                      | (37)                | (10)    | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 345 908           |                    | 100 546               | 18                                      | (574)               | (556)   | (0,01) |
|              | 09/2026           | \$              | 25 634            | IDR                | 465 478 895           | 169                                     | 0                   | 169     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 16 395            | INR                | 1 558 695             | 0                                       | (55)                | (55)    | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 3 709             | KZT                | 1 880 410             | 140                                     | 0                   | 140     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 6 974             | PEN                | 24 459                | 179                                     | 0                   | 179     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 21 576            | THB                | 702 882               | 0                                       | (285)               | (285)   | 0,00   |
|              | 10/2026           | UGX             | 17 269 500        | \$                 | 4 764                 | 150                                     | 0                   | 150     | 0,00   |
|              | 10/2026           | UZS             | 300 747 941       |                    | 23 599                | 0                                       | (1 084)             | (1 084) | (0,02) |
|              | 11/2026           | KZT             | 735 991           |                    | 1 487                 | 11                                      | 0                   | 11      | 0,00   |
|              | 11/2026           | NGN             | 77 760            |                    | 48                    | 0                                       | (5)                 | (5)     | 0,00   |
|              | 11/2026           | UZS             | 99 691 625        |                    | 7 629                 | 0                                       | (511)               | (511)   | (0,01) |
|              | 12/2026           | MYR             | 56 394            |                    | 13 921                | 73                                      | 0                   | 73      | 0,00   |
|              | 12/2026           | \$              | 1 398             | KZT                | 735 348               | 66                                      | 0                   | 66      | 0,00   |
|              | FAR               | 12/2026         | UZS               | 152 312 154        | \$                    | 11 727                                  | 0                   | (679)   | (679)  |
| 07/2026      |                   | AUD             | 88                |                    | 61                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
| 07/2026      |                   | CNH             | 206 642           |                    | 30 544                | 101                                     | 0                   | 101     | 0,00   |
| 07/2026      |                   | CZK             | 221               |                    | 11                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
| 07/2026      |                   | £               | 106 583           |                    | 143 208               | 1 746                                   | 0                   | 1 746   | 0,03   |
| 07/2026      |                   | ¥               | 5 382             |                    | 34                    | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
| 07/2026      |                   | PLN             | 101 920           |                    | 27 918                | 804                                     | 0                   | 804     | 0,01   |
| 07/2026      |                   | SGD             | 7 062             |                    | 5 535                 | 76                                      | 0                   | 76      | 0,00   |
| 07/2026      |                   | \$              | 33 751            | CNH                | 229 575               | 69                                      | 0                   | 69      | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 19 390            | €                  | 17 001                | 48                                      | 0                   | 48      | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 1 122             | HUF                | 346 680               | 0                                       | (9)                 | (9)     | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 40 571            | ¥                  | 6 564 408             | 0                                       | (181)               | (181)   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 228 548           | PLN                | 850 325               | 0                                       | (2 337)             | (2 337) | (0,04) |
| 07/2026      |                   |                 | 896               | SEK                | 8 691                 | 2                                       | 0                   | 2       | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 16 777            | ZAR                | 276 860               | 89                                      | 0                   | 89      | 0,00   |
| 07/2026      |                   | ZAR             | 28 458            | \$                 | 1 732                 | 0                                       | (5)                 | (5)     | 0,00   |
| 08/2026      |                   | CNH             | 229 071           |                    | 33 751                | 0                                       | (67)                | (67)    | 0,00   |
| 08/2026      |                   | COP             | 35 988 043        |                    | 9 534                 | 0                                       | (825)               | (825)   | (0,01) |
| 08/2026      |                   | €               | 17 001            |                    | 19 416                | 0                                       | (48)                | (48)    | 0,00   |
| 08/2026      |                   | ILS             | 27 357            |                    | 9 555                 | 366                                     | 0                   | 366     | 0,01   |
| 08/2026      |                   | ¥               | 6 547 231         |                    | 40 571                | 182                                     | 0                   | 182     | 0,00   |
| 08/2026      |                   | SEK             | 8 676             |                    | 896                   | 0                                       | (2)                 | (2)     | 0,00   |
| 08/2026      |                   | \$              | 61                | AUD                | 88                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
| 09/2026      |                   | CLP             | 5 943 486         | \$                 | 6 654                 | 204                                     | 0                   | 204     | 0,00   |
| 09/2026      | COP               | 38 181 074      |                   | 9 775              | 0                     | (1 107)                                 | (1 107)             | (0,02)  |        |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |            | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 09/2026           | MXN             | 153 597    | \$                | 8 698      | \$ 0               | \$ (36)               | \$ (36)                                 | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 129 421    | INR               | 12 402 398 | 739                | 0                     | 739                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 9 804      | PEN               | 33 705     | 50                 | 0                     | 50                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 39 187     | \$                | 11 367     | 0                  | (52)                  | (52)                                    | 0,00                |
|              | 03/2027           | COP             | 74 667 631 |                   | 18 375     | 0                  | (2 006)               | (2 006)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           | ARS             | 1 601 464  |                   | 1 061      | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 255 527    |                   | 49 129     | 0                  | (239)                 | (239)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 24 408     |                   | 3 606      | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 722 151    |                   | 190        | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | DOP             | 366 637    |                   | 5 972      | 0                  | (166)                 | (166)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 34 693     | BRL               | 204 548    | 0                  | (145)                 | (145)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 220 679  | \$                | 12 875     | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 89 850     |                   | 22 104     | 107                | 0                     | 107                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 082      | ARS               | 1 601 464  | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 101 180    | BRL               | 535 509    | 2 640              | (359)                 | 2 281                                   | 0,04                |
|              | 07/2026           |                 | 809        | CAD               | 1 152      | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 30 707     | CNH               | 207 222    | 0                  | (179)                 | (179)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 23 496     | COP               | 82 799 455 | 419                | (6)                   | 413                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 73 744     | INR               | 6 995 267  | 120                | (96)                  | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17 698     | MYR               | 71 675     | 0                  | (151)                 | (151)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 724      | PEN               | 20 131     | 178                | 0                     | 178                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 490        | PLN               | 1 823      | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 385      | RON               | 19 847     | 0                  | (57)                  | (57)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 33         | TRY               | 1 565      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 14 250     | ZAR               | 236 198    | 138                | 0                     | 138                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 204 548    | €                 | 34 380     | 148                | 0                     | 148                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 21 798     | \$                | 4 180      | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 1 150      |                   | 809        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP             | 1 474 901  |                   | 24 678     | 196                | (10)                  | 186                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT             | 2 083 241  |                   | 3 995      | 0                  | (306)                 | (306)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | NGN             | 5 859 000  |                   | 3 720      | 0                  | (437)                 | (437)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 37 691     | DOP               | 2 362 319  | 1 530              | 0                     | 1 530                                   | 0,02                |
|              | 08/2026           |                 | 5 328      | INR               | 510 964    | 48                 | 0                     | 48                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 10 222     | PEN               | 34 462     | 0                  | (128)                 | (128)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | ARS             | 3 649 144  | \$                | 1 916      | 0                  | (447)                 | (447)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | COP             | 3 006 412  |                   | 862        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | DOP             | 2 817 976  |                   | 46 529     | 347                | (475)                 | (128)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 28 800 445 |                   | 303 842    | 1 588              | 0                     | 1 588                                   | 0,02                |
|              | 09/2026           | MXN             | 749 489    |                   | 43 231     | 610                | 0                     | 610                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 159      | ARS               | 3 649 144  | 204                | 0                     | 204                                     | 0,00                |
| 09/2026      |                   | 17 124          | BRL        | 90 253            | 54         | 0                  | 54                    | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      |                   | 60 544          | IDR        | 1 094 080 862     | 242        | (140)              | 102                   | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      |                   | 57 506          | INR        | 5 527 119         | 500        | 0                  | 500                   | 0,01                                    |                     |
| 09/2026      |                   | 89 243          | MXN        | 1 558 363         | 0          | (623)              | (623)                 | (0,01)                                  |                     |
| 09/2026      |                   | 119 837         | THB        | 3 868 561         | 0          | (2 655)            | (2 655)               | (0,04)                                  |                     |
| 10/2026      | DOP               | 132 523         | \$         | 2 225             | 40         | 0                  | 40                    | 0,00                                    |                     |
| 10/2026      | \$                | 32 005          | BRL        | 170 261           | 181        | 0                  | 181                   | 0,00                                    |                     |
| 10/2026      |                   | 313             | MNT        | 1 146 198         | 3          | 0                  | 3                     | 0,00                                    |                     |
| 11/2026      | COP               | 82 111 008      | \$         | 22 622            | 0          | (435)              | (435)                 | (0,01)                                  |                     |
| 11/2026      | DOP               | 1 672 007       |            | 27 497            | 0          | (31)               | (31)                  | 0,00                                    |                     |
| 12/2026      |                   | 141 636         |            | 2 371             | 50         | 0                  | 50                    | 0,00                                    |                     |
| 04/2027      | \$                | 379             | MNT        | 1 428 822         | 2          | 0                  | 2                     | 0,00                                    |                     |
| 10/2027      |                   | 371             |            | 1 436 672         | 2          | 0                  | 2                     | 0,00                                    |                     |
| 04/2028      |                   | 1 109           |            | 4 403 468         | 7          | 0                  | 7                     | 0,00                                    |                     |
| 10/2028      |                   | 1 025           |            | 4 175 595         | 6          | 0                  | 6                     | 0,00                                    |                     |
| 04/2029      |                   | 1 005           |            | 4 201 801         | 6          | 0                  | 6                     | 0,00                                    |                     |
| 10/2029      |                   | 876             |            | 3 766 952         | 5          | 0                  | 5                     | 0,00                                    |                     |
| 04/2030      |                   | 854             |            | 3 769 437         | 4          | 0                  | 4                     | 0,00                                    |                     |
| 10/2030      |                   | 741             |            | 3 360 546         | 4          | 0                  | 4                     | 0,00                                    |                     |
| 04/2031      |                   | 714             |            | 3 315 238         | 1          | 0                  | 1                     | 0,00                                    |                     |
| IND          | 07/2026           | COP             | 2 697 288  | \$                | 712        | 0                  | (66)                  | (66)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 427      | HUF               | 1 961 935  | 0                  | (125)                 | (125)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19 348     | MYR               | 77 975     | 0                  | (259)                 | (259)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7          | PLN               | 27         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 2 412      | \$                | 1 687      | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 23 697     |                   | 4 554      | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 838 981    |                   | 123 239    | 0                  | (359)                 | (359)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CZK             | 251 244    |                   | 11 802     | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | EGP             | 235 372    |                   | 3 815      | 0                  | (931)                 | (931)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | HUF             | 719 904    |                   | 2 307      | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             | 249 094    |                   | 521        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 192 705    |                   | 10 803     | 0                  | (215)                 | (215)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 247 849    |                   | 60 812     | 304                | (166)                 | 138                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 467 334    |                   | 47 213     | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 289 483    |                   | 79 173     | 2 198              | (37)                  | 2 161                                   | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 601      | AUD               | 2 246      | 0                  | (45)                  | (45)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 9 287      | BRL               | 47 003     | 0                  | (206)                 | (206)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 24 080     | CNH               | 162 555    | 0                  | (133)                 | (133)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 639        | CZK               | 13 500     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 250      | EGP               | 66 250     | 95                 | 0                     | 95                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 478      | HUF               | 2 283 204  | 0                  | (146)                 | (146)                                   | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | \$              | 38 241 ILS        | 108 361            | \$ 2                  | \$ (1 868)                              | \$ (1 866) (0,03)   |
|              | 07/2026           |                 | 107 INR           | 10 126             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 460 PEN           | 1 606              | 11                    | 0                                       | 11 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 11 330 ZAR        | 184 259            | 2                     | (108)                                   | (106) 0,00          |
|              | 08/2026           | HKD             | 750 \$            | 96                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | ILS             | 57 429            | 19 943             | 651                   | 0                                       | 651 0,01            |
|              | 08/2026           | KZT             | 1 262 950         | 2 600              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | PEN             | 1 541             | 447                | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 1 686 AUD         | 2 412              | 0                     | (16)                                    | (16) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 173 ILS           | 511                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 4 091 KZT         | 2 158 502          | 355                   | 0                                       | 355 0,01            |
|              | 08/2026           |                 | 47 213 NOK        | 467 539            | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 09/2026           | COP             | 24 096 678 \$     | 6 601              | 0                     | (267)                                   | (267) 0,00          |
|              | 09/2026           | IDR             | 258 991 875       | 14 139             | 0                     | (217)                                   | (217) 0,00          |
|              | 09/2026           | INR             | 1 254 131         | 13 146             | 25                    | (41)                                    | (16) 0,00           |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 208 742         | 69 113             | 564                   | (190)                                   | 374 0,01            |
|              | 09/2026           | PKR             | 665 333           | 2 233              | 0                     | (129)                                   | (129) 0,00          |
|              | 09/2026           | THB             | 2 089 325         | 63 820             | 789                   | (256)                                   | 533 0,01            |
|              | 09/2026           | TWD             | 55 939            | 1 767              | 16                    | 0                                       | 16 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 306 988 BRL       | 1 587 466          | 0                     | (4 839)                                 | (4 839) (0,07)      |
|              | 09/2026           |                 | 10 777 IDR        | 195 772 662        | 74                    | 0                                       | 74 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 10 335 INR        | 985 713            | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 09/2026           |                 | 22 484 MXN        | 392 441            | 0                     | (167)                                   | (167) 0,00          |
|              | 09/2026           |                 | 172 469 THB       | 5 627 664          | 41                    | (2 043)                                 | (2 002) (0,03)      |
|              | 10/2026           | UGX             | 10 063 735        | 2 731              | 50                    | 0                                       | 50 0,00             |
|              | 10/2026           | UZS             | 77 627 329        | 6 109              | 0                     | (263)                                   | (263) 0,00          |
|              | 12/2026           | MXN             | 61 358            | 3 480              | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|              | 12/2026           | \$              | 55 745 MXN        | 983 952            | 0                     | (190)                                   | (190) 0,00          |
|              | 06/2027           | UZS             | 30 703            | 2                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 03/2030           | IDR             | 252 540 875       | 12 118             | 0                     | (959)                                   | (959) (0,01)        |
|              | 03/2030           | \$              | 11 598 IDR        | 246 110 438        | 1 146                 | 0                                       | 1 146 0,02          |
|              | 07/2026           | AUD             | 42 \$             | 29                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | COP             | 11 337 153        | 2 993              | 0                     | (280)                                   | (280) 0,00          |
|              | 07/2026           | EGP             | 5 624             | 99                 | 0                     | (15)                                    | (15) 0,00           |
|              | 07/2026           | €               | 31 057            | 35 982             | 475                   | 0                                       | 475 0,01            |
|              | 07/2026           | £               | 6                 | 8                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | INR             | 1 554 320         | 16 459             | 54                    | 0                                       | 54 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 216 201           | 1 361              | 30                    | 0                                       | 30 0,00             |
|              | 07/2026           | KRW             | 48 595 627        | 32 057             | 669                   | 0                                       | 669 0,01            |
|              | 07/2026           | MYR             | 114 549           | 28 381             | 337                   | 0                                       | 337 0,01            |
|              | 07/2026           | NOK             | 150 714           | 15 165             | 0                     | (65)                                    | (65) 0,00           |
|              | 07/2026           | TWD             | 136 662           | 4 305              | 16                    | 0                                       | 16 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 7 AUD             | 9                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 022 CHF         | 801                | 0                     | (30)                                    | (30) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 25 697 €          | 22 122             | 0                     | (404)                                   | (404) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 2 145 £           | 1 598              | 0                     | (24)                                    | (24) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 3 IDR             | 54 000             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 369 ILS           | 1 086              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 11 741 INR        | 1 131 274          | 192                   | 0                                       | 192 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 75 MYR            | 308                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 42 274 NOK        | 391 984            | 0                     | (2 662)                                 | (2 662) (0,04)      |
|              | 07/2026           |                 | 545 SEK           | 5 308              | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 08/2026           | SEK             | 5 298 \$          | 545                | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 29 AUD            | 42                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 72 EGP            | 3 931              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 4 194 €           | 3 673              | 11                    | 0                                       | 11 0,00             |
|              | 08/2026           |                 | 15 165 NOK        | 150 778            | 65                    | 0                                       | 65 0,00             |
|              | 09/2026           | CLP             | 2 706 703         | 3 029              | 92                    | 0                                       | 92 0,00             |
|              | 09/2026           | EGP             | 781 886           | 14 033             | 0                     | (1 355)                                 | (1 355) (0,02)      |
|              | 09/2026           | INR             | 4 899 147         | 51 370             | 0                     | (45)                                    | (45) 0,00           |
|              | 09/2026           | MXN             | 80 517            | 4 590              | 11                    | 0                                       | 11 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 42 413 INR        | 4 052 773          | 161                   | (72)                                    | 89 0,00             |
|              | 10/2026           | ZAR             | 32 072            | 1 802              | 0                     | (139)                                   | (139) 0,00          |
|              | 12/2026           | MYR             | 71 804            | 17 820             | 188                   | 0                                       | 188 0,00            |
| MYI          | 07/2026           |                 | 31 133            | 7 511              | 0                     | (110)                                   | (110) 0,00          |
|              | 07/2026           | PLN             | 23 320            | 6 195              | 0                     | (9)                                     | (9) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 223 €             | 195                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 157 ILS           | 451                | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 1 941 PEN         | 6 825              | 60                    | 0                                       | 60 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 4 688 PLN         | 17 128             | 0                     | (132)                                   | (132) 0,00          |
|              | 08/2026           | CZK             | 118 699           | 4 867              | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
|              | 09/2026           | IDR             | 74 985 472        | 4 173              | 16                    | 0                                       | 16 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 5 410 IDR         | 97 756 841         | 9                     | 0                                       | 9 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 469 MXN           | 8 230              | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
| NSL          | 10/2026           |                 | 4 342 AZN         | 7 768              | 192                   | 0                                       | 192 0,00            |
|              | 10/2027           |                 | 8 684             | 15 979             | 420                   | 0                                       | 420 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 11 402 INR        | 1 096 901          | 176                   | 0                                       | 176 0,00            |
| RYL          | 09/2026           |                 | 18 377 IDR        | 327 015 132        | 0                     | (250)                                   | (250) 0,00          |
|              | 07/2026           |                 | 998 £             | 755                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
| SCX          | 09/2026           |                 | 7 369 IDR         | 132 235 202        | 0                     | (39)                                    | (39) 0,00           |
|              | 07/2026           | €               | 3 239             | 3 765              | 62                    | 0                                       | 62 0,00             |
|              | 07/2026           | MYR             | 110 345           | 27 322             | 309                   | 0                                       | 309 0,01            |

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| SOG          | 07/2026              | PEN                | 8 148                | \$ 2 378              | \$ 0                     | \$ (11)                                       | (11) 0,00              |
|              | 07/2026              | THB                | 809 777              | 24 647                | 256                      | 0                                             | 256 0,00               |
|              | 07/2026              | TWD                | 735 606              | 23 176                | 92                       | 0                                             | 92 0,00                |
|              | 07/2026              | \$                 | 4 469                | CNH 30 195            | 0                        | (21)                                          | (21) 0,00              |
|              | 07/2026              |                    | 304                  | CNY 2 078             | 1                        | 0                                             | 1 0,00                 |
|              | 07/2026              |                    | 26                   | € 23                  | 0                        | 0                                             | 0 0,00                 |
|              | 07/2026              |                    | 20 084               | INR 1 923 472         | 218                      | 0                                             | 218 0,00               |
|              | 07/2026              |                    | 222 536              | MYR 915 211           | 1 510                    | 0                                             | 1 510 0,02             |
|              | 07/2026              |                    | 10 841               | PEN 37 846            | 256                      | 0                                             | 256 0,00               |
|              | 07/2026              | ZAR                | 13 167               | \$ 804                | 1                        | 0                                             | 1 0,00                 |
|              | 07/2026              | ZMW                | 30 601               | 1 455                 | 0                        | (236)                                         | (236) 0,00             |
|              | 08/2026              | HKD                | 708                  | 91                    | 0                        | 0                                             | 0 0,00                 |
|              | 08/2026              | \$                 | 13 246               | INR 1 269 147         | 106                      | 0                                             | 106 0,00               |
|              | 08/2026              |                    | 1 045                | KZT 548 114           | 87                       | 0                                             | 87 0,00                |
|              | 09/2026              | EGP                | 107 954              | \$ 2 101              | 0                        | (25)                                          | (25) 0,00              |
|              | 09/2026              | IDR                | 2 266 487 664        | 125 361               | 0                        | (273)                                         | (273) 0,00             |
|              | 09/2026              | KZT                | 302 743              | 602                   | 0                        | (16)                                          | (16) 0,00              |
|              | 09/2026              | PEN                | 10 299               | 2 999                 | 0                        | (13)                                          | (13) 0,00              |
|              | 09/2026              | THB                | 1 346 637            | 40 956                | 234                      | (69)                                          | 165 0,00               |
|              | 09/2026              | \$                 | 79 780               | IDR 1 438 438 833     | 250                      | (296)                                         | (46) 0,00              |
|              | 09/2026              |                    | 76 065               | INR 7 229 332         | 0                        | (195)                                         | (195) 0,00             |
|              | 09/2026              |                    | 111 274              | THB 3 615 789         | 0                        | (1 749)                                       | (1 749) (0,03)         |
|              | 10/2026              |                    | 4 953                | UGX 18 777 515        | 79                       | (23)                                          | 56 0,00                |
|              | 11/2026              | UGX                | 560 523              | \$ 145                | 0                        | (4)                                           | (4) 0,00               |
|              | 12/2026              | CLP                | 9 950 182            | 11 062                | 256                      | 0                                             | 256 0,00               |
|              | 03/2030              | IDR                | 239 680 000          | 10 700                | 0                        | (1 711)                                       | (1 711) (0,03)         |
|              | 07/2026              | CNH                | 77 452               | 11 449                | 39                       | 0                                             | 39 0,00                |
|              | 07/2026              | €                  | 11 506               | RON 60 708            | 84                       | 0                                             | 84 0,00                |
|              | 07/2026              |                    | 219 833              | \$ 256 441            | 5 108                    | 0                                             | 5 108 0,08             |
|              | 07/2026              | £                  | 1                    | 1                     | 0                        | 0                                             | 0 0,00                 |
|              | 07/2026              | ¥                  | 562 983              | 3 544                 | 80                       | 0                                             | 80 0,00                |
|              | 07/2026              | TWD                | 218 596              | 6 921                 | 63                       | 0                                             | 63 0,00                |
|              | 07/2026              | \$                 | 7 985                | BRL 40 580            | 0                        | (145)                                         | (145) 0,00             |
|              | 07/2026              |                    | 1 456                | EGP 77 187            | 111                      | 0                                             | 111 0,00               |
|              | 07/2026              |                    | 293 927              | € 258 398             | 1 499                    | 0                                             | 1 499 0,02             |
|              | 07/2026              |                    | 5 461                | SGD 7 072             | 7                        | 0                                             | 7 0,00                 |
|              | 08/2026              | €                  | 258 398              | \$ 294 326            | 0                        | (1 496)                                       | (1 496) (0,02)         |
|              | 08/2026              | SGD                | 7 056                | 5 461                 | 0                        | (7)                                           | (7) 0,00               |
|              | 09/2026              | EGP                | 129 101              | 2 318                 | 0                        | (224)                                         | (224) 0,00             |
|              | 09/2026              | INR                | 574 552              | 6 048                 | 18                       | 0                                             | 18 0,00                |
|              | 09/2026              | \$                 | 1 072                | THB 34 618            | 0                        | (23)                                          | (23) 0,00              |
|              | 12/2027              |                    | 149                  | CNH 1 020             | 8                        | 0                                             | 8 0,00                 |
|              | 12/2028              |                    | 2 656                | 17 939                | 162                      | 0                                             | 162 0,00               |
|              | 12/2029              |                    | 7 388                | 49 152                | 518                      | 0                                             | 518 0,01               |
|              | 12/2030              |                    | 12 875               | 84 144                | 995                      | 0                                             | 995 0,02               |
|              | 12/2031              |                    | 15 435               | 99 043                | 1 313                    | 0                                             | 1 313 0,02             |
|              | 12/2032              |                    | 16 517               | 103 930               | 1 503                    | 0                                             | 1 503 0,02             |
|              | 12/2033              |                    | 17 406               | 107 182               | 1 654                    | 0                                             | 1 654 0,03             |
|              | 12/2034              |                    | 18 489               | 111 251               | 1 815                    | 0                                             | 1 815 0,03             |
|              | 12/2035              |                    | 19 626               | 115 320               | 1 995                    | 0                                             | 1 995 0,03             |
|              | 12/2036              |                    | 20 949               | 120 207               | 2 139                    | 0                                             | 2 139 0,03             |
|              | 12/2037              |                    | 22 045               | 123 458               | 2 316                    | 0                                             | 2 316 0,04             |
|              | 12/2038              |                    | 23 358               | 127 527               | 2 494                    | 0                                             | 2 494 0,04             |
|              | 12/2039              |                    | 24 745               | 131 597               | 2 669                    | 0                                             | 2 669 0,04             |
|              | 12/2040              |                    | 26 367               | 136 484               | 2 865                    | 0                                             | 2 865 0,04             |
| SSB          | 07/2026              | BRL                | 31 998               | \$ 6 172              | 0                        | (10)                                          | (10) 0,00              |
|              | 07/2026              | CAD                | 1 184                | 859                   | 24                       | 0                                             | 24 0,00                |
|              | 07/2026              | \$                 | 7 647                | BRL 39 406            | 0                        | (34)                                          | (34) 0,00              |
|              | 07/2026              |                    | 7                    | CAD 11                | 0                        | 0                                             | 0 0,00                 |
|              | 07/2026              |                    | 138 628              | £ 104 873             | 565                      | 0                                             | 565 0,01               |
|              | 08/2026              | CAD                | 11                   | \$ 7                  | 0                        | 0                                             | 0 0,00                 |
|              | 08/2026              | €                  | 15                   | 17                    | 0                        | 0                                             | 0 0,00                 |
|              | 08/2026              | £                  | 104 873              | 138 625               | 0                        | (565)                                         | (565) (0,01)           |
|              | 09/2026              | COP                | 261 913 763          | 67 427                | 0                        | (7 225)                                       | (7 225) (0,11)         |
|              | 12/2026              |                    | 397 040 000          | 100 000               | 0                        | (10 744)                                      | (10 744) (0,16)        |
| UAG          | 07/2026              |                    | 166 589 002          | 43 863                | 0                        | (4 234)                                       | (4 234) (0,06)         |
|              | 07/2026              | ILS                | 1 554                | 528                   | 6                        | 0                                             | 6 0,00                 |
|              | 07/2026              | \$                 | 198                  | ILS 587               | 0                        | (1)                                           | (1) 0,00               |
|              | 07/2026              |                    | 58                   | KRW 87 305            | 0                        | (1)                                           | (1) 0,00               |
|              | 07/2026              |                    | 39 493               | PLN 144 314           | 0                        | (1 101)                                       | (1 101) (0,02)         |
|              | 08/2026              | COP                | 78 127 323           | \$ 20 692             | 0                        | (1 795)                                       | (1 795) (0,03)         |
|              | 09/2026              |                    | 73 688 999           | 19 398                | 0                        | (1 605)                                       | (1 605) (0,02)         |
|              | 10/2026              | HUF                | 223 153              | € 600                 | 0                        | (24)                                          | (24) 0,00              |
|              | 11/2026              |                    | 2 376 246            | 6 592                 | 0                        | (25)                                          | (25) 0,00              |
|              | 07/2026              | CHF                | 800                  | \$ 991                | 0                        | (1)                                           | (1) 0,00               |
| WST          | 08/2026              | \$                 | 991                  | CHF 797               | 1                        | 0                                             | 1 0,00                 |
|              |                      |                    |                      | \$ 91 842             | \$ (116 547)             | \$ (24 705)                                   | (0,38)                 |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 893          | € 768             | \$ 0               | \$ (16)               | \$ (16)                                 | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$ 65 062       | € 55 912          | \$ 12              | \$ (1 150)            | \$ (1 138)                              | (0,02)              |
| BSH          | 07/2026           | \$ 58 130       | € 49 857          | \$ 0               | \$ (1 129)            | \$ (1 129)                              | (0,02)              |
| CBK          | 07/2026           | \$ 1 664        | € 1 427           | \$ 0               | \$ (33)               | \$ (33)                                 | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 65 353        | \$ 74 535         | \$ 0               | \$ (183)              | \$ (183)                                | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$ 74 636       | € 65 353          | \$ 183             | \$ 0                  | \$ 183                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 67 192        | \$ 76 320         | \$ 3               | \$ (503)              | \$ (500)                                | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 47 545       | € 40 796          | \$ 0               | \$ (902)              | \$ (902)                                | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 78 289       | € 68 828          | \$ 507             | \$ 0                  | \$ 507                                  | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | € 67 034        | \$ 76 251         | \$ 0               | \$ (389)              | \$ (389)                                | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 61 793       | € 52 971          | \$ 0               | \$ (1 231)            | \$ (1 231)                              | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 76 355       | € 67 034          | \$ 388             | \$ 0                  | \$ 388                                  | 0,01                |
| SSB          | 08/2026           | \$ 2 455        | € 2 151           | \$ 7               | \$ 0                  | \$ 7                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 100           | \$ (5 536)            | \$ (4 436)                              | (0,07)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 80           | £ 60              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 53            | \$ 70             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 89           | £ 67              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 70           | £ 53              | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 13            | \$ 17             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 17           | £ 13              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 62            | \$ 82             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 84           | £ 63              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 82           | £ 62              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 62            | \$ 81             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 81           | £ 62              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (3)                | \$ (2)                                  | 0,00                |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (22 637) (0,34)

Total des Investissements

\$ 6 972 285 105,99

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (394 054) (5,99)

Actif net

\$ 6 578 231 100,00

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

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

<sup>A</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,01 %) :

| Description de l'émetteur                | Date d'achat | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|------------------------------------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| DrillCo Holding Lux S.A.                 | 08/06/2023   | \$ 158 | \$ 181       | 0,00                |
| Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2049 | 03/02/2026   | 0      | 0            | 0,00                |
|                                          |              | \$ 158 | \$ 181       | 0,00                |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 694 001 \$ (31 décembre 2025 : 420 876 \$) et un montant en numéraire de 260 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un titre d'une juste valeur globale de 12 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 7 425 \$ (31 décembre 2025 : 7 756 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 64 941 \$ (31 décembre 2025 : 61 519 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 61 610 \$ (31 décembre 2025 : 22 730 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.



Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 49                                                                             | \$ 6 542 064                                         | \$ 355 278                                        | \$ 6 897 391        |
| Fonds d'investissement                        | 160 566                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 160 566             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (102)                                                                             | (86 096)                                             | 526                                               | (85 672)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 160 513</b>                                                                 | <b>\$ 6 455 968</b>                                  | <b>\$ 355 804</b>                                 | <b>\$ 6 972 285</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 5 902 476                                         | \$ 272 286                                        | \$ 6 174 762        |
| Fonds d'investissement                        | 485 531                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 485 531             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | (15 657)                                             | 748                                               | (14 909)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 485 531</b>                                                                 | <b>\$ 5 886 819</b>                                  | <b>\$ 273 034</b>                                 | <b>\$ 6 645 384</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,830 %        | 30/06/2026        | 01/07/2026         | \$ (2 159)       | \$ (2 159)                               | (0,03)              |
| BPS                                           | 3,870          | 05/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | PLN (193 777)    | (52 223)                                 | (0,79)              |
| BRC                                           | 3,750          | 19/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | CZK (382 608)    | (18 048)                                 | (0,27)              |
|                                               | 3,800          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (3 742)       | (3 821)                                  | (0,06)              |
|                                               | 5,900          | 24/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | HUF (4 520 298)  | (14 537)                                 | (0,22)              |
|                                               | 5,900          | 25/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (589 522)        | (1 896)                                  | (0,03)              |
| DEU                                           | 3,760          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | \$ (1 384)       | (1 384)                                  | (0,02)              |
| JML                                           | 4,050          | 30/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | PLN (438 610)    | (116 701)                                | (1,77)              |
| JPS                                           | 5,800          | 25/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | HUF (6 488 465)  | (20 862)                                 | (0,32)              |
| MBC                                           | 3,600          | 19/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | CZK (864 572)    | (40 781)                                 | (0,62)              |
|                                               | 3,900          | 08/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | PLN (858 445)    | (228 957)                                | (3,48)              |
|                                               | 3,950          | 21/01/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (9 369)       | (9 534)                                  | (0,15)              |
|                                               | 5,850          | 25/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | HUF (1 271 054)  | (4 087)                                  | (0,06)              |
|                                               | 5,850          | 26/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 522 157)      | (4 894)                                  | (0,08)              |
|                                               | 7,000          | 03/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | ZAR (1 905 172)  | (116 873)                                | (1,78)              |
|                                               | 7,000          | 24/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (191 619)        | (11 707)                                 | (0,18)              |
| MEI                                           | 3,920          | 17/04/2026        | 02/07/2026         | PLN (64 147)     | (17 206)                                 | (0,26)              |
|                                               | 5,850          | 25/06/2026        | 02/07/2026         | HUF (2 868 267)  | (9 222)                                  | (0,14)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (674 892)</b>                      | <b>(10,26)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 28                                                      | \$ 0                    | \$ 28                             | \$ 0                                                       | \$ (110)                | \$ (110)                          |
| BOA          | (8 298)                                                    | 10 550                  | 2 252                             | 1 985                                                      | (1 690)                 | 295                               |
| BPS          | (438)                                                      | 1 360                   | 922                               | 7 423                                                      | (5 900)                 | 1 523                             |
| BRC          | 937                                                        | (1 080)                 | (143)                             | 6 029                                                      | (6 340)                 | (311)                             |
| BSH          | 3 847                                                      | (3 860)                 | (13)                              | (6 060)                                                    | 5 430                   | (630)                             |
| CBK          | (5 975)                                                    | 8 180                   | 2 205                             | (5 553)                                                    | 6 230                   | 677                               |
| DUB          | (3 893)                                                    | 3 540                   | (353)                             | 1 064                                                      | (3 360)                 | (2 296)                           |
| FAR          | (2 198)                                                    | 1 470                   | (728)                             | (5 080)                                                    | 4 880                   | (200)                             |
| GLM          | (195)                                                      | 0                       | (195)                             | 5 588                                                      | 910                     | 6 498                             |
| GST          | 276                                                        | (2 530)                 | (2 252)                           | 99                                                         | 0                       | 99                                |
| IND          | (450)                                                      | 460                     | 10                                | (40)                                                       | 0                       | (40)                              |
| JPM          | (5 154)                                                    | 6 060                   | 906                               | 5 362                                                      | (5 680)                 | (318)                             |
| MBC          | (2 824)                                                    | 3 220                   | 396                               | (2 528)                                                    | 2 070                   | (458)                             |
| MYC          | 496                                                        | (530)                   | (34)                              | (301)                                                      | 730                     | 429                               |
| MYI          | 422                                                        | (430)                   | (8)                               | (1 599)                                                    | 1 050                   | (549)                             |
| NSL          | (74)                                                       | 0                       | (74)                              | 518                                                        | (450)                   | 68                                |
| RYL          | (35)                                                       | 0                       | (35)                              | 294                                                        | (350)                   | (56)                              |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| SCX          | \$ 1 579                                                   | \$ (850)                | \$ 729                            | \$ 690                                                     | \$ 440                  | \$ 1 130                          |
| SOG          | 26 328                                                     | (20 470)                | 5 858                             | 6 735                                                      | (5 140)                 | 1 595                             |
| SSB          | (17 982)                                                   | 17 840                  | (142)                             | (760)                                                      | 990                     | 230                               |
| UAG          | (9 036)                                                    | 8 930                   | (106)                             | 2 988                                                      | (2 500)                 | 488                               |
| WST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |

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

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 69,40            | 69,00                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 7,60             | 5,68                 |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,71             | 1,74                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,83             | 6,01                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 2,81             | 2,29                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,36             | 1,22                 |
| Autres actifs                                                    | 15,29            | 14,06                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Argentine                         | 0,12             | 0,05                 |
| Azerbaïdjan                       | 0,21             | 0,16                 |
| Bésil                             | 0,62             | 0,61                 |
| Îles Caïmans                      | 1,02             | 0,35                 |
| Chili                             | 4,83             | 5,00                 |
| Chine                             | 6,00             | 2,49                 |
| Colombie                          | 10,54            | 9,94                 |
| Costa Rica                        | 0,47             | 0,26                 |
| République tchèque                | 3,59             | 2,72                 |
| Danemark                          | 0,00             | 0,00                 |
| République dominicaine            | 1,77             | 2,20                 |
| Équateur                          | S/O              | 0,22                 |
| Égypte                            | 1,36             | 1,01                 |
| Allemagne                         | 0,95             | 1,06                 |
| Ghana                             | 0,20             | 0,16                 |
| Hongrie                           | 1,52             | 0,90                 |
| Inde                              | 5,10             | S/O                  |
| Indonésie                         | 4,77             | 4,80                 |
| Internationales                   | 0,03             | S/O                  |
| Irlande                           | 0,75             | 0,81                 |
| Côte d'Ivoire                     | 0,48             | 0,48                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,14             | S/O                  |
| Kazakhstan                        | 1,05             | 0,51                 |
| Kenya                             | 0,04             | 0,05                 |
| Luxembourg                        | 0,30             | 0,10                 |
| Malaisie                          | 6,55             | 4,24                 |
| Mexique                           | 9,64             | 11,19                |
| Pays-Bas                          | 0,18             | 0,12                 |
| Nigeria                           | 0,36             | 0,13                 |
| Paraguay                          | 0,39             | 0,37                 |
| Pérou                             | 6,43             | 7,26                 |
| Philippines                       | 0,31             | 5,57                 |
| Pologne                           | 9,98             | 7,14                 |
| Qatar                             | 0,36             | S/O                  |
| Roumanie                          | 2,02             | 2,28                 |
| Serbie                            | 0,36             | 0,54                 |
| Afrique du Sud                    | 8,61             | 9,89                 |
| Supranationales                   | 1,20             | 0,63                 |
| Tanzanie                          | 0,06             | 0,18                 |
| Thaïlande                         | 1,64             | 3,14                 |
| Turquie                           | 0,73             | 1,89                 |
| Ouganda                           | S/O              | 0,11                 |
| Ukraine                           | S/O              | 0,08                 |
| Émirats arabes unis               | 0,22             | 0,03                 |
| Royaume-Uni                       | 1,15             | 1,15                 |
| États-Unis                        | 3,95             | 3,23                 |
| Uruguay                           | 0,18             | 0,14                 |
| Ouzbékistan                       | 0,14             | 0,19                 |
| Venezuela                         | 0,39             | 0,10                 |
| Zambie                            | 0,03             | 0,05                 |
| Instruments à court terme         | 4,11             | 2,30                 |
| Fonds d'investissement            | 2,44             | 7,54                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | S/O              | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,96)           | (0,48)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,11             | 0,18                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,08             | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,11)           | (0,09)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | (0,03)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,07             | 0,03                 |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | (0,06)           | 0,12                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,06             | 0,02                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,38)           | (0,01)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,07)           | 0,03                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (5,99)           | (3,14)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                  |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| ARGENTINE                                           |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin  |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 03/06/2036                                             | CZK                                 | 3 900                            | \$ 170 0,08               |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                             | \$                                  | 300                              | 241 0,11                  | 4,250 % éch. 24/10/2034                                             |                                     | 35 700                           | 1 657 0,74                |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 11/11/2032 (e)                                         |                                     | 83 050                           | 3 964 1,78                |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 03/10/2035                                             |                                     | 71 400                           | 3 392 1,52                |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 14/04/2034                                             |                                     | 12 000                           | 584 0,26                  |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/09/2030                                             |                                     | 30 800                           | 1 506 0,67                |
|                                                     |                                     |                                  |                           | Total République tchèque                                            |                                     | 13 192                           | 5,91                      |
| BRÉSIL                                              |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien |                                     |                                  |                           | RÉPUBLIQUE DOMINICAINE                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 04/02/2033                             |                                     | 700                              | 691 0,31                  | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 01/01/2031                            | BRL                                 | 4 900                            | 823 0,37                  | 10,500 % éch. 15/03/2037                                            | DOP                                 | 146 550                          | 2 628 1,18                |
| Total Brésil                                        |                                     |                                  | 1 514 0,68                | 10,750 % éch. 01/06/2036                                            |                                     | 28 700                           | 522 0,23                  |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 11,250 % éch. 15/09/2035                                            |                                     | 8 000                            | 149 0,07                  |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 13,625 % éch. 03/02/2033                                            |                                     | 10 250                           | 208 0,09                  |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 13,625 % éch. 10/02/2034                                            |                                     | 9 200                            | 188 0,08                  |
|                                                     |                                     |                                  |                           | Total République dominicaine                                        |                                     | 3 695                            | 1,65                      |
| ÎLES CAÏMANS                                        |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| QNB Finance Ltd.                                    |                                     |                                  |                           | ÉGYPTÉ                                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                             | \$                                  | 800                              | 804 0,36                  | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                  |                                     |                                  |                           |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 19,698 % éch. 14/10/2030                                            | EGP                                 | 33 700                           | 653 0,29                  |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 21,954 % éch. 04/03/2028                                            |                                     | 113 100                          | 2 232 1,00                |
|                                                     |                                     |                                  |                           | Total Égypte                                                        |                                     | 2 885                            | 1,29                      |
| CHILI                                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos      |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 2,300 % éch. 01/10/2023                             | CLP                                 | 560 000                          | 577 0,26                  | ALLEMAGNE                                                           |                                     |                                  |                           |
| 2,800 % éch. 01/10/2028                             |                                     | 45 000                           | 41 0,02                   | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 01/09/2030                             |                                     | 1 780 000                        | 1 906 0,85                | Deutsche Bank AG                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/10/2028                             |                                     | 570 000                          | 623 0,28                  | 8,010 % éch. 18/07/2034                                             | INR                                 | 142 000                          | 1 469 0,66                |
| 5,000 % éch. 01/03/2035                             |                                     | 520 000                          | 550 0,25                  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,800 % éch. 01/10/2029                             |                                     | 1 205 000                        | 1 345 0,60                | 5,800 % éch. 19/01/2028                                             | ZAR                                 | 2 500                            | 148 0,06                  |
| 5,800 % éch. 01/10/2034                             |                                     | 270 000                          | 301 0,14                  | Total Allemagne                                                     |                                     | 1 617                            | 0,72                      |
| 6,000 % éch. 01/04/2033                             |                                     | 2 850 000                        | 3 201 1,43                |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/01/2043                             |                                     | 40 000                           | 45 0,02                   | HONGRIE                                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 01/10/2040                             |                                     | 345 000                          | 404 0,18                  | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 01/05/2034                             |                                     | 20 000                           | 24 0,01                   | Obligation internationale du gouvernement hongrois                  |                                     |                                  |                           |
| Total Chili                                         |                                     |                                  | 9 017 4,04                | 4,000 % éch. 28/04/2051 (e)                                         | HUF                                 | 217 000                          | 583 0,26                  |
| COLOMBIE                                            |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 27/05/2032 (e)                                         |                                     | 1 534 950                        | 4 808 2,15                |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 24/11/2032                                             |                                     | 52 500                           | 167 0,08                  |
| Bogota Distrito Capital                             |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 24/10/2035                                             |                                     | 175 000                          | 642 0,29                  |
| 13,140 % éch. 05/11/2035                            | COP                                 | 4 647 000                        | 1 349 0,60                | Total Hongrie                                                       |                                     | 6 200                            | 2,78                      |
| TES colombien                                       |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 22/01/2031 (c)                         |                                     | 10 112 874                       | 2 908 1,30                | INDE                                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 26/03/2031                             |                                     | 50 015 900                       | 11 899 5,33               | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                               |                                     |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 28/05/2042                             |                                     | 168 000                          | 40 0,02                   | Obligation internationale du gouvernement indien                    |                                     |                                  |                           |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                            |                                     | 6 080 100                        | 1 712 0,77                | 6,330 % éch. 05/05/2035                                             | INR                                 | 47 500                           | 490 0,22                  |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                            |                                     | 17 005 800                       | 4 845 2,17                | 6,480 % éch. 06/10/2035                                             |                                     | 75 700                           | 786 0,35                  |
| 12,000 % éch. 13/03/2058                            |                                     | 173 500                          | 50 0,02                   | 6,680 % éch. 07/07/2040                                             |                                     | 94 390                           | 975 0,44                  |
| 12,500 % éch. 27/02/2030                            |                                     | 3 610 200                        | 1 054 0,47                | 6,940 % éch. 11/05/2036                                             |                                     | 426 590                          | 4 583 2,05                |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                            |                                     | 1 327 400                        | 402 0,18                  | 7,240 % éch. 18/08/2055                                             |                                     | 139 860                          | 1 469 0,66                |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                            |                                     | 2 393 700                        | 732 0,33                  | 7,300 % éch. 19/06/2053                                             |                                     | 104 640                          | 1 109 0,49                |
| Total Colombie                                      |                                     |                                  | 24 991 11,19              | 7,410 % éch. 19/12/2036                                             |                                     | 40 600                           |                           |

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>NIGERIA</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>SERBIE</b>                                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉTATS-UNIS</b>                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           |
| Dangote Fertiliser Ltd.                              |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement serbe                  |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC                      |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 05/05/2031                              | \$ 300                              | \$ 302                           | 0,13                      | 5,250 % éch. 27/07/2035                                          | RSD 77 200                          | \$ 747                           | 0,33                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                             | \$ 400                              | 399                              | 0,18                      |
| <b>PARAGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                            |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>              |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain           |                                     |                                  |                           | Obligations du Trésor américain                     |                                     |                                  |                           |
| 7,900 % éch. 09/02/2031                              | PYG 1 973 000                       | 313                              | 0,14                      | 7,000 % éch. 28/02/2031                                          | ZAR 6 300                           | 371                              | 0,17                      | 4,875 % éch. 15/08/2045                             | \$ 40                               | 40                               | 0,02                      |
| 8,500 % éch. 04/03/2035                              | 1 968 000                           | 314                              | 0,14                      | 8,250 % éch. 31/03/2032 (e)                                      | 3 100                               | 191                              | 0,09                      | Billets du Trésor américain                         |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 04/04/2038                              | 760 000                             | 120                              | 0,05                      | 8,500 % éch. 31/01/2037                                          | 177 100                             | 10 765                           | 4,82                      | 4,250 % éch. 15/08/2035                             | 70                                  | 69                               | 0,03                      |
| Total Paraguay                                       |                                     | 747                              | 0,33                      | 8,750 % éch. 31/01/2044 (e)                                      | 10 400                              | 623                              | 0,28                      |                                                     |                                     | 109                              | 0,05                      |
| <b>PÉROU</b>                                         |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 28/02/2048                                          | 8 950                               | 537                              | 0,24                      | Total États-Unis                                    |                                     | 1 098                            | 0,49                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 28/02/2035                                          | 39 900                              | 2 523                            | 1,13                      | <b>URUGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.         |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 31/01/2040 (e)                                      | 51 200                              | 3 160                            | 1,41                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                              | PEN 1 600                           | 503                              | 0,23                      | 9,875 % éch. 31/03/2039                                          | 6 800                               | 449                              | 0,20                      | Obligation internationale du gouvernement uruguayen |                                     |                                  |                           |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                             | 3 540                               | 1 142                            | 0,51                      | 10,125 % éch. 31/03/2042                                         | 7 700                               | 516                              | 0,23                      | 8,000 % éch. 29/10/2035                             | UYU 13 900                          | 355                              | 0,16                      |
|                                                      |                                     | 1 645                            | 0,74                      | Total Afrique du Sud                                             |                                     | 19 135                           | 8,57                      | 8,250 % éch. 21/05/2031                             | 1 300                               | 34                               | 0,01                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>SUPRANATIONALES</b>                                           |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 20/07/2033                             | 3 100                               | 86                               | 0,04                      |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |                                     |                                  |                           | Total Uruguay                                       |                                     | 475                              | 0,21                      |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                              | 2 400                               | 688                              | 0,31                      | Banque de développement asiatique                                |                                     |                                  |                           | <b>OUZBÉKISTAN</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                              | 7 100                               | 2 191                            | 0,98                      | 5,750 % éch. 23/01/2030 (d)                                      | HUF 443 000                         | 1 462                            | 0,65                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 6,900 % éch. 12/08/2037                              | 200                                 | 60                               | 0,03                      | 6,720 % éch. 08/02/2028                                          | INR 242 650                         | 2 542                            | 1,14                      | National Bank of Uzbekistan                         |                                     |                                  |                           |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                              | 1 240                               | 414                              | 0,18                      | 15,500 % éch. 16/03/2029                                         | KZT 149 400                         | 317                              | 0,14                      | 19,875 % éch. 05/07/2027                            | UZS 4 050 000                       | 357                              | 0,16                      |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                              | 30 600                              | 10 054                           | 4,50                      | Banque asiatique d'investissement pour les infrastructures       |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 7,600 % éch. 12/08/2039                              | 2 000                               | 630                              | 0,28                      | 4,250 % éch. 27/01/2027                                          | PHP 600                             | 10                               | 0,00                      | <b>BILLETS À COURT TERME</b>                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     | 14 037                           | 6,28                      | Banque Ouest Africaine de Développement                          |                                     |                                  |                           | Kona Spc Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |
| Total Pérou                                          |                                     | 15 682                           | 7,02                      | 6,250 % éch. 14/10/2040                                          | € 300                               | 329                              | 0,15                      | 5,718 % éch. 15/09/2026                             | € 1 000                             | 1 144                            | 0,51                      |
| <b>PHILIPPINES</b>                                   |                                     |                                  |                           | Banque européenne pour la reconstruction et le développement     |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                      |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,010 % éch. 13/03/2028                                          | PLN 600                             | 156                              | 0,07                      | 23,650 % éch. 13/10/2026 (a)(b)                     | EGP 1 575                           | 30                               | 0,01                      |
| Obligation internationale du gouvernement philippin  |                                     |                                  |                           | Banque européenne d'investissement                               |                                     |                                  |                           | 24,000 % éch. 13/10/2026 (a)(b)                     | 2 100                               | 40                               | 0,02                      |
| 6,250 % éch. 28/02/2029                              | PHP 7 310                           | 119                              | 0,05                      | 2,875 % éch. 15/11/2029                                          | 10 823                              | 2 750                            | 1,23                      | 24,001 % éch. 13/10/2026 (a)(b)                     | 50 000                              | 954                              | 0,43                      |
| 6,250 % éch. 14/01/2036                              | 20 000                              | 303                              | 0,14                      | 4,125 % éch. 25/07/2030                                          | 8 600                               | 2 254                            | 1,01                      | 24,050 % éch. 20/10/2026 (a)(b)                     | 5 500                               | 105                              | 0,05                      |
| Total Philippines                                    |                                     | 422                              | 0,19                      | 5,250 % éch. 25/04/2029                                          | 4 400                               | 1 200                            | 0,54                      | 24,060 % éch. 20/10/2026 (a)(b)                     | 600                                 | 11                               | 0,00                      |
| <b>POLONIE</b>                                       |                                     |                                  |                           | Banque interaméricaine de développement                          |                                     |                                  |                           | 24,200 % éch. 22/09/2026 (a)(b)                     | 6 000                               | 116                              | 0,05                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 06/10/2030                                          | INR 79 000                          | 834                              | 0,37                      | 24,299 % éch. 15/09/2026 (a)(b)                     | 2 800                               | 54                               | 0,02                      |
| Obligation internationale du gouvernement polonais   |                                     |                                  |                           | Banque internationale pour la reconstruction et le développement |                                     |                                  |                           | 24,351 % éch. 22/09/2026 (a)(b)                     | 12 200                              | 236                              | 0,11                      |
| 1,750 % éch. 25/04/2032                              | PLN 5 650                           | 1 277                            | 0,57                      | 0,000 % éch.                                                     |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 1 546                            | 0,69                      |
| 2,000 % éch. 25/08/2036 (c)                          | 1 436                               | 350                              | 0,16                      | 30/06/2027 (a)                                                   | MXN 25 000                          | 1 332                            | 0,60                      | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIEN</b>                      |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 25/07/2030 (e)                          | 7 000                               | 1 864                            | 0,84                      | 6,750 % éch. 09/02/2029                                          | ZAR 23 800                          | 1 445                            | 0,65                      | 18,745 % éch. 19/01/2027 (a)(b)                     | NGN 463 323                         | 303                              | 0,14                      |
| 4,500 % éch. 25/01/2031                              | 100                                 | 27                               | 0,01                      | 7,070 % éch. 26/06/2029                                          | MXN 1 400                           | 79                               | 0,04                      | 20,537 % éch. 14/01/2027 (a)(b)                     | 892 000                             | 584                              | 0,26                      |
| 4,750 % éch. 25/07/2029 (e)                          | 1 500                               | 405                              | 0,18                      | 8,250 % éch. 21/12/2026                                          | ZAR 36 000                          | 2 210                            | 0,99                      | 20,607 % éch. 21/01/2027 (a)(b)                     | 857 200                             | 558                              | 0,25                      |
| 5,000 % éch. 25/01/2030 (e)                          | 7 700                               | 2 090                            | 0,94                      | 9,750 % éch. 21/01/2027                                          | BRL 750                             | 142                              | 0,06                      | 20,677 % éch. 28/01/2027 (a)(b)                     | 860 200                             | 558                              | 0,25                      |
| 5,000 % éch. 25/10/2034                              | 1 510                               | 399                              | 0,18                      | Société financière internationale                                |                                     |                                  |                           | 21,539 % éch. 21/07/2026 (a)(b)                     | 1 955 700                           | 1 407                            | 0,63                      |
| 5,000 % éch. 25/10/2035                              | 18 400                              | 4 823                            | 2,16                      | 10,000 % éch. 22/01/2030                                         | COP 2 500 000                       | 685                              | 0,31                      | 21,645 % éch. 04/08/2026 (a)(b)                     | 1 061 000                           | 756                              | 0,34                      |
| 5,000 % éch. 25/04/2037                              | 4 900                               | 1 274                            | 0,57                      | Total Supranationales                                            |                                     | 17 747                           | 7,95                      |                                                     |                                     | 4 166                            | 1,87                      |
| 5,750 % éch. 25/04/2029 (e)                          | 31 800                              | 8 806                            | 3,94                      | <b>THAÏLANDE</b>                                                 |                                     |                                  |                           | <b>Total des Instruments à court terme</b>          |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/10/2033 (e)                          | 9 190                               | 2 597                            | 1,16                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>Total des Valeurs mobilières</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Total Pologne                                        |                                     | 23 912                           | 10,71                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | \$ 228 930                       | 102,50                    |
| <b>QATAR</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement thaïlandais</b>     |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch. 17/06/2040                                          | THB 123 860                         | 3 825                            | 1,71                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement qatari     |                                     |                                  |                           | 2,980 % éch. 17/06/2045                                          | 37 943                              | 1 146                            | 0,52                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                              | \$ 400                              | 402                              | 0,18                      | 3,450 % éch. 17/06/2043                                          | 3 452                               | 112                              | 0,05                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ROUMANIE</b>                                      |                                     |                                  |                           | Total Thaïlande                                                  |                                     | 5 083                            | 2,28                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>TURQUIE</b>                                                   |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement roumain    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 28/04/2036                              | RON 7 215                           | 1 304                            | 0,58                      | <b>Obligation internationale du gouvernement turc</b>            |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 11/10/2034                              | 500                                 | 96                               | 0,04                      | 40,760 % éch. 19/08/2026                                         | TRY 1 300                           | 28                               | 0,01                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 25/04/2035                              | 2 600                               | 571                              | 0,26                      | 40,760 % éch. 17/05/2028                                         | 55 900                              | 1 210                            | 0,54                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,850 % éch. 29/07/2030                              | 700                                 | 154                              | 0,07                      | Total Turquie                                                    |                                     | 1 238                            | 0,55                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,100 % éch. 31/07/2034                              | 5 100                               | 1 143                            | 0,51                      | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                       |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,350 % éch. 28/04/2031                              | 3 200                               | 720                              | 0,32                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,650 % éch. 27/07/2031                              | 2 400                               | 548                              | 0,25                      | <b>First Abu Dhabi Bank PJSC</b>                                 |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,900 % éch. 24/02/2038                              | 900                                 | 212                              | 0,10                      | 4,789 % éch. 03/06/2031                                          | \$ 400                              | 400                              | 0,18                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Total Roumanie                                       |                                     | 4 748                            | 2,13                      | <b>ROYAUME-UNI</b>                                               |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ICBC Standard Bank PLC</b>                                    |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 20,000 % éch. 18/09/2029 ^                                       | UZS 10 472 000                      | 871                              | 0,39                      |                                                     |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                             | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                   | 3,630 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 7 800             | Billets du Trésor américain 3,875 % échéance 31/07/2027 | \$ (7 954)       | \$ 7 800                                 | \$ 7 801                                                           | 3,49                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                         | \$ (7 954)       | \$ 7 800                                 | \$ 7 801                                                           | 3,49                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                     | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre       | Court | 09/2026           | 2                  | \$ (3)                            | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre | Long  | 09/2026           | 6                  | 4                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre  | Long  | 09/2026           | 4                  | 7                                 | 0,00                |
|                                                                                 |       |                   |                    | \$ 8                              | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé      |       |                   |                    | \$ 8                              | 0,00                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2028      | £ 230             | \$ (2)                            | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2028      | 300               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,500     | 16/09/2036      | INR 239 240       | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 17/06/2027      | ¥ 5 130 000       | (13)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 17/12/2027      | 2 340 000         | 39                                | 0,02                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/03/2028      | 2 335 000         | (19)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 17/06/2028      | 420 000           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2028      | 2 391 000         | (27)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,403     | 30/12/2026      | SGD 23 530        | (37)                              | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      | 7 330             | (31)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 16/09/2028      | THB 112 500       | (5)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 16/09/2031      | 13 160            | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 16/09/2031      | 140 730           | 50                                | 0,02                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 16/09/2031      | 19 490            | 7                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 16/09/2036      | 24 900            | 5                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      | \$ 51 200         | (45)                              | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 16/09/2028      | 6 300             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2030      | 4 800             | (50)                              | (0,02)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2034      | 400               | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2034      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/12/2028      | 920               | (17)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2033      | 25                | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/12/2054      | 800               | (80)                              | (0,04)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2030      | 8 580             | 190                               | 0,09                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 7 200             | (171)                             | (0,08)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2031      | 9 600             | 229                               | 0,10                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2034      | 3 390             | (73)                              | (0,03)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 1 600             | (96)                              | (0,04)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035      | 1 600             | (19)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 11 100            | (64)                              | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 2 700             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2045      | 500               | 20                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 2 400             | 85                                | 0,04                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 1 000             | (24)                              | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2056      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,086     | 13/01/2055      | 2 200             | (57)                              | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 9,795     | 04/01/2027      | BRL 8 500         | (143)                             | (0,06)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 9,815     | 04/01/2027      | 5 800             | (95)                              | (0,04)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 9,832     | 04/01/2027      | 5 200             | (85)                              | (0,04)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 9,840     | 04/01/2027      | 6 600             | (110)                             | (0,05)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 9,842     | 04/01/2027      | 12 100            | (197)                             | (0,09)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 10,076    | 04/01/2027      | 1 100             | (20)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 10,225    | 04/01/2027      | 4 100             | (58)                              | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 10,235    | 04/01/2027      | 4 100             | (58)                              | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 10,386    | 02/01/2029      | 100               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 10,512    | 04/01/2027      | 60 300            | (930)                             | (0,42)              |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 10,565 %  | 04/01/2027      | BRL 1 400         | \$ (18)                           | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 10,602    | 04/01/2027      | 900               | (14)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 10,671    | 04/01/2027      | 13 400            | 162                               | 0,07                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 10,768    | 04/01/2027      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 10,872    | 04/01/2027      | 500               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 10,880    | 04/01/2027      | 18 700            | 208                               | 0,09                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 10,943    | 04/01/2027      | 11 500            | 125                               | 0,06                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 10,980    | 04/01/2027      | 9 400             | (100)                             | (0,04)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 10,985    | 02/01/2029      | 5 600             | (63)                              | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 11,064    | 04/01/2027      | 400               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,133    | 04/01/2027      | 10 200            | 103                               | 0,05                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 11,169    | 04/01/2027      | 520               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,510    | 04/01/2027      | 6 800             | 58                                | 0,03                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,513    | 04/01/2027      | 7 000             | 61                                | 0,03                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,560    | 04/01/2027      | 5 700             | 49                                | 0,02                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,590    | 03/01/2028      | 3 600             | 40                                | 0,02                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,600    | 04/01/2027      | 12 000            | 97                                | 0,04                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,603    | 04/01/2027      | 8 400             | 68                                | 0,03                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 11,695    | 03/01/2028      | 29 200            | (306)                             | (0,14)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 11,736    | 04/01/2027      | 7 000             | 57                                | 0,03                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 11,928    | 02/01/2029      | 4 800             | (52)                              | (0,02)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 11,940    | 03/01/2033      | 14 300            | (128)                             | (0,06)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 12,243    | 02/01/2029      | 5 400             | 52                                | 0,02                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 12,255    | 02/01/2029      | 2 700             | 26                                | 0,01                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 12,320    | 02/01/2029      | 10 100            | (93)                              | (0,04)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 12,716    | 02/01/2029      | 16 500            | (94)                              | (0,04)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 12,808    | 02/01/2029      | 16 000            | 85                                | 0,04                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 12,867    | 02/01/2031      | 16 200            | (99)                              | (0,04)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 12,985    | 02/01/2031      | 4 100             | (23)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,041    | 02/01/2031      | 11 800            | (60)                              | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,055    | 02/01/2029      | 22 200            | (110)                             | (0,05)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,056    | 02/01/2029      | 19 900            | (95)                              | (0,04)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,156    | 02/01/2031      | 1 700             | 7                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,235    | 02/01/2031      | 15 200            | (57)                              | (0,03)              |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,235    | 02/01/2035      | 12 500            | (51)                              | (0,02)              |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,245    | 02/01/2031      | 2 500             | (10)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,250    | 02/01/2031      | 1 300             | (4)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,255    | 02/01/2031      | 2 500             | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,270    | 02/01/2029      | 10 300            | 44                                | 0,02                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,289    | 02/01/2029      | 23 900            | 76                                | 0,03                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,291    | 02/01/2029      | 13 700            | (61)                              | (0,03)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,296    | 02/01/2031      | 11 400            | 41                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | CDI BRL à un an         | 13,310    | 02/01/2031      | 12 600            | 44                                | 0,02                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,320    | 02/01/2029      | 1 500             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | CDI BRL à un an         | 13,340    | 02/01/2029      | 8 600             | 22                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,350    | 02/01/2031      | 1 900             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,357    | 02/01/2029      | 19 200            | 64                                | 0,03                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,405    | 02/01/2029      | 12 600            | (47)                              | (0,02)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,425    | 02/01/2029      | 3 900             | (14)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,430    | 02/01/2029      | 7 500             | (27)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | CDI BRL à un an         | 13,435    | 02/01/2029      | 1 900             | 4                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,470    | 02/01/2031      | 3 000             | (10)                              | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,500    | 02/01/2029      | 9 700             | (34)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,518    | 02/01/2029      | 6 600             | 22                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,520    | 02/01/2031      | 6 100             | (15)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,545    | 02/01/2029      | 6 500             | 21                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      | 1 600             | (4)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      | 5 500             | (12)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,564    | 02/01/2031      | 6 300             | (14)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,575    | 02/01/2031      | 6 700             | (31)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,580    | 02/01/2031      | 2 500             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,589    | 02/01/2029      | 13 000            | 38                                | 0,02                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,605    | 02/01/2031      | 1 400             | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | CDI BRL à un an         | 13,670    | 02/01/2031      | 800               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,680    | 02/01/2029      | 10 600            | (27)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,698    | 02/01/2031      | 3 100             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,700    | 02/01/2031      | 4 000             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,790    | 02/01/2031      | 12 000            | (11)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,844    | 02/01/2029      | 7 100             | 13                                | 0,01                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,882    | 02/01/2031      | 5 400             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 13,890    | 02/01/2031      | 7 400             | 4                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,927    | 04/01/2027      | 45 500            | (72)                              | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,979    | 02/01/2031      | 17 400            | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 13,988    | 02/01/2029      | 20 000            | (23)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 14,020    | 04/01/2027      | 15 100            | 20                                | 0,01                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 14,035    | 02/01/2031      | 3 000             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 14,140    | 02/01/2029      | 5 200             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 14,140    | 02/01/2031      | 3 600             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 14,185    | 02/01/2029      | 10 500            | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an         | 14,213    | 02/01/2029      | 3 200             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 14,245    | 02/01/2029      | 8 600             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an         | 14,247    | 02/01/2031      | 3 800             | (4)                               | 0,00                |



## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,334 %  | 02/01/2031      | BRL 6 900         | \$ (11)                           | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,370    | 02/01/2029      | 5 400             | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,375    | 02/01/2031      | 700               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,505    | 02/01/2031      | 9 900             | (23)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,514    | 02/01/2031      | 9 600             | (23)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,524    | 02/01/2029      | 9 900             | (15)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,570    | 02/01/2029      | 4 600             | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,620    | 02/01/2029      | 14 000            | 27                                | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,695    | 02/01/2029      | 13 600            | 30                                | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,995    | 04/01/2027      | 10 500            | 16                                | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 15,036    | 02/01/2029      | 6 600             | 27                                | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 15,065    | 02/01/2029      | 3 300             | 15                                | 0,01                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 17/06/2028      | CAD 17 900        | (43)                              | (0,02)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 17/06/2036      | 4 000             | 36                                | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,110     | 02/10/2029      | COP 4 238 000     | (124)                             | (0,06)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,410     | 09/08/2028      | 1 732 300         | 36                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,410     | 30/09/2031      | 2 986 800         | 56                                | 0,03                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,520     | 13/08/2031      | 1 135 300         | 35                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,540     | 09/08/2031      | 1 700 000         | 52                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,580     | 09/08/2031      | 1 677 900         | 50                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,650     | 12/08/2031      | 996 000           | 29                                | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,705     | 26/03/2031      | 906 800           | 22                                | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,715     | 18/09/2030      | 83 500            | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,770     | 18/07/2029      | 6 466 900         | (147)                             | (0,07)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,800     | 30/06/2032      | 44 500            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,805     | 22/10/2029      | 6 144 100         | (115)                             | (0,05)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,900     | 28/04/2028      | 1 343 700         | 23                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,950     | 18/06/2028      | 6 185 800         | (101)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,970     | 28/04/2028      | 2 273 520         | 38                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,990     | 25/11/2034      | 754 400           | 22                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,150     | 19/03/2027      | 2 249 980         | (16)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,150     | 28/04/2028      | 1 913 000         | 30                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,152     | 25/04/2029      | 1 674 070         | (32)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,200     | 18/06/2030      | 4 030 100         | 81                                | 0,04                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,215     | 14/11/2028      | 1 082 000         | 26                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,342     | 17/09/2027      | 5 771 000         | (61)                              | (0,03)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,350     | 18/06/2030      | 2 837 200         | 51                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,360     | 17/09/2028      | 11 258 600        | 168                               | 0,08                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,400     | 17/09/2028      | 4 475 100         | 66                                | 0,03                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,430     | 15/05/2030      | 1 034 800         | 19                                | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,498     | 16/05/2030      | 3 436 000         | 61                                | 0,03                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,598     | 17/09/2030      | 710 000           | (12)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,630     | 17/09/2030      | 1 685 400         | (27)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,710     | 17/09/2030      | 4 562 000         | (71)                              | (0,03)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,725     | 10/06/2030      | 509 000           | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,755     | 17/09/2030      | 839 600           | (13)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,770     | 10/06/2030      | 1 528 000         | (23)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,800     | 18/06/2030      | 3 461 000         | 50                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,933     | 22/08/2029      | 3 140 600         | 41                                | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,980     | 17/12/2030      | 1 632 000         | 21                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,110     | 17/09/2035      | 1 818 900         | (27)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,155     | 17/09/2035      | 4 618 900         | (64)                              | (0,03)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,300     | 17/12/2030      | 1 203 000         | (12)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,300     | 26/03/2031      | 122 840           | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,329     | 17/12/2035      | 1 369 000         | 15                                | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,410     | 26/03/2031      | 123 400           | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,500     | 19/10/2033      | 220 600           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,525     | 18/06/2035      | 1 238 000         | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,655     | 24/01/2035      | 372 000           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,820     | 24/01/2035      | 1 373 500         | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,930     | 07/03/2033      | 34 420            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,700    | 17/06/2031      | 248 900           | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,710    | 17/06/2031      | 242 500           | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,720    | 18/03/2035      | 2 120 700         | (26)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,720    | 05/06/2036      | 492 200           | 7                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,720    | 09/06/2036      | 2 367 000         | 32                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,730    | 17/06/2031      | 247 900           | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,740    | 17/06/2031      | 269 400           | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,745    | 17/06/2031      | 495 700           | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,750    | 18/03/2031      | 761 800           | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,755    | 05/06/2036      | 488 100           | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,770    | 17/06/2031      | 495 700           | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,776    | 18/03/2031      | 3 419 000         | (21)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,200    | 17/06/2029      | 371 800           | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,210    | 17/06/2029      | 382 500           | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,250    | 17/06/2028      | 2 273 200         | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,425    | 17/06/2028      | 528 000           | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,450    | 17/06/2028      | 1 643 500         | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,500    | 17/06/2031      | 1 750 500         | 32                                | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,550    | 17/06/2028      | 1 578 700         | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,634    | 17/06/2028      | 3 380 700         | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,645    | 17/06/2031      | 1 729 000         | (28)                              | (0,01)              |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable      | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,700 %  | 17/06/2031      | COP | 1 051 000         | \$ (18)                           | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,720    | 17/06/2031      |     | 996 000           | (17)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,730    | 17/06/2031      |     | 1 017 000         | (18)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,870    | 17/06/2031      |     | 1 480 000         | (28)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,885    | 17/06/2031      |     | 2 974 000         | (57)                              | (0,03)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,910    | 17/06/2031      |     | 1 480 000         | (29)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,925    | 17/06/2033      |     | 1 754 000         | (48)                              | (0,02)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,930    | 17/06/2033      |     | 981 000           | (27)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,000    | 17/06/2027      |     | 12 393 800        | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,170    | 18/03/2029      |     | 1 493 000         | (15)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,220    | 17/06/2027      |     | 1 050 700         | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,230    | 17/06/2027      |     | 1 050 700         | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,250    | 17/06/2027      |     | 2 101 400         | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,330    | 18/03/2028      |     | 2 125 000         | (11)                              | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,340    | 17/06/2027      |     | 1 975 400         | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | KORIBOR KRW à 3 mois         | 3,500     | 16/09/2036      | KRW | 5 598 600         | (32)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | KORIBOR KRW à 3 mois         | 3,750     | 16/09/2028      |     | 23 665 600        | 47                                | 0,02                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | KLIBOR MYR à 3 mois          | 3,500     | 16/09/2028      | MYR | 28 470            | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | KLIBOR MYR à 3 mois          | 3,500     | 16/09/2031      |     | 690               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | STIBOR SEK à 3 mois          | 2,021     | 07/10/2029      | SEK | 27 400            | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois          | 2,298     | 07/10/2029      |     | 27 200            | 26                                | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,510     | 26/05/2031      | ZAR | 35 400            | (12)                              | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,522     | 29/01/2031      |     | 1 900             | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,610     | 28/04/2031      |     | 5 100             | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,640     | 02/04/2031      |     | 5 100             | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,673     | 14/04/2031      |     | 4 900             | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,715     | 26/02/2031      |     | 5 700             | 11                                | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,745     | 06/03/2028      |     | 32 200            | 18                                | 0,01                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,770     | 10/03/2028      |     | 127 700           | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,770     | 12/11/2030      |     | 6 400             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,780     | 06/03/2028      |     | 19 200            | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,815     | 08/12/2030      |     | 1 700             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,860     | 15/10/2030      |     | 2 800             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,880     | 17/09/2030      |     | 7 100             | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,885     | 04/02/2031      |     | 6 000             | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,910     | 30/10/2030      |     | 1 900             | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,920     | 06/03/2031      |     | 7 900             | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,040     | 22/09/2030      |     | 16 107            | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,070     | 04/12/2030      |     | 8 100             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,091     | 17/02/2036      |     | 8 200             | 12                                | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,155     | 26/11/2030      |     | 1 700             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,160     | 26/11/2030      |     | 11 800            | 10                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,180     | 04/12/2030      |     | 3 810             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,220     | 02/09/2030      |     | 14 800            | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,270     | 26/08/2030      |     | 16 200            | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,310     | 02/09/2030      |     | 12 700            | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,330     | 10/07/2030      |     | 12 400            | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,360     | 09/03/2031      |     | 3 300             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,370     | 26/08/2030      |     | 20 100            | (11)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,381     | 12/01/2036      |     | 1 800             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,410     | 02/10/2030      |     | 5 590             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,520     | 02/04/2031      |     | 66 200            | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,560     | 23/08/2029      |     | 19 000            | (19)                              | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,560     | 22/09/2030      |     | 4 820             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,570     | 27/05/2030      |     | 5 500             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,650     | 20/06/2030      |     | 16 633            | (31)                              | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,685     | 31/01/2030      |     | 21 900            | 18                                | 0,01                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,700     | 08/06/2028      |     | 22 600            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,730     | 12/03/2030      |     | 11 200            | 11                                | 0,01                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,770     | 19/11/2027      |     | 2 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,775     | 18/03/2030      |     | 13 000            | (12)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,780     | 20/11/2027      |     | 1 700             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,790     | 31/01/2030      |     | 10 300            | 11                                | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,810     | 27/03/2030      |     | 10 400            | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,810     | 20/06/2030      |     | 5 590             | 6                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,822     | 08/04/2036      |     | 6 400             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,860     | 18/06/2030      |     | 13 000            | 15                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,950     | 07/05/2036      |     | 2 300             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,020     | 28/02/2031      |     | 12 600            | 21                                | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,080     | 24/04/2036      |     | 36 800            | 28                                | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,140     | 16/11/2028      |     | 1 000             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,160     | 31/03/2032      |     | 6 000             | 12                                | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,175     | 31/03/2032      |     | 13 600            | 29                                | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,180     | 02/04/2036      |     | 6 300             | 13                                | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,210     | 21/12/2026      |     | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,355     | 31/01/2030      |     | 5 500             | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,410     | 10/11/2028      |     | 700               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,440     | 02/11/2028      |     | 6 300             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,599     | 05/06/2029      |     | 13 200            | (28)                              | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,735     | 31/01/2030      |     | 13 800            | 17                                | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,820     | 31/01/2030      |     | 64 370            | (92)                              | (0,04)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 10,150    | 18/05/2033      |     | 300               | 3                                 | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,490 %   | 01/10/2028      | CLP 224 000       | \$ 0                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,540     | 01/10/2028      | 243 100           | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,590     | 01/10/2029      | 495 000           | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,676     | 01/09/2030      | 46 000            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,690     | 18/06/2030      | 400 200           | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,710     | 01/10/2029      | 380 000           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,710     | 01/09/2030      | 1 120 000         | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,715     | 18/06/2030      | 419 200           | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,740     | 18/03/2029      | 440 000           | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,750     | 10/04/2030      | 1 042 700         | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,805     | 17/06/2031      | 502 200           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,855     | 18/12/2033      | 202 400           | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,890     | 01/10/2034      | 427 400           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,900     | 17/06/2031      | 1 612 500         | 14                                | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,960     | 19/03/2027      | 554 100           | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,970     | 18/06/2032      | 295 500           | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,000     | 19/07/2029      | 1 159 200         | 19                                | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,005     | 17/06/2031      | 855 000           | 12                                | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,030     | 20/03/2033      | 5 340             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,030     | 23/02/2034      | 504 300           | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,050     | 19/07/2029      | 304 800           | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,060     | 18/03/2031      | 317 000           | (6)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,070     | 24/06/2031      | 268 600           | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,120     | 18/06/2035      | 158 100           | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 18/06/2030      | 522 400           | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 17/06/2031      | 1 960 400         | (42)                              | (0,02)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,165     | 01/08/2029      | 401 210           | (9)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,180     | 18/06/2030      | 394 400           | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,190     | 17/06/2031      | 152 000           | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,200     | 13/06/2034      | 363 000           | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,210     | 01/03/2035      | 176 000           | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,230     | 17/11/2033      | 2 480 700         | (17)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,245     | 18/03/2036      | 155 000           | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 17/06/2031      | 52 200            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 13/05/2033      | 295 900           | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,260     | 17/11/2028      | 8 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,280     | 28/02/2030      | 1 473 300         | (16)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,285     | 19/03/2030      | 220 200           | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,306     | 17/06/2031      | 1 088 000         | (31)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,310     | 16/11/2028      | 5 600             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,320     | 16/11/2028      | 736 100           | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,360     | 26/04/2034      | 83 200            | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 16/11/2033      | 13 100            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 08/07/2034      | 224 000           | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,440     | 28/02/2035      | 276 000           | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,450     | 28/06/2034      | 441 000           | (18)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,500     | 13/11/2028      | 303 700           | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,500     | 19/03/2030      | 125 400           | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,560     | 01/04/2033      | 192 000           | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,631     | 23/08/2028      | 15 700            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,660     | 01/04/2033      | 250 000           | 14                                | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,690     | 01/09/2030      | 1 800             | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,750     | 13/05/2034      | 302 900           | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,770     | 21/11/2027      | 28 300            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,780     | 03/10/2028      | 14 200            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,790     | 06/10/2033      | 15 000            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,855     | 05/10/2033      | 33 000            | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,870     | 11/10/2033      | 14 200            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,920     | 02/10/2028      | 18 000            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,940     | 20/10/2033      | 6 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,990     | 20/10/2033      | 60 410            | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,000     | 02/10/2028      | 35 000            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,070     | 28/02/2028      | 55 800            | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,146     | 30/10/2032      | 97 000            | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,235     | 26/10/2033      | 25 300            | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 1,025     | 29/07/2030      | 68 200            | 18                                | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,130     | 09/04/2030      | 36 800            | 50                                | 0,02                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,145     | 09/04/2030      | 13 900            | (16)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,290     | 30/04/2030      | 6 500             | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,315     | 06/05/2030      | 3 200             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,325     | 06/05/2030      | 23 000            | 30                                | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,363     | 29/05/2030      | 24 600            | (31)                              | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,365     | 28/11/2029      | 20 800            | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,405     | 14/05/2030      | 27 100            | 32                                | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,445     | 01/08/2034      | 49 700            | (18)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,480     | 15/07/2029      | 21 400            | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,485     | 16/05/2030      | 8 200             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,513     | 30/09/2030      | 6 700             | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,530     | 15/07/2029      | 7 500             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,550     | 24/01/2030      | 6 900             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,554     | 11/06/2030      | 32 200            | 27                                | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,575     | 03/07/2030      | 82 900            | (57)                              | (0,03)              |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,580 %   | 25/10/2029      | CZK 23 000        | \$ 3                              | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,645     | 01/02/2029      | 42 100            | (20)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,670     | 09/02/2031      | 13 500            | (12)                              | (0,01)              |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,680     | 29/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,705     | 12/08/2030      | 1 660             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,708     | 13/08/2030      | 28 900            | 7                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,720     | 12/02/2031      | 17 300            | (14)                              | (0,01)              |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,735     | 05/08/2030      | 18 000            | 5                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,736     | 12/08/2030      | 40 800            | 12                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,745     | 12/01/2031      | 9 420             | (6)                               | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,761     | 20/10/2030      | 11 600            | 3                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,765     | 09/01/2029      | 7 600             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,767     | 17/10/2030      | 11 100            | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,773     | 10/04/2031      | 16 900            | 11                                | 0,01                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,777     | 15/10/2030      | 4 940             | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,845     | 05/03/2031      | 5 100             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,850     | 03/03/2036      | 9 800             | (12)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,920     | 09/02/2031      | 5 400             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,930     | 22/05/2036      | 9 800             | 2                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,950     | 10/04/2031      | 31 900            | (9)                               | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,963     | 27/11/2030      | 4 300             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,970     | 12/02/2031      | 6 900             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,980     | 04/12/2030      | 7 550             | 7                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,981     | 01/12/2030      | 14 600            | 11                                | 0,01                |
| À recevoir                        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,999     | 14/11/2030      | 7 600             | (6)                               | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,000     | 17/06/2036      | 46 200            | 49                                | 0,02                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,049     | 12/12/2030      | 4 180             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,071     | 22/04/2031      | 1 600             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,090     | 29/06/2031      | 32 400            | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,100     | 30/06/2031      | 18 300            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,130     | 20/07/2031      | 74 300            | (47)                              | (0,02)              |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 18/04/2029      | 15 300            | (15)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 27/04/2031      | 31 400            | (11)                              | (0,01)              |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,335     | 16/06/2031      | 15 500            | 8                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,364     | 25/06/2036      | 19 800            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,388     | 15/11/2028      | 43 500            | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,395     | 10/03/2036      | 3 900             | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,485     | 02/12/2035      | 7 000             | 2                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,523     | 01/12/2035      | 38 100            | 15                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,530     | 31/12/2035      | 4 200             | 2                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,560     | 23/11/2027      | 5 000             | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,668     | 16/06/2036      | 5 600             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,700     | 23/03/2036      | 1 300             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,720     | 02/04/2036      | 2 000             | (11)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | € 400             | (1)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 1 070             | (25)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 170               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 1,760     | 21/01/2030      | HUF 554 700       | (68)                              | (0,03)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 2,680     | 29/06/2031      | 327 500           | 93                                | 0,04                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 4,670     | 24/10/2035      | 67 000            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | BBR HUF à 6 mois        | 4,675     | 24/10/2035      | 44 600            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 4,685     | 24/10/2035      | 75 100            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 4,690     | 24/11/2032      | 51 300            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 5,750     | 17/06/2031      | 185 400           | 17                                | 0,01                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 5,855     | 17/07/2029      | 255 700           | (42)                              | (0,02)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 5,875     | 09/05/2030      | 315 300           | 32                                | 0,01                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,070     | 15/04/2036      | 371 200           | 71                                | 0,03                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,090     | 21/10/2029      | 1 070 800         | 261                               | 0,12                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,110     | 30/12/2030      | 30 300            | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,190     | 18/11/2030      | 301 300           | (89)                              | (0,04)              |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,210     | 26/06/2030      | 1 028 200         | (155)                             | (0,07)              |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,250     | 09/04/2030      | 141 100           | (20)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,265     | 28/04/2032      | 133 400           | (31)                              | (0,01)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,270     | 16/06/2030      | 290 300           | 45                                | 0,02                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,299     | 10/06/2029      | 120 400           | (13)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,350     | 14/11/2030      | 88 300            | (25)                              | (0,01)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,363     | 31/01/2030      | 109 000           | 16                                | 0,01                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,392     | 11/03/2030      | 265 100           | 41                                | 0,02                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,430     | 04/02/2030      | 237 800           | 37                                | 0,02                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,435     | 21/11/2030      | 593 000           | (176)                             | (0,08)              |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,439     | 24/11/2030      | 179 900           | (54)                              | (0,02)              |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,450     | 06/06/2029      | 97 200            | (12)                              | (0,01)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,511     | 05/02/2030      | 591 800           | 94                                | 0,04                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 6,580     | 16/05/2035      | 23 900            | (10)                              | 0,00                |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 6,650     | 13/03/2030      | 115 600           | 21                                | 0,01                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 7,610     | 03/11/2028      | 262 940           | (47)                              | (0,02)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 7,840     | 07/02/2033      | 174 700           | 62                                | 0,03                |
| À recevoir                        | BBR HUF à 6 mois        | 8,740     | 28/04/2028      | 1 817 400         | (86)                              | (0,04)              |
| À payer                           | BBR HUF à 6 mois        | 10,570    | 22/08/2027      | 4 800             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 0,925     | 16/10/2030      | 800               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,710     | 25/07/2030      | 8 800             | 18                                | 0,01                |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,750 %   | 17/06/2031      | PLN | 22 000            | \$ 140                            | 0,06                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,962     | 06/05/2030      |     | 6 000             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,015     | 17/04/2030      |     | 1 400             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,019     | 18/04/2030      |     | 1 300             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,048     | 18/04/2030      |     | 700               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,049     | 18/04/2030      |     | 1 000             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,065     | 18/04/2030      |     | 600               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,065     | 24/11/2030      |     | 2 980             | (13)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,125     | 20/05/2036      |     | 700               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,135     | 20/05/2036      |     | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,136     | 25/07/2029      |     | 13 000            | (112)                             | (0,05)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,161     | 03/03/2036      |     | 1 100             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,180     | 22/05/2036      |     | 6 300             | (38)                              | (0,02)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,195     | 29/09/2030      |     | 900               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,200     | 13/05/2036      |     | 740               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,207     | 30/01/2036      |     | 1 100             | (18)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,230     | 15/04/2036      |     | 600               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,235     | 27/11/2035      |     | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,275     | 02/03/2036      |     | 600               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,285     | 19/12/2035      |     | 800               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,313     | 25/07/2029      |     | 1 500             | (15)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,325     | 20/05/2036      |     | 1 600             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,340     | 12/12/2035      |     | 1 600             | (13)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,348     | 05/03/2036      |     | 900               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,349     | 06/03/2036      |     | 600               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,356     | 17/10/2035      |     | 780               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,360     | 25/07/2028      |     | 2 900             | (26)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,370     | 25/11/2035      |     | 400               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,370     | 05/03/2036      |     | 800               | (3)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,380     | 22/05/2036      |     | 1 700             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,385     | 06/02/2036      |     | 700               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,388     | 09/08/2029      |     | 3 000             | (31)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,393     | 16/10/2035      |     | 1 350             | (13)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,400     | 13/05/2036      |     | 1 600             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,415     | 12/08/2029      |     | 2 700             | (29)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,430     | 10/11/2035      |     | 900               | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,434     | 03/11/2035      |     | 500               | (5)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,440     | 19/09/2035      |     | 6 000             | 42                                | 0,02                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,450     | 24/02/2036      |     | 600               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,463     | 09/03/2036      |     | 600               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,475     | 26/11/2035      |     | 1 700             | (12)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,480     | 13/04/2036      |     | 1 400             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,520     | 20/04/2036      |     | 1 300             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,560     | 06/11/2028      |     | 9 700             | (120)                             | (0,05)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,560     | 02/09/2029      |     | 2 500             | 33                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,574     | 10/03/2036      |     | 500               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,650     | 28/04/2036      |     | 11 600            | (103)                             | (0,05)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,665     | 27/04/2036      |     | 600               | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,680     | 25/04/2029      |     | 24 000            | (98)                              | (0,04)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 02/12/2035      |     | 1 300             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 10/03/2036      |     | 400               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 29/04/2036      |     | 900               | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,710     | 25/05/2027      |     | 600               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,710     | 29/04/2036      |     | 600               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,723     | 01/12/2035      |     | 5 070             | (9)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,730     | 16/02/2029      |     | 700               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,730     | 31/12/2035      |     | 700               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,735     | 09/10/2028      |     | 200               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,740     | 25/10/2033      |     | 100               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,750     | 02/08/2029      |     | 1 600             | 22                                | 0,01                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,760     | 25/10/2033      |     | 1 900             | 34                                | 0,02                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,789     | 28/05/2036      |     | 12 800            | (128)                             | (0,06)              |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,794     | 25/10/2029      |     | 2 300             | (33)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,810     | 16/02/2029      |     | 800               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,828     | 17/03/2036      |     | 4 800             | (53)                              | (0,02)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,845     | 02/04/2036      |     | 3 300             | 44                                | 0,02                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,850     | 25/10/2033      |     | 1 500             | 29                                | 0,01                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,855     | 10/02/2030      |     | 5 000             | 43                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,860     | 11/03/2036      |     | 600               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,910     | 25/07/2027      |     | 170               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,923     | 22/03/2029      |     | 7 300             | 61                                | 0,03                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,930     | 25/07/2029      |     | 1 200             | (19)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,960     | 16/06/2036      |     | 1 000             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,970     | 21/03/2029      |     | 2 500             | 20                                | 0,01                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,970     | 25/10/2033      |     | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,000     | 25/04/2029      |     | 1 200             | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,010     | 25/07/2029      |     | 1 100             | (18)                              | (0,01)              |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,020     | 21/03/2029      |     | 700               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,055     | 25/10/2033      |     | 1 800             | 42                                | 0,02                |
| À recevoir                        | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,060     | 25/04/2032      |     | 3 020             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,155     | 25/10/2034      |     | 900               | 23                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,200     | 23/03/2036      |     | 200               | 1                                 | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(1)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,230 %   | 02/04/2036      | PLN 300           | \$ 2                              | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,295     | 25/01/2028      | 15 750            | (6)                               | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,430     | 16/03/2028      | 54 600            | 129                               | 0,06                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 6,880     | 02/03/2028      | 24 400            | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 6,882     | 02/03/2028      | 34 600            | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      | 214 400           | 27                                | 0,01                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,230     | 14/03/2029      | 7 900             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,350     | 31/01/2031      | 6 500             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,375     | 21/11/2030      | 3 000             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,430     | 02/03/2028      | 7 800             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,450     | 13/09/2028      | 27 800            | (9)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,460     | 27/08/2030      | 5 500             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,480     | 11/06/2031      | 11 200            | 5                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,495     | 04/02/2031      | 5 900             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,520     | 11/09/2030      | 15 600            | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,520     | 16/04/2031      | 11 300            | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,545     | 12/03/2031      | 2 600             | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 02/03/2028      | 41 000            | (20)                              | (0,01)              |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 29/01/2031      | 5 600             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 30/01/2031      | 7 700             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 02/05/2031      | 5 900             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,555     | 24/01/2031      | 7 800             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,560     | 02/03/2028      | 19 100            | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,580     | 02/03/2028      | 15 300            | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,582     | 02/04/2030      | 20 300            | 3                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,600     | 04/04/2031      | 5 900             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,610     | 20/09/2030      | 17 500            | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,620     | 18/04/2031      | 5 600             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,623     | 12/03/2031      | 1 000             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,645     | 24/04/2031      | 7 700             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,650     | 18/04/2031      | 13 700            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,660     | 18/04/2031      | 12 300            | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,670     | 04/04/2031      | 4 200             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIIE MXN à 28 jours     | 7,681     | 05/03/2031      | 39 300            | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,685     | 07/04/2031      | 13 800            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,700     | 24/12/2030      | 6 750             | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,710     | 12/03/2031      | 3 300             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,720     | 01/04/2030      | 7 400             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,735     | 11/09/2030      | 3 800             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,740     | 20/09/2030      | 7 200             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,748     | 02/04/2030      | 4 300             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 01/04/2030      | 1 100             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 12/03/2031      | 4 000             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 11/06/2031      | 32 200            | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,753     | 16/04/2030      | 25 100            | 12                                | 0,01                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,760     | 01/03/2029      | 16 600            | 11                                | 0,01                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,763     | 11/06/2031      | 2 200             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,771     | 12/03/2031      | 13 100            | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,775     | 01/04/2030      | 10 400            | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,775     | 12/06/2030      | 14 200            | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,790     | 31/05/2029      | 19 400            | 14                                | 0,01                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,790     | 01/04/2030      | 4 500             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,790     | 12/06/2030      | 23 500            | (12)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,800     | 12/06/2030      | 18 600            | (10)                              | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,820     | 31/05/2029      | 20 100            | 15                                | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,820     | 02/05/2031      | 12 200            | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,825     | 31/05/2029      | 19 200            | 14                                | 0,01                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,936     | 12/06/2030      | 19 600            | (15)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,990     | 31/05/2029      | 59 400            | (48)                              | (0,02)              |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      | 2 100             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,071     | 05/09/2035      | 10 800            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,075     | 17/03/2027      | 28 500            | 18                                | 0,01                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,150     | 04/06/2036      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,170     | 26/03/2031      | 16 100            | 19                                | 0,01                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,215     | 04/06/2036      | 58 400            | (23)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,250     | 01/03/2029      | 9 000             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,255     | 11/06/2031      | 5 100             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,267     | 28/02/2030      | 59 500            | (85)                              | (0,04)              |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,270     | 07/03/2035      | 3 400             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,280     | 01/03/2029      | 1 200             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,285     | 06/06/2035      | 8 400             | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,290     | 27/02/2032      | 5 100             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,330     | 01/03/2029      | 1 300             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,340     | 11/06/2031      | 7 300             | 12                                | 0,01                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,360     | 13/03/2030      | 1 900             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,365     | 28/03/2035      | 3 700             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,480     | 13/03/2030      | 4 400             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,485     | 31/05/2029      | 21 700            | (14)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,495     | 31/05/2029      | 38 900            | (70)                              | (0,03)              |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 13/03/2030      | 28 700            | 32                                | 0,01                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 04/06/2036      | 2 900             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,515     | 22/02/2035      | 12 000            | (21)                              | (0,01)              |



## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,545 %   | 23/11/2034      | MXN 4 300         | \$ 8                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,595     | 13/03/2030      | 29 100            | (61)                              | (0,03)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,620     | 05/12/2029      | 11 900            | 24                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,640     | 07/03/2035      | 7 200             | (16)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,650     | 31/01/2030      | 3 400             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,655     | 07/03/2035      | 7 600             | (17)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,665     | 11/12/2029      | 16 400            | (36)                              | (0,02)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,740     | 07/03/2035      | 2 000             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,800     | 12/12/2029      | 25 400            | 50                                | 0,02                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,820     | 23/11/2034      | 13 600            | (39)                              | (0,02)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,855     | 09/02/2035      | 16 600            | (50)                              | (0,02)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,873     | 23/11/2034      | 6 100             | (19)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,950     | 17/12/2029      | 25 700            | (69)                              | (0,03)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,065     | 01/03/2029      | 27 600            | 69                                | 0,03                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 9,131     | 11/12/2034      | 8 100             | (33)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 9,180     | 08/01/2030      | 8 400             | (27)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,295     | 28/12/2034      | 6 400             | 29                                | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,295     | 29/12/2034      | 14 400            | 65                                | 0,03                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,340     | 27/12/2034      | 14 300            | 67                                | 0,03                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,370     | 21/12/2034      | 26 700            | 129                               | 0,06                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (2 424)                        | (1,09)              |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (2 424)                        | (1,09)              |

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

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - EUR contre BRL hors cote | BRL 5,850       | 19/08/2026        | 1 825                            | \$ 27  | \$ 9         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 2 172                            | 107    | 206          | 0,09                |
| BPS          | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 3 214                            | 12     | 6            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 3 214                            | 7      | 11           | 0,01                |
| MYI          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 06/08/2026        | 836                              | 3      | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 156 | \$ 232       | 0,10                |

#### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | KLIBOR MYR à 3 mois     | À recevoir                       | 3,600 %         | 17/03/2027        | 10 800                           | \$ 22  | \$ 18        | 0,01                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | JIBAR ZAR à 3 mois      | À payer                          | 7,750           | 20/11/2026        | 67 950                           | 12     | 20           | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | PRIBOR CZK à 6 mois     | À payer                          | 4,550           | 19/11/2026        | 104 100                          | 16     | 25           | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | WIBOR PLN à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 09/12/2026        | 8 300                            | 7      | 16           | 0,01                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | JIBAR ZAR à 3 mois      | À payer                          | 7,750           | 19/11/2026        | 42 600                           | 9      | 12           | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 5,250           | 20/01/2028        | 3 300                            | 72     | 44           | 0,01                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 138 | \$ 135       | 0,06                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre BRL hors cote  | BRL 6,250       | 19/08/2026        | 1 825                            | \$ (28)  | \$ (11)      | (0,01)              |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 1 156                            | (15)     | (3)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 433                              | (5)      | (2)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre TRY hors cote  | TRY 53,100      | 07/08/2026        | 842                              | (15)     | (3)          | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre TRY hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 4 344                            | (108)    | (172)        | (0,08)              |
| BPS          | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 3 214                            | (17)     | (32)         | (0,01)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 143                              | (2)      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 913                              | (14)     | (8)          | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (204) | \$ (231)     | (0,10)              |

#### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,500 %         | 23/07/2026        | 3 200                            | \$ (1) | \$ (1)       | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,800           | 28/07/2026        | 3 900                            | (2)    | (3)          | 0,00                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,250           | 20/11/2026        | 135 900                          | (8)    | (16)         | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | PRIBOR CZK à 6 mois     | À recevoir                       | 3,930           | 16/07/2026        | 18 100                           | (5)    | (1)          | 0,00                |



| Contrepartie | Description                                              | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | PRIBOR CZK à 6 mois     | À recevoir                       | 4,050 %         | 19/11/2026        | 208 200                          | \$ (10) | \$ (21)      | (0,01)              |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | WIBOR PLN à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 09/12/2026        | 16 600                           | (4)     | (16)         | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,250           | 19/11/2026        | 85 200                           | (6)     | (10)         | 0,00                |
|              |                                                          |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (36) | \$ (68)      | (0,03)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000) %           | 20/12/2028      | \$ 200                           | \$ (4)                 | \$ 0                             | \$ (4)       | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000)             | 20/12/2029      | 100                              | (2)                    | 0                                | (2)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/12/2035      | 100                              | 1                      | (2)                              | (1)          | 0,00                |
|              |                                                    |                     |                 |                                  | \$ (5)                 | \$ (2)                           | \$ (7)       | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000 %              | 20/12/2026      | \$ 50                            | \$ 1                   | \$ 0                             | \$ 1         | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 50                               | 1                      | 0                                | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain   | 1,000                | 20/12/2027      | 300                              | 1                      | 2                                | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 50                               | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 40                               | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian   | 1,000                | 20/12/2030      | 100                              | (9)                    | 3                                | (6)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 67                               | 1                      | 0                                | 1            | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 186                              | 1                      | 3                                | 4            | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 95                               | (12)                   | 15                               | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien   | 1,000                | 20/12/2030      | 200                              | 3                      | 1                                | 4            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 100                              | 1                      | 3                                | 4            | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement équatorien | 5,000                | 20/06/2027      | 500                              | 17                     | 2                                | 19           | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 925                              | 8                      | 25                               | 33           | 0,02                |
|              | SoftBank Group Corp.                                 | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 86 100                         | (9)                    | 6                                | (3)          | 0,00                |
|              |                                                      |                      |                 |                                  | \$ 4                   | \$ 62                            | \$ 66        | 0,03                |

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

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

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

#### SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,598 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | IDR 9 908 310                        | \$ 580                                | \$ 10                  | \$ (19)                          | \$ (9)       | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,606 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 4 984 610                            | 293                                   | 4                      | (8)                              | (4)          | 0,00                |
| BPS          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,594 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 13 843 950                           | 809                                   | 12                     | (28)                             | (16)         | (0,01)              |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue |            | Montant notionnel de la devise livrée |            | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|------------|---------------------------------------|------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,683 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | \$                                   | 834        | IDR                                   | 15 241 360 | \$ (17)                | \$ 0                             | \$ (17)      | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,562 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 15/09/2028      | IDR                                  | 42 241 090 | \$                                    | 2 494      | 90                     | (21)                             | 69           | 0,02                |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,689 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      |                                      | 30 609 150 |                                       | 1 71       | 18                     | 5                                | 23           | 0,01                |
| GLM          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,690 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | \$                                   | 1 71       | IDR                                   | 31 51      | (44)                   | (5)                              | (49)         | (0,03)              |
|              | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,596 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | IDR                                  | 24 619 620 | \$                                    | 1 41       | 22                     | (46)                             | (24)         | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,700 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | \$                                   | 841        | IDR                                   | 15 11      | (3 )                   | (7)                              | (10)         | 0,00                |
| GST          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,585 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR PHP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      |                                      | 571        | PHP                                   | 35 390     | (2 )                   | (11)                             | (13)         | 0,00                |
| JPM          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,604 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | IDR                                  | 25 249 720 | \$                                    | 1 41       | 22                     | (45)                             | (23)         | (0,01)              |
| SCX          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,605 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      |                                      | 9 571 430  |                                       | 562        | 8                      | (17)                             | (9)          | 0,00                |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         |                 |                                      |            |                                       |            | \$ 120                 | \$ (202)                         | \$ (82)      | (0,04)              |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer <sup>(1)</sup>           | THOR THB composé-OIS à 1 jour | 1,750 %   | 16/09/2031      | THB 8 260         | \$ (2)                 | \$ 3                             | \$ 1         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MBC          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 4,240 %       | INR 15 310        | 23/09/2026      | \$ 0                   | \$ 2                             | \$ 2         | 0,00                |
|              | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 4,200         | 48 510            | 05/11/2026      | 0                      | 26                               | 26           | 0,01                |
| SCX          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 4,270         | 92 840            | 30/10/2026      | 0                      | 39                               | 39           | 0,02                |
|              |                    |                                                        |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ 67                            | \$ 67        | 0,03                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

|         | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|---------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| BOA     | 07/2026           | BRL             | 1 080     | \$ 208            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |        |
|         | 07/2026           | COP             | 675       | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|         | 07/2026           | DOP             | 31 828    | 541               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |        |
|         | 07/2026           | €               | 161       | 187               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
|         | 07/2026           | HUF             | 34 123    | 110               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|         | 07/2026           | PEN             | 3 991     | 1 161             | 8                  | (17)                  | (9)                                     | 0,00                |        |
|         | 07/2026           | \$              | 10        | ¥ 1 633           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|         | 07/2026           |                 | 231       | NOK 2 138         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | (0,01)              |        |
|         | 07/2026           |                 | 347       | RON 1 596         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|         | 07/2026           |                 | 1 459     | ZAR 24 000        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
|         | 08/2026           | DOP             | 20 077    | \$ 337            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
|         | 08/2026           | HKD             | 142       | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|         | 08/2026           | \$              | 208       | BRL 1 088         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|         | 08/2026           |                 | 257       | ZAR 4 642         | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,01                |        |
|         | 09/2026           | COP             | 2 380 273 | \$ 614            | 0                  | (64)                  | (64)                                    | (0,03)              |        |
|         | 09/2026           | KZT             | 28 349    | 56                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
|         | 09/2026           | MXN             | 7 067     | 402               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|         | 09/2026           | PHP             | 42 772    | 694               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
|         | 09/2026           | THB             | 19 877    | 613               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,01                |        |
|         | 09/2026           | \$              | 276       | IDR 5 009 433     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
|         | 09/2026           |                 | 118       | PEN 400           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
|         | 10/2026           | HUF             | 28 741    | € 78              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |        |
|         | 10/2026           | \$              | 0         | COP 691           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|         | 11/2026           |                 | 184       | PEN 632           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|         | 12/2026           | MYR             | 2 181     | \$ 539            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
|         | BPS               | 07/2026         | ARS       | 98 916            | 66                 | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         | BRL       | 6 582             | € 1 110            | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         |           | 3 470             | \$ 683             | 12                    | 0                                       | 12                  | 0,01   |
|         |                   | 07/2026         | €         | 913               | 1 036              | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         | HUF       | 576 107           | 1 852              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         | INR       | 167 845           | 1 771              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         | ¥         | 337 700           | 2 095              | 17                    | 0                                       | 17                  | 0,01   |
|         |                   | 07/2026         | \$        | 105               | ARS 172 307        | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,01   |
|         |                   | 07/2026         |           | 1 402             | BRL 7 243          | 9                     | (12)                                    | (3)                 | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         |           | 2 087             | CZK 43 429         | 0                     | (41)                                    | (41)                | (0,02) |
|         |                   | 07/2026         |           | 134               | € 117              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         |           | 1 606             | HUF 499 505        | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         |           | 1 774             | INR 168 445        | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         |           | 35                | ¥ 5 523            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|         |                   | 07/2026         |           | 1 065             | KRW 1 624 070      | 0                     | (16)                                    | (16)                | (0,01) |
| 07/2026 |                   |                 | 233       | KWD 71            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |        |
| 07/2026 |                   |                 | 2 407     | TWD 75 957        | 0                  | (24)                  | (24)                                    | (0,01)              |        |
| 07/2026 |                   | ZAR             | 3 244     | \$ 198            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
| 09/2026 |                   | COP             | 843 995   | 228               | 0                  | (12)                  | (12)                                    | (0,01)              |        |
| 09/2026 |                   | IDR             | 3 870 773 | 214               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026 |                   | INR             | 88 874    | 934               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 09/2026 |                   | THB             | 9 123     | 282               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |        |
| 09/2026 |                   | \$              | 228       | COP 831 320       | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |        |
| 09/2026 |                   |                 | 2 068     | IDR 36 794 227    | 4                  | (33)                  | (29)                                    | (0,01)              |        |
| 09/2026 |                   |                 | 4 079     | INR 390 417       | 19                 | (1)                   | 18                                      | 0,01                |        |
| 09/2026 |                   |                 | 1 144     | PEN 3 920         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
| 09/2026 |                   |                 | 1 979     | THB 63 820        | 0                  | (46)                  | (46)                                    | (0,02)              |        |
| 10/2026 |                   |                 | 28        | BRL 147           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
| 12/2026 |                   |                 | 214       | IDR 3 897 101     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 12/2026 |                   |                 | 364       | MYR 1 473         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |        |
| 06/2027 |                   |                 | 139       | KWD 42            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |        |
| 05/2029 |                   | KWD             | 610       | \$ 2 096          | 108                | 0                     | 108                                     | 0,05                |        |
| 07/2029 |                   |                 | 72        | 249               | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,01                |        |
| 05/2030 |                   |                 | 343       | 1 180             | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,03                |        |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|--------|
| BRC          | 08/2030              | KWD                | 46                   | \$ 154                | \$ 5                     | \$ 0                                          | 5                      | 0,00   |
|              | 01/2031              |                    | 164                  | 553                   | 16                       | 0                                             | 16                     | 0,01   |
|              | 06/2031              |                    | 245                  | 825                   | 22                       | 0                                             | 22                     | 0,01   |
|              | 07/2026              | COP                | 3 023 955            | 878                   | 7                        | 0                                             | 7                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 785                  | RON 4 127             | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | MYR                | 9 178                | \$ 2 231              | 0                        | (16)                                          | (16)                   | (0,01) |
|              | 07/2026              | NZD                | 70                   | 41                    | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | PEN                | 1 915                | 565                   | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | TRY                | 390                  | 8                     | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 796                  | COP 3 023 955         | 75                       | 0                                             | 75                     | 0,03   |
|              | 07/2026              |                    | 4 347                | MYR 17 793            | 21                       | (13)                                          | 8                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 2 168                | TRY 103 855           | 25                       | 0                                             | 25                     | 0,01   |
|              | 07/2026              | ZAR                | 17 380               | \$ 1 070              | 11                       | 0                                             | 11                     | 0,01   |
|              | 09/2026              | \$                 | 867                  | COP 3 023 955         | 0                        | (5)                                           | (5)                    | 0,00   |
|              | 09/2026              |                    | 2 240                | INR 215 635           | 23                       | 0                                             | 23                     | 0,01   |
| BSH          | 07/2026              | AUD                | 8                    | \$ 6                  | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | BRL                | 11 856               | 2 300                 | 9                        | 0                                             | 9                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | PEN                | 2 880                | 838                   | 2                        | (8)                                           | (6)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 184                  | ¥ 29 269              | 0                        | (4)                                           | (4)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 40                   | NZD 70                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | NZD                | 70                   | \$ 40                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 6                    | AUD 8                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | CLP                | 261 182              | \$ 297                | 13                       | 0                                             | 13                     | 0,01   |
|              | 09/2026              | COP                | 1 332 735            | 342                   | 0                        | (38)                                          | (38)                   | (0,02) |
|              | 09/2026              | \$                 | 2 612                | BRL 13 397            | 0                        | (62)                                          | (62)                   | (0,03) |
|              | 07/2026              | ARS                | 274 306              | \$ 174                | 0                        | (11)                                          | (11)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              | COP                | 6 529 776            | 1 738                 | 0                        | (149)                                         | (149)                  | (0,07) |
|              | 07/2026              | EGP                | 1 930                | 39                    | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              | PEN                | 2 588                | 754                   | 3                        | (7)                                           | (4)                    | 0,00   |
|              | CBK                  | 07/2026            | PYG                  | 317 250               | 50                       | 0                                             | (2)                    | (2)    |
| 07/2026      |                      | \$                 | 124                  | ARS 200 915           | 11                       | 0                                             | 11                     | 0,01   |
| 07/2026      |                      |                    | 899                  | BRL 4 579             | 2                        | (16)                                          | (14)                   | (0,01) |
| 07/2026      |                      |                    | 847                  | COP 2 962 546         | 10                       | 0                                             | 10                     | 0,00   |
| 07/2026      |                      |                    | 206                  | EGP 11 000            | 17                       | 0                                             | 17                     | 0,01   |
| 07/2026      |                      |                    | 1 314                | £ 994                 | 6                        | 0                                             | 6                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      |                    | 2 515                | HUF 773 878           | 2                        | (32)                                          | (30)                   | (0,01) |
| 07/2026      |                      |                    | 274                  | IDR 4 936 658         | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
| 07/2026      |                      |                    | 4 104                | PEN 13 946            | 1                        | (16)                                          | (15)                   | (0,01) |
| 07/2026      |                      |                    | 1 833                | PLN 6 700             | 0                        | (51)                                          | (51)                   | (0,02) |
| 07/2026      |                      |                    | 860                  | TWD 27 206            | 0                        | (7)                                           | (7)                    | 0,00   |
| 08/2026      |                      | COP                | 38 880 176           | \$ 10 216             | 0                        | (941)                                         | (941)                  | (0,42) |
| 08/2026      |                      | ILS                | 21                   | 7                     | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 08/2026      |                      | KZT                | 3                    | 0                     | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
| 09/2026      |                      | CLP                | 1 961 864            | 2 192                 | 63                       | 0                                             | 63                     | 0,03   |
| 09/2026      | COP                  | 8 389 579          | 2 233                | 1                     | (159)                    | (158)                                         | (0,07)                 |        |
| 09/2026      | IDR                  | 86 432 238         | 4 801                | 11                    | (1)                      | 10                                            | 0,00                   |        |
| 09/2026      | KZT                  | 59 195             | 117                  | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |        |
| 09/2026      | PEN                  | 8 357              | 2 442                | 0                     | (2)                      | (2)                                           | 0,00                   |        |
| 09/2026      | THB                  | 15 297             | 471                  | 8                     | 0                        | 8                                             | 0,00                   |        |
| 09/2026      | \$                   | 667                | COP 2 436 726        | 28                    | 0                        | 28                                            | 0,01                   |        |
| 09/2026      |                      | 39                 | EGP 1 983            | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |        |
| 09/2026      |                      | 386                | IDR 6 884 477        | 0                     | (4)                      | (4)                                           | 0,00                   |        |
| 09/2026      |                      | 511                | INR 48 368           | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |        |
| 09/2026      |                      | 264                | PEN 908              | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |        |
| 09/2026      |                      | 20                 | RSD 2 025            | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |        |
| 09/2026      |                      | 1 623              | THB 52 368           | 0                     | (37)                     | (37)                                          | (0,02)                 |        |
| 10/2026      | COP                  | 261 354            | \$ 73                | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |        |
| 10/2026      | PEN                  | 15 990             | 4 653                | 15                    | (31)                     | (16)                                          | (0,01)                 |        |
| 10/2026      | UGX                  | 850 080            | 231                  | 5                     | 0                        | 5                                             | 0,00                   |        |
| 10/2026      | \$                   | 98                 | PEN 342              | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |        |
| 10/2026      |                      | 99                 | UGX 388 685          | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |        |
| 10/2026      | UZS                  | 340 600            | \$ 26                | 0                     | (2)                      | (2)                                           | 0,00                   |        |
| 11/2026      | COP                  | 2 788 873          | 774                  | 0                     | (10)                     | (10)                                          | 0,00                   |        |
| 11/2026      | NGN                  | 28 595             | 18                   | 0                     | (2)                      | (2)                                           | 0,00                   |        |
| 12/2026      | PEN                  | 3 314              | 948                  | 0                     | (18)                     | (18)                                          | (0,01)                 |        |
| 12/2026      | \$                   | 993                | IDR 18 050 873       | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |        |
| 01/2027      | PEN                  | 3 637              | \$ 1 072             | 14                    | 0                        | 14                                            | 0,01                   |        |
| 05/2027      | \$                   | 194                | PEN 688              | 6                     | 0                        | 6                                             | 0,00                   |        |
| 03/2028      |                      | 1 077              | IDR 18 673 190       | 0                     | (82)                     | (82)                                          | (0,04)                 |        |
| DUB          | 07/2026              | INR                | 48 953               | \$ 518                | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | KZT                | 36 848               | 78                    | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | PEN                | 2 074                | 613                   | 5                        | 0                                             | 5                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | RON                | 128                  | 28                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | THB                | 5 351                | 163                   | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 2 254                | CZK 46 930            | 0                        | (43)                                          | (43)                   | (0,02) |
|              | 07/2026              |                    | 73                   | EGP 3 963             | 7                        | 0                                             | 7                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 786                  | IDR 14 156 253        | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 152                  | INR 14 639            | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 1 735                | MYR 7 043             | 0                        | (11)                                          | (11)                   | (0,01) |
|              | 07/2026              |                    | 572                  | NOK 5 311             | 0                        | (35)                                          | (35)                   | (0,02) |
|              | 07/2026              |                    | 928                  | PEN 3 137             | 0                        | (8)                                           | (8)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 1 916                | PLN 7 111             | 0                        | (25)                                          | (25)                   | (0,01) |

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| FAR          | 07/2026              | ZAR 8 497          | \$ 525               | \$ 7                  | \$ 0                     | \$ 7                                          | 0,00                   |
|              | 08/2026              | KZT 129 753        | 269                  | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$ 332             | EGP 17 641           | 20                    | 0                        | 20                                            | 0,01                   |
|              | 08/2026              | 458                | KZT 244 597          | 47                    | 0                        | 47                                            | 0,02                   |
|              | 09/2026              | IDR 5 322 031      | \$ 299               | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | PEN 6 131          | 1 797                | 8                     | (3)                      | 5                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$ 509             | IDR 9 239 606        | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 738                | INR 70 414           | 2                     | (2)                      | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 16                 | KZT 8 186            | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 0                  | PEN 1                | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 733                | THB 23 851           | 0                     | (10)                     | (10)                                          | 0,00                   |
|              | 10/2026              | UZS 8 865 139      | \$ 695               | 0                     | (32)                     | (32)                                          | (0,01)                 |
|              | 11/2026              | 2 811 588          | 215                  | 0                     | (14)                     | (14)                                          | (0,01)                 |
|              | 12/2026              | MYR 2 181          | 539                  | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 12/2026              | \$ 30              | KZT 15 938           | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 12/2026              | UZS 3 729 245      | \$ 287               | 0                     | (17)                     | (17)                                          | (0,01)                 |
|              | 07/2026              | AUD 4              | 3                    | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | £ 3 198            | 4 301                | 56                    | 0                        | 56                                            | 0,03                   |
|              | 07/2026              | PEN 1 238          | 366                  | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | PLN 10 235         | 2 804                | 81                    | 0                        | 81                                            | 0,04                   |
|              | 07/2026              | SGD 225            | 176                  | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$ 380             | BRL 1 923            | 0                     | (8)                      | (8)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 577                | € 506                | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 249                | HUF 76 850           | 0                     | (2)                      | (2)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 1 254              | ¥ 202 959            | 0                     | (6)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 5 312              | PLN 19 570           | 0                     | (106)                    | (106)                                         | (0,05)                 |
|              | 07/2026              | ZAR 10 613         | \$ 643               | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | € 506              | 578                  | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | ¥ 202 428          | 1 254                | 6                     | 0                        | 6                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | PEN 1 112          | 329                  | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$ 3               | AUD 4                | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | PEN 4 223          | \$ 1 239             | 7                     | (3)                      | 4                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$ 266             | IDR 4 727 485        | 0                     | (4)                      | (4)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 1 878              | INR 179 991          | 11                    | 0                        | 11                                            | 0,01                   |
|              | 09/2026              | 101                | PEN 340              | 0                     | (2)                      | (2)                                           | 0,00                   |
| GLM          | 07/2026              | ARS 50 351         | \$ 33                | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | BRL 103 363        | 20 075               | 107                   | (1)                      | 106                                           | 0,05                   |
|              | 07/2026              | DOP 14 752         | 242                  | 0                     | (5)                      | (5)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | € 1 116            | BRL 6 582            | 0                     | (5)                      | (5)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | INR 39 820         | \$ 420               | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$ 34              | ARS 50 351           | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 18 507             | BRL 99 368           | 747                   | (56)                     | 691                                           | 0,31                   |
|              | 07/2026              | 31                 | CAD 44               | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 1 545              | COP 5 356 542        | 6                     | (5)                      | 1                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 1 114              | INR 105 467          | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 4 054              | MYR 16 692           | 32                    | 0                        | 32                                            | 0,01                   |
|              | 07/2026              | 1 058              | PEN 3 721            | 33                    | 0                        | 33                                            | 0,02                   |
|              | 07/2026              | 236                | PLN 879              | 0                     | (3)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 1 374              | RON 6 219            | 0                     | (18)                     | (18)                                          | (0,01)                 |
|              | 07/2026              | ZAR 6 062          | \$ 366               | 0                     | (4)                      | (4)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | BRL 6 582          | € 1 106              | 5                     | 0                        | 5                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | CAD 44             | \$ 31                | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | DOP 16 903         | 283                  | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | KZT 81 034         | 155                  | 0                     | (12)                     | (12)                                          | (0,01)                 |
|              | 08/2026              | \$ 1 051           | DOP 65 859           | 42                    | 0                        | 42                                            | 0,02                   |
|              | 08/2026              | 66                 | EGP 3 516            | 5                     | 0                        | 5                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | 115                | INR 11 058           | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | ARS 57 106         | \$ 30                | 0                     | (7)                      | (7)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | COP 3 195 924      | 905                  | 3                     | (9)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | DOP 101 511        | 1 692                | 15                    | (4)                      | 11                                            | 0,01                   |
|              | 09/2026              | INR 1 043 872      | 10 993               | 48                    | (10)                     | 38                                            | 0,02                   |
|              | 09/2026              | MXN 32 223         | 1 859                | 26                    | 0                        | 26                                            | 0,01                   |
|              | 09/2026              | \$ 34              | ARS 57 106           | 3                     | 0                        | 3                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 385                | DOP 23 498           | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 1 424              | IDR 25 633 019       | 4                     | (7)                      | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 827                | INR 79 157           | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 181                | MXN 3 179            | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | 2 935              | THB 94 750           | 0                     | (65)                     | (65)                                          | (0,03)                 |
|              | 10/2026              | DOP 2 382          | \$ 40                | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 10/2026              | \$ 20 072          | BRL 105 619          | 0                     | (106)                    | (106)                                         | (0,05)                 |
|              | 10/2026              | 10                 | MNT 36 545           | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 11/2026              | COP 3 057 001      | \$ 852               | 1                     | (7)                      | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 11/2026              | DOP 58 192         | 957                  | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 12/2026              | COP 652 197        | 167                  | 0                     | (15)                     | (15)                                          | (0,01)                 |
|              | 12/2026              | DOP 4 002          | 67                   | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 04/2027              | \$ 12              | MNT 45 556           | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 10/2027              | 12                 | 45 806               | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 04/2028              | 35                 | 140 398              | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 10/2028              | 33                 | 133 133              | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 04/2029              | 30                 | 126 618              | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 10/2029              | 28                 | 120 104              | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 04/2030              | 26                 | 113 589              | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| IND JPM      | 10/2030           | \$ 24           | MNT 107 146       | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 04/2031           | 22              | 99 902            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 070           | PLN 7 817         | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 107         | \$ 75             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | EGP 9 930       | 161               | 0                  | (39)                  | (39)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | KZT 7 681       | 16                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 3 474       | 844               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 15 049      | 1 520             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 26 138      | 7 175             | 221                | 0                     | 221                                     | 0,10                |
|              | 07/2026           | \$ 71           | AUD 100           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 299             | BRL 1 513         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 105             | CZK 2 177         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 37              | EGP 1 961         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 601           | HUF 1 711 456     | 0                  | (106)                 | (106)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | 10              | ILS 29            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 551             | INR 52 163        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 153           | PEN 4 026         | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 206             | PLN 779           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 230             | ZAR 3 745         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 526         | \$ 67             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 75           | AUD 107           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 147             | KZT 77 382        | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | 1 520           | NOK 15 056        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 758 166     | \$ 208            | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 9 971 811   | 556               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 57 762      | 3 313             | 34                 | (5)                   | 29                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | THB 80 061      | 2 446             | 31                 | (10)                  | 21                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$ 280          | IDR 5 090 971     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 449             | INR 42 688        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 719             | MXN 12 553        | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 6 776           | THB 221 420       | 0                  | (69)                  | (69)                                    | (0,03)              |
|              | 10/2026           | UGX 14 740      | \$ 4              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS 3 021 998   | 238               | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | MXN 8 119       | 460               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 11           | MXN 193           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 06/2027           | UZS 187 066     | \$ 14             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 12          | 15                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | EGP 22 914      | 402               | 0                  | (63)                  | (63)                                    | (0,03)              |
|              | 07/2026           | € 276           | 319               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 161           | 216               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 49 147      | 520               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 5 315       | 1 310             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 4 853       | 488               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 25 758      | 784               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 17           | AUD 23            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 109             | COP 414 587       | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 195           | € 1 028           | 0                  | (20)                  | (20)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 386             | INR 37 177        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 172             | ¥ 27 273          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 361           | NOK 12 623        | 0                  | (86)                  | (86)                                    | (0,04)              |
|              | 08/2026           | € 139           | \$ 159            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 488          | NOK 4 855         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP 7 678       | \$ 138            | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | INR 99 700      | 1 045             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 082        | INR 103 321       | 3                  | (2)                   | 1                                       | 0,00                |
| MYI          | 09/2026           | 130             | MXN 2 256         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 28            | \$ 32             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 294          | MYR 1 211         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK 4 390       | € 180             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 296          | EGP 16 600        | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,02                |
| NSL          | 09/2026           | 183             | IDR 3 310 505     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 289             | THB 9 358         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 356             | INR 34 247        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 104             | TRY 4 879         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| RYL          | 09/2026           | 236             | IDR 4 203 114     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 181             | 3 248 008         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | COP 2 388 572   | \$ 620            | 0                  | (69)                  | (69)                                    | (0,03)              |
|              | 07/2026           | PEN 217         | 63                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 29 613      | 933               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 133          | EGP 7 120         | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 1 495           | INR 142 931       | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 4 612           | MYR 18 843        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 496         | \$ 63             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 287          | INR 27 466        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 20              | KZT 10 654        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 955             | NGN 1 323 959     | 0                  | (18)                  | (18)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | EGP 4 621       | \$ 90             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 31 403 165  | 1 737             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 9 281       | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 36 532      | 1 111             | 7                  | (2)                   | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 99           | EGP 5 313         | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 3 076           | IDR 55 936 873    | 29                 | (4)                   | 25                                      | 0,01                |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG                                                | 09/2026           | \$              | 1 720             | INR 163 379        | \$ 0                  | \$ (5)                                  | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           |                 | 3 568             | THB 116 089        | 0                     | (51)                                    | (0,02)              |
|                                                    | 10/2026           |                 | 128               | UGX 476 103        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 11/2026           | UGX             | 264 039           | \$ 68              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 391               | RON 2 061          | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 6 513             | \$ 7 598           | 151                   | 151                                     | 0,07                |
|                                                    | 07/2026           | PEN             | 4 178             | 1 234              | 9                     | 9                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | TWD             | 71 082            | 2 230              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 426               | BRL 2 170          | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 7 006             | € 6 159            | 36                    | 36                                      | 0,02                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 447               | ¥ 71 018           | 0                     | (10)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 174               | SGD 225            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | €               | 6 159             | \$ 7 016           | 0                     | (36)                                    | (0,02)              |
|                                                    | 08/2026           | SGD             | 225               | 174                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 173               | EGP 9 453          | 15                    | 15                                      | 0,01                |
| SSB                                                | 09/2026           | EGP             | 21 091            | \$ 379             | 0                     | (37)                                    | (0,02)              |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 133               | MXN 2 310          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 45                | \$ 33              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 575               | BRL 2 974          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 4 441             | £ 3 359            | 18                    | 18                                      | 0,01                |
|                                                    | 08/2026           | £               | 3 359             | \$ 4 441           | 0                     | (18)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 09/2026           | COP             | 2 749 446         | 709                | 0                     | (75)                                    | (0,03)              |
| UAG                                                | 09/2026           | \$              | 132               | IDR 2 360 011      | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           |                 | 445               | INR 42 480         | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 1 951             | PLN 7 129          | 0                     | (54)                                    | (0,02)              |
|                                                    | 09/2026           | CLP             | 2 215 473         | \$ 2 489           | 84                    | 84                                      | 0,04                |
|                                                    | 09/2026           | COP             | 1 232 686         | 338                | 0                     | (13)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 251               | COP 968 146        | 25                    | 25                                      | 0,01                |
|                                                    | 10/2026           | HUF             | 9 834             | € 26               | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| WST                                                | 11/2026           |                 | 75 693            | 210                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 12/2026           | COP             | 6 267 775         | \$ 1 606           | 0                     | (142)                                   | (0,06)              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 14                | CHF 12             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | CHF             | 12                | \$ 14              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 3 033           | \$ (3 759)            | \$ (726)                                | (0,32)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (613)                                | (0,27)              |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 233 701                              | 104,63              |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (10 349)                             | (4,63)              |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 223 352                              | 100,00              |

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

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

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (d) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,95 %) :

| Description de l'émetteur         | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Banque de développement asiatique | 5,750 % | 23/01/2030      | 06/01/2025   | \$ 1 088 | \$ 1 462     | 0,65                |

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 23 514 \$ (31 décembre 2025 : 17 582 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 40 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 2 269 \$ (31 décembre 2025 : 1 442 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 710 \$ (31 décembre 2025 : 448 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                               | \$ 222 856                                           | \$ 6 074                                          | \$ 228 930        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                  | 7 800                                                | 0                                                 | 7 800             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (3)                                                                                | (3 026)                                              | 0                                                 | (3 029)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (3)</b>                                                                      | <b>\$ 227 630</b>                                    | <b>\$ 6 074</b>                                   | <b>\$ 233 701</b> |



## Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                               | \$ 142 708                                           | \$ 5 358                                          | \$ 148 066        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                  | 4 500                                                | 0                                                 | 4 500             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (2)                                                                                | (1 190)                                              | 0                                                 | (1 192)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (2)</b>                                                                      | <b>\$ 146 018</b>                                    | <b>\$ 5 358</b>                                   | <b>\$ 151 374</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BRC                                           | 3,750 %        | 19/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | CZK (37 459)     | \$ (1 767)                               | (0,79)              |
|                                               | 4,100          | 30/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | PLN (9 205)      | (2 449)                                  | (1,10)              |
| MBC                                           | 3,900          | 08/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (18 667)         | (4 979)                                  | (2,23)              |
|                                               | 3,930          | 14/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (11 921)         | (3 188)                                  | (1,43)              |
|                                               | 3,950          | 24/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (7 984)          | (2 126)                                  | (0,95)              |
|                                               | 5,850          | 25/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | HUF (548 671)    | (1 764)                                  | (0,79)              |
|                                               | 7,000          | 03/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | ZAR (40 850)     | (2 506)                                  | (1,12)              |
| MEI                                           | 3,920          | 17/04/2026        | 02/07/2026         | PLN (1 346)      | (361)                                    | (0,16)              |
|                                               | 3,950          | 13/03/2026        | 02/07/2026         | (6 769)          | (1 823)                                  | (0,81)              |
|                                               | 5,750          | 29/06/2026        | 02/07/2026         | HUF (499 505)    | (1 605)                                  | (0,72)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (22 568)</b>                       | <b>(10,10)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | \$ (10)                                                    | \$ 0                    | \$ (10)                           | \$ (14)                                                    | \$ 0                    | \$ (14)                           |
| BPS          | 70                                                         | (270)                   | (200)                             | 190                                                        | 0                       | 190                               |
| BRC          | 125                                                        | (130)                   | (5)                               | 129                                                        | (130)                   | (1)                               |
| BSH          | (88)                                                       | 0                       | (88)                              | (113)                                                      | 0                       | (113)                             |
| CBK          | (1 330)                                                    | 1 310                   | (20)                              | (156)                                                      | 273                     | 117                               |
| DUB          | (78)                                                       | 0                       | (78)                              | 81                                                         | 0                       | 81                                |
| FAR          | 35                                                         | 0                       | 35                                | (201)                                                      | 165                     | (36)                              |
| GLM          | 716                                                        | (680)                   | 36                                | 128                                                        | 10                      | 138                               |
| GST          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| IND          | 10                                                         | 0                       | 10                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 110                                                        | (60)                    | 50                                | 13                                                         | 0                       | 13                                |
| MBC          | (120)                                                      | 270                     | 150                               | (80)                                                       | 0                       | (80)                              |
| MYC          | 30                                                         | 0                       | 30                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| MYI          | 30                                                         | (10)                    | 20                                | (30)                                                       | (10)                    | (40)                              |
| NSL          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 18                                                         | 0                       | 18                                |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| RYL          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |
| SCX          | (51)                                                       | 130                     | 79                                | 127                                                        | (130)                   | (3)                               |
| SOG          | 122                                                        | 0                       | 122                               | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| SSB          | (74)                                                       | 0                       | (74)                              | (31)                                                       | 0                       | (31)                              |
| UAG          | (110)                                                      | 0                       | (110)                             | 31                                                         | 0                       | 31                                |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 77,67            | 74,95                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 2,64             | 2,37                 |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,15             | 1,33                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 2,78             | 2,39                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 2,40             | 2,67                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,29             | 1,14                 |
| Autres actifs                                                    | 12,07            | 15,15                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Argentine                                                                                                | 0,11             | 0,05                 |
| Brésil                                                                                                   | 0,68             | 1,04                 |
| Îles Caïmans                                                                                             | 0,36             | S/O                  |
| Chili                                                                                                    | 4,04             | 3,74                 |
| Colombie                                                                                                 | 11,19            | 10,43                |
| Costa Rica                                                                                               | 0,33             | S/O                  |
| République tchèque                                                                                       | 5,91             | 3,72                 |
| République dominicaine                                                                                   | 1,65             | 3,15                 |
| Équateur                                                                                                 | S/O              | 0,29                 |
| Égypte                                                                                                   | 1,29             | 1,67                 |
| Allemagne                                                                                                | 0,72             | 1,24                 |
| Hongrie                                                                                                  | 2,78             | 2,13                 |
| Inde                                                                                                     | 4,62             | S/O                  |
| Indonésie                                                                                                | 5,52             | 2,40                 |
| Irlande                                                                                                  | 0,69             | 1,11                 |
| Côte d'Ivoire                                                                                            | 0,31             | 0,72                 |
| Kazakhstan                                                                                               | 0,83             | 0,68                 |
| Luxembourg                                                                                               | 0,16             | S/O                  |
| Malaisie                                                                                                 | 6,75             | 4,57                 |
| Mexique                                                                                                  | 9,57             | 10,13                |
| Nigeria                                                                                                  | 0,13             | S/O                  |
| Paraguay                                                                                                 | 0,33             | 0,51                 |
| Pérou                                                                                                    | 7,02             | 7,33                 |
| Philippines                                                                                              | 0,19             | 6,47                 |
| Pologne                                                                                                  | 10,71            | 8,36                 |
| Qatar                                                                                                    | 0,18             | S/O                  |
| Roumanie                                                                                                 | 2,13             | 2,81                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,33             | 0,55                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 8,57             | 10,75                |
| Supranationales                                                                                          | 7,95             | 9,67                 |
| Thaïlande                                                                                                | 2,28             | 4,33                 |
| Turquie                                                                                                  | 0,55             | 2,04                 |
| Ukraine                                                                                                  | S/O              | 0,11                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,18             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                                                              | 0,51             | 0,81                 |
| États-Unis                                                                                               | 0,49             | 1,51                 |
| Uruguay                                                                                                  | 0,21             | 0,19                 |
| Ouzbékistan                                                                                              | 0,16             | 0,40                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 3,07             | 1,48                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 3,49             | 3,17                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | S/O              | (0,01)               |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (1,09)           | (0,90)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,10             | 0,23                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,06             | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,10)           | (0,13)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | (0,03)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03             | 0,01                 |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | (0,04)           | 0,13                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,03             | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,32)           | (0,15)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (4,63)           | (6,72)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                          |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ANGOLA</b>                                      |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Sonangol Finance Ltd.                              |                                     |                                  |                           | 11,039 % éch. 07/06/2028                                                   | \$ 600                              | \$ 599                           | 0,01                      | Petrobras Global Finance BV                                            |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 29/01/2031                           | \$ 31 000                           | \$ 31 252                        | 0,46                      | Armor RE Ltd.                                                              |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 10/09/2030                                                | \$ 200                              | 197                              | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 8,810 % éch. 07/06/2033                                                    | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Rede D'or Finance SARL                                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement angolais |                                     |                                  |                           | Blue Ridge Re Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | 6,550 % éch. 28/04/2036                                                | 10 200                              | 9 898                            | 0,15                      |
| 8,000 % éch. 26/11/2029                            | 2 892                               | 2 945                            | 0,04                      | 7,020 % éch. 08/01/2029                                                    | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % en espèces ou 12,000 % en PIK)        |                                     |                                  |                           |
| 9,125 % éch. 26/11/2049                            | 3 365                               | 3 159                            | 0,05                      | 9,520 % éch. 08/01/2029                                                    | 250                                 | 251                              | 0,01                      | 11,000 % éch. 31/12/2028 ^ (b)                                         | 3 741                               | 112                              | 0,00                      |
| 9,244 % éch. 15/01/2031                            | 1 200                               | 1 243                            | 0,02                      | Buttonwood RE Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % en espèces ou 15,000 % en PIK)        |                                     |                                  |                           |
| 9,375 % éch. 31/03/2033                            | 17 500                              | 17 928                           | 0,26                      | 9,050 % éch. 29/05/2029                                                    | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 13,500 % éch. 31/12/2027 ^ (b)                                         | 1 635                               | 98                               | 0,00                      |
| 9,875 % éch. 15/10/2035 (k)                        | 3 600                               | 3 757                            | 0,06                      | 10,050 % éch. 29/05/2029                                                   | 250                                 | 250                              | 0,00                      | Vale S.A.                                                              |                                     |                                  |                           |
| 9,875 % éch. 31/03/2037                            | 28 900                              | 29 855                           | 0,44                      | Cape Lookout Re Ltd.                                                       |                                     |                                  |                           | 0,000 %                                                                | BRL 188 860                         | 14 645                           | 0,21                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 10,420 % éch. 13/03/2032                                                   | 800                                 | 835                              | 0,01                      |                                                                        |                                     | 53 225                           | 0,78                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Commonwealth RE Ltd.                                                       |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 7,407 % éch. 08/07/2030                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien                    |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Everglades Re Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 23/04/2030                                                | € 15 300                            | 17 556                           | 0,26                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 9,289 % éch. 22/05/2033                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | 6,625 % éch. 15/03/2035                                                | \$ 6 000                            | 6 166                            | 0,09                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 10,289 % éch. 22/05/2033                                                   | 250                                 | 250                              | 0,00                      |                                                                        |                                     | 23 722                           | 0,35                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 12,039 % éch. 22/05/2033                                                   | 250                                 | 250                              | 0,00                      |                                                                        |                                     | 76 947                           | 1,13                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Golden Bear Re Ltd.                                                        |                                     |                                  |                           | <b>BULGARIE</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 13,289 % éch. 08/03/2032                                                   | 400                                 | 403                              | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Handshake Re Ltd.                                                          |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement bulgare                      |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 8,050 % éch. 08/01/2030                                                    | 250                                 | 246                              | 0,00                      | 3,375 % éch. 18/07/2035                                                | € 8 400                             | 9 366                            | 0,14                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Herbie Re Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 07/05/2034                                                | 7 900                               | 8 995                            | 0,13                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 7,760 % éch. 07/01/2030                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | 4,125 % éch. 07/05/2038                                                | 10 300                              | 11 814                           | 0,17                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Integrity Re Ltd.                                                          |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 18/07/2045                                                | 1 000                               | 1 099                            | 0,02                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 10,520 % éch. 07/06/2029                                                   | 250                                 | 250                              | 0,00                      | 4,250 % éch. 05/09/2044                                                | 6 000                               | 6 777                            | 0,10                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Locke Tavern Re Ltd.                                                       |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 05/03/2037                                                | \$ 10 900                           | 10 660                           | 0,16                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 6,800 % éch. 11/04/2033                                                    | 250                                 | 249                              | 0,00                      |                                                                        |                                     | 48 711                           | 0,72                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 7,800 % éch. 11/04/2033                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | <b>CAMEROUN</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Lower Ferry Re Ltd.                                                        |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de la République du Cameroun |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 6,510 % éch. 08/07/2033                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | 5,950 % éch. 07/07/2032                                                | € 9 680                             | 9 897                            | 0,15                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 9,014 % éch. 08/07/2030                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | 8,875 % éch. 30/01/2033                                                | \$ 16 900                           | 16 678                           | 0,24                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Mayflower Re Ltd.                                                          |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 31/07/2031                                                | 18 800                              | 19 001                           | 0,28                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 8,565 % éch. 08/07/2030                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      |                                                                        |                                     | 45 576                           | 0,67                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Merna Reinsurance Ltd.                                                     |                                     |                                  |                           | <b>CANADA</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 13,991 % éch. 07/07/2030                                                   | 250                                 | 250                              | 0,00                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Palm RE Ltd.                                                               |                                     |                                  |                           | Parex Resources, Inc.                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 8,550 % éch. 07/06/2033                                                    | 250                                 | 254                              | 0,01                      | 8,500 % éch. 11/05/2031                                                | 8 300                               | 8 437                            | 0,12                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Polestar Re Ltd.                                                           |                                     |                                  |                           | <b>ÎLES CAÏMANS</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 14,140 % éch. 07/01/2028                                                   | 300                                 | 313                              | 0,01                      | <b>TITRES ADOSSES À DES ACTIFS</b>                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Purple Re Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | KKR CLO Ltd.                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 10,050 % éch. 07/06/2033                                                   | 300                                 | 300                              | 0,01                      | 4,935 % éch. 15/04/2031                                                | 65                                  | 65                               | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Sutter Re Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                             |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 7,289 % éch. 07/06/2034                                                    | 300                                 | 300                              | 0,01                      | Country Garden Holdings Co. Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Torrey Pines Re Ltd.                                                       |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                            | 1 111                               | 78                               | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 9,586 % éch. 07/06/2032                                                    | 300                                 | 308                              | 0,01                      | Kaisa Group Holdings Ltd.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 10,656 % éch. 07/06/2032                                                   | 250                                 | 258                              | 0,01                      | 0,000 % éch. 31/12/2026 (d)                                            | 511                                 | 2                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Veraison Re Ltd.                                                           |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2027 (d)                                            | 639                                 | 5                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 6,421 % éch. 08/03/2034                                                    | 250                                 | 253                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)                                            | 1 022                               | 7                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 7,671 % éch. 08/03/2034                                                    | 250                                 | 250                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 31/12/2029 (d)                                            | 1 022                               | 7                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Winston RE Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2030 (d)                                            | 1 277                               | 8                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 8,300 % éch. 04/05/2033                                                    | 250                                 | 251                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                            | 1 277                               | 5                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 9,550 % éch. 04/05/2033                                                    | 250                                 | 252                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 31/12/2032 (d)                                            | 2 225                               | 7                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Total Bermudes                                                             |                                     | 9 322                            | 0,14                      |                                                                        |                                     | 119                              | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | <b>BOLIVIE</b>                                                             |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | Banco Mercantil del Norte S.A.                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement bolivien                         |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 24/01/2032 (g)(i)                                         | 4 100                               | 3 907                            | 0,06                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 20/03/2028 (k)                                                | 5 934                               | 5 717                            | 0,08                      | 8,375 % éch. 20/05/2031 (g)(i)                                         | 7 200                               | 7 382                            | 0,11                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 9,450 % éch. 14/05/2031                                                    | 600                                 | 615                              | 0,01                      | 8,750 % éch. 20/05/2035 (g)(i)                                         | 1 200                               | 1 241                            | 0,02                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 9,450 % éch. 14/05/2031 (k)                                                | 8 000                               | 8 206                            | 0,12                      | Biocanico Sovereign Certificate Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 05/06/2034 (d)                                            | 13 220                              | 10 849                           | 0,16                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Total Bolivie                                                              |                                     | 14 538                           | 0,21                      | Burjeel Sukuk Ltd.                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | <b>BOSNIE-HERZÉGOVINE</b>                                                  |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 01/07/2031 (a)                                            | 4 400                               | 4 419                            | 0,07                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | Energuate Trust 2.0                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de la République serbe de Bosnie |                                     |                                  |                           | 6,350 % éch. 15/09/2035                                                | 8 100                               | 8 071                            | 0,12                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 02/04/2031                                                    | € 7 700                             | 8 933                            | 0,13                      |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 08/05/2033                                                    | 11 100                              | 12 728                           | 0,19                      |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Total Bosnie-Herzégovine                                                   |                                     | 21 661                           | 0,32                      |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | <b>BRÉSIL</b>                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Banco do Brasil S.A.                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 29/07/2026                                                    | MXN 294 000                         | 16 880                           | 0,25                      |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais                                 |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 5,333 % éch. 15/02/2028                                                    | \$ 11 338                           | 11 395                           | 0,17                      |                                                                        |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| FWD Group Holdings Ltd.<br>5,252 % éch. 22/09/2030                                    | \$ 9 100                            | \$ 9 077                         | 0,13                      | Empresa de los Ferrocarriles del Estado<br>3,068 % éch. 18/08/2050               | \$ 1 500                            | \$ 953                           | 0,01                      | 5,625 % éch. 19/02/2036                                                          | € 800                               | \$ 910                           | 0,01                      |
| 5,836 % éch. 22/09/2035                                                               | 1 400                               | 1 403                            | 0,02                      | 3,830 % éch. 14/09/2061                                                          | 6 600                               | 4 528                            | 0,07                      | 5,750 % éch. 26/11/2034                                                          | 11 500                              | 13 393                           | 0,20                      |
| 7,635 % éch. 02/07/2031                                                               | 9 700                               | 10 618                           | 0,16                      | Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.<br>3,650 % éch. 07/05/2030         | 600                                 | 574                              | 0,01                      | 6,500 % éch. 21/01/2033                                                          | € 20 400                            | 20 747                           | 0,31                      |
| Gacfi First Investment Co.<br>4,875 % éch. 14/02/2035                                 | 600                                 | 584                              | 0,01                      | 3,650 % éch. 07/05/2030 (k)                                                      | 1 400                               | 1 339                            | 0,02                      | 6,500 % éch. 26/11/2038                                                          | \$ 9 900                            | 11 918                           | 0,18                      |
| 5,000 % éch. 29/01/2029                                                               | 400                                 | 400                              | 0,01                      | 5,000 % éch. 25/01/2047                                                          | 200                                 | 182                              | 0,00                      | 7,375 % éch. 25/04/2030                                                          | \$ 3 900                            | 4 118                            | 0,06                      |
| 5,125 % éch. 14/02/2053                                                               | 20 600                              | 17 783                           | 0,26                      | Empresa Nacional del Petroleo<br>3,450 % éch. 16/09/2031                         | 1 109                               | 1 015                            | 0,02                      | 7,375 % éch. 18/09/2037                                                          | 1 400                               | 1 490                            | 0,02                      |
| 5,250 % éch. 29/01/2030                                                               | 11 400                              | 11 509                           | 0,17                      | 4,500 % éch. 14/09/2047                                                          | 3 000                               | 2 498                            | 0,04                      | 7,500 % éch. 02/02/2034                                                          | 9 200                               | 9 844                            | 0,15                      |
| 5,250 % éch. 13/10/2032                                                               | 300                                 | 301                              | 0,00                      | 5,250 % éch. 06/11/21029                                                         | 4 677                               | 4 702                            | 0,07                      | 8,000 % éch. 20/04/2033                                                          | 6 800                               | 7 460                            | 0,11                      |
| 6,250 % éch. 14/05/2056                                                               | 25 300                              | 25 340                           | 0,37                      | 5,950 % éch. 30/07/2034                                                          | 2 200                               | 2 249                            | 0,03                      | TES colombien<br>2,250 % éch. 18/04/2029 (f)                                     | COP 30 648 843                      | 8 011                            | 0,12                      |
| Interoceanica Finance Ltd.<br>0,000 % éch. 15/05/2030 (d)                             | 3 754                               | 3 158                            | 0,05                      | 6,150 % éch. 10/05/2033                                                          | 5 400                               | 5 614                            | 0,08                      | 3,000 % éch. 25/03/2033 (f)                                                      | 4 188 813                           | 995                              | 0,01                      |
| 7,860 % éch. 15/05/2030                                                               | 2 260                               | 2 307                            | 0,03                      | Engie Energia Chile S.A.<br>6,375 % éch. 17/04/2034                              | 2 600                               | 2 724                            | 0,04                      | 6,250 % éch. 09/07/2036                                                          | 16 901 800                          | 3 355                            | 0,05                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.<br>5,000 % éch. 30/11/2027                                  | 108                                 | 5                                | 0,00                      | GNL Quintero S.A.<br>4,634 % éch. 31/07/2029                                     | 3 461                               | 3 456                            | 0,05                      | 6,500 % éch. 22/01/2031 (f)                                                      | 166 676 203                         | 47 925                           | 0,71                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | Sociedad Química y Minera de Chile S.A.<br>5,500 % éch. 10/09/2034               | 13 055                              | 13 104                           | 0,19                      | 7,000 % éch. 26/03/2031                                                          | 17 312 400                          | 4 140                            | 0,06                      |
| 6,250 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 859                                 | 19                               | 0,00                      | 5,625 % éch. 22/04/2056                                                          | 4 000                               | 3 972                            | 0,06                      | 11,500 % éch. 25/07/2046                                                         | 5 896 100                           | 1 659                            | 0,02                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) | 1 438                               | 32                               | 0,00                      | Sociedad Transmisora Metropolitana SpA<br>6,385 % éch. 15/12/2055                | 6 250                               | 6 385                            | 0,09                      | 11,750 % éch. 24/01/2035                                                         | 95 972 800                          | 27 341                           | 0,40                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 28/11/2040                                                         | 158 992 500                         | 48 110                           | 0,71                      |
| 6,750 % éch. 28/12/2030 (b)                                                           | 1 734                               | 30                               | 0,00                      |                                                                                  |                                     | 159 465                          | 2,35                      | 13,250 % éch. 09/02/2033                                                         | 62 664 100                          | 19 179                           | 0,28                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     | 292 516                          | 4,31                      |
| 7,000 % éch. 28/12/2031 (b)                                                           | 2 612                               | 44                               | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement chilien<br>3,100 % éch. 07/05/2041 (k) | 3 000                               | 2 303                            | 0,03                      | Total Colombie                                                                   |                                     | 334 369                          | 4,93                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 21/09/2071                                                          | 10 500                              | 6 642                            | 0,10                      | CONGO<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 28/12/2032 (b)                                                           | 2 458                               | 49                               | 0,00                      | 4,340 % éch. 07/03/2042 (k)                                                      | 7 000                               | 6 198                            | 0,09                      | Obligation internationale congolaise<br>6,000 % éch. 30/06/2029                  | \$ 8 447                            | 8 299                            | 0,12                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 13/04/2031                                                          | 15 800                              | 15 547                           | 0,23                      | 9,500 % éch. 17/02/2035 (k)                                                      | 15 000                              | 14 601                           | 0,22                      |
| 7,721 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 588                                 | 11                               | 0,00                      |                                                                                  |                                     | 30 690                           | 0,45                      | 9,500 % éch. 26/05/2036                                                          | 40 500                              | 39 166                           | 0,58                      |
| Lima Metro Line Finance Ltd.<br>4,350 % éch. 05/04/2036                               | 441                                 | 420                              | 0,01                      | Total Chili                                                                      |                                     | 190 155                          | 2,80                      | Total Congo                                                                      |                                     | 62 066                           | 0,92                      |
| 5,875 % éch. 05/07/2034                                                               | 1 479                               | 1 512                            | 0,02                      | ACTIONS                                                                          |                                     |                                  |                           | CONGO, RÉPUBLIQUE DÉMOCRATIQUE DU<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES                       |                                     |                                  |                           |
| Meico Resorts Finance Ltd.<br>6,500 % éch. 24/09/2033                                 | 9 300                               | 9 114                            | 0,13                      | CHINE<br>ACTIONS ORDINAIRES                                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale de la RDC<br>8,750 % éch. 16/04/2032                   | 10 700                              | 11 091                           | 0,16                      |
| Montego Bay Airport Revenue Finance Ltd.<br>6,600 % éch. 15/06/2035                   | 5 400                               | 5 357                            | 0,08                      | Country Garden Holdings Co.<br>Ltd. (c)                                          | 746 147                             | 16                               | 0,00                      | 9,500 % éch. 16/04/2037                                                          | 10 700                              | 11 218                           | 0,17                      |
| Omniyat Sukuk Ltd.<br>7,250 % éch. 04/03/2031                                         | 17 500                              | 16 375                           | 0,24                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (c)                                                    | 8 271 769                           | 50                               | 0,00                      | Total Congo, République démocratique du                                          |                                     | 22 309                           | 0,33                      |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                           | 17 700                              | 17 695                           | 0,26                      |                                                                                  |                                     | \$66                             | 0,00                      | COSTA RICA<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                                                               | 24 400                              | 24 523                           | 0,36                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain<br>5,500 % éch. 21/11/2030 | € 24 000                            | 28 870                           | 0,43                      |
| Red Dorsal Finance Ltd.<br>5,875 % éch. 12/10/2031                                    | 3 232                               | 3 184                            | 0,05                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/04/2043                                                          | \$ 2 000                            | 1 939                            | 0,03                      |
| SRC Sukuk Ltd.<br>5,000 % éch. 27/02/2028                                             | 11 400                              | 11 437                           | 0,17                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 27/04/2033                                                          | € 18 200                            | 22 200                           | 0,33                      |
| 5,375 % éch. 27/02/2035                                                               | 11 300                              | 11 490                           | 0,17                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           | 6,001 % éch. 16/01/2036                                                          | 12 000                              | 14 526                           | 0,21                      |
| Suci Second Investment Co.<br>4,875 % éch. 08/05/2032                                 | 10 000                              | 9 909                            | 0,15                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                    |                                     |                                  |                           | Total Costa Rica                                                                 |                                     | 67 535                           | 1,00                      |
| 6,000 % éch. 25/10/2028                                                               | 9 600                               | 9 845                            | 0,15                      | Yango Justice International Ltd.<br>7,500 % éch. 15/04/2024 ^                    | \$ 4 700                            | 12                               | 0,00                      | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                              |                                     |                                  |                           |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.<br>6,551 % éch. 15/11/2034                 | 7 900                               | 8 026                            | 0,12                      | Total Chine                                                                      |                                     | 78                               | 0,00                      | EPH Financing International A/S<br>5,875 % éch. 30/11/2029                       | 5 800                               | 7 053                            | 0,10                      |
| VD DPR Finance Co.<br>6,833 % éch. 15/03/2035                                         | 16 800                              | 17 190                           | 0,25                      | COLOMBIE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                        |                                     |                                  |                           | 6,651 % éch. 13/11/2028                                                          | 5 400                               | 6 562                            | 0,10                      |
| Wynn Macau Ltd.<br>6,750 % éch. 15/02/2034                                            | 12 400                              | 12 328                           | 0,18                      | Banco Davivienda S.A.<br>8,125 % éch. 02/07/2035 (j)                             | 7 700                               | 7 989                            | 0,12                      | Total République tchèque                                                         |                                     | 13 615                           | 0,20                      |
|                                                                                       |                                     | 276 944                          | 4,09                      | Ecopetrol S.A.<br>5,875 % éch. 28/05/2045                                        | 500                                 | 413                              | 0,01                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Total Îles Caimans                                                                    |                                     | 277 128                          | 4,09                      | 5,875 % éch. 02/11/2051                                                          | 4 200                               | 3 370                            | 0,05                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| CHILI<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 29/04/2030                                                          | 200                                 | 204                              | 0,00                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| AES Andes S.A.<br>6,250 % éch. 14/03/2032                                             | 3 516                               | 3 652                            | 0,05                      | 7,375 % éch. 18/09/2043                                                          | 300                                 | 296                              | 0,00                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,300 % éch. 15/03/2029                                                               | 1 375                               | 1 407                            | 0,02                      | 7,750 % éch. 01/02/2032                                                          | 2 300                               | 2 410                            | 0,04                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 8,150 % éch. 10/06/2055                                                               | 11 100                              | 11 594                           | 0,17                      | 8,375 % éch. 19/01/2036                                                          | 4 070                               | 4 411                            | 0,07                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Banco del Estado de Chile<br>7,950 % éch. 02/05/2029 (g)(i)                           | 6 200                               | 6 557                            | 0,10                      | Grupo Energia Bogota S.A. ESP<br>5,750 % éch. 22/10/2035                         | 7 100                               | 6 947                            | 0,10                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile<br>4,500 % éch. 01/08/2047                          | 3 200                               | 2 592                            | 0,04                      | Grupo Nutresa S.A.<br>8,000 % éch. 12/05/2030                                    | 10 400                              | 11 031                           | 0,16                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 04/11/2044                                                               | 5 900                               | 5 135                            | 0,08                      | Promigas S.A. ESP<br>7,750 % éch. 24/06/2056                                     | 4 700                               | 4 782                            | 0,07                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 02/02/2033                                                               | 2 800                               | 2 776                            | 0,04                      |                                                                                  |                                     | 41 853                           | 0,62                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 08/01/2034                                                               | 5 450                               | 5 620                            | 0,08                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,300 % éch. 08/09/2053                                                               | 18 800                              | 19 293                           | 0,28                      | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>3,000 % éch. 30/01/2030   | 3 750                               | 3 427                            | 0,05                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,330 % éch. 13/01/2035                                                               | 18 400                              | 19 367                           | 0,29                      | 3,125 % éch. 15/04/2031                                                          | 6 207                               | 5 499                            | 0,08                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,440 % éch. 26/01/2036                                                               | 10 550                              | 11 206                           | 0,17                      | 3,250 % éch. 22/04/2032                                                          | 4 300                               | 3 737                            | 0,05                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,780 % éch. 13/01/2055                                                               | 13 100                              | 14 136                           | 0,21                      | 3,750 % éch. 19/09/2028                                                          | € 5 831                             | 6 633                            | 0,10                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Embotelladora Andina S.A.<br>3,950 % éch. 21/01/2050                                  | 3 700                               | 2 835                            | 0,04                      | 4,500 % éch. 15/03/2029                                                          | \$ 4 900                            | 4 775                            | 0,07                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 26/11/2030                                                          | € 8 700                             | 9 981                            | 0,15                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |

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

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>REPUBLIQUE DOMINICAINE</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 23/09/2032                                             | \$ 10 200                           | \$ 9 709                         | 0,14                      |
| 5,300 % éch. 21/01/2041                                             | 7 500                               | 6 764                            | 0,10                      |
| 5,500 % éch. 22/02/2029                                             | 4 700                               | 4 712                            | 0,07                      |
| 5,875 % éch. 28/10/2035                                             | 16 800                              | 16 638                           | 0,25                      |
| 5,875 % éch. 30/01/2060                                             | 19 600                              | 17 356                           | 0,26                      |
| 6,000 % éch. 19/07/2028                                             | 11 800                              | 11 972                           | 0,18                      |
| 6,000 % éch. 22/02/2033                                             | 12 000                              | 12 114                           | 0,18                      |
| 6,600 % éch. 01/06/2036                                             | 1 950                               | 2 038                            | 0,03                      |
| 6,950 % éch. 15/03/2037                                             | 14 300                              | 15 190                           | 0,22                      |
| 7,150 % éch. 24/02/2055                                             | 6 600                               | 7 026                            | 0,10                      |
| 7,450 % éch. 30/04/2044                                             | 100                                 | 109                              | 0,00                      |
| 8,625 % éch. 20/04/2027                                             | 333                                 | 343                              | 0,01                      |
| 10,500 % éch. 15/03/2037                                            | DOP 1 076 150                       | 19 295                           | 0,28                      |
| 10,750 % éch. 01/06/2036                                            | 263 600                             | 4 795                            | 0,07                      |
| 11,250 % éch. 15/09/2035                                            | 11 900                              | 222                              | 0,00                      |
| 13,625 % éch. 10/02/2034                                            | 286 500                             | 5 857                            | 0,09                      |
| Total République dominicaine                                        |                                     | 134 140                          | 1,98                      |
| <b>ÉQUATEUR</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Corp. Quiport S.A.                                                  |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 15/12/2037                                             | \$ 1 500                            | 1 650                            | 0,02                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement équatorien                |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 31/07/2030 (d)(k)                                                   | 13 088                              | 11 321                           | 0,17                      |
| 5,000 % éch. 31/07/2040                                             | 13 043                              | 10 969                           | 0,16                      |
| 6,900 % éch. 31/07/2035                                             | 23 884                              | 21 978                           | 0,33                      |
| 8,750 % éch. 29/01/2034                                             | 5 300                               | 5 370                            | 0,08                      |
| 9,250 % éch. 29/01/2039                                             | 6 200                               | 6 366                            | 0,09                      |
| Ecuador Social Bond SARL                                            |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 30/01/2035 (d)                                         | 336                                 | 250                              | 0,00                      |
|                                                                     |                                     | 56 254                           | 0,83                      |
| Total Équateur                                                      |                                     | 57 904                           | 0,85                      |
| <b>ÉGYPTE</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien                  |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 16/04/2030                                             | € 1 670                             | 1 905                            | 0,03                      |
| 6,375 % éch. 11/04/2031                                             | 29 200                              | 34 055                           | 0,50                      |
| 7,053 % éch. 15/01/2032                                             | \$ 4 200                            | 4 216                            | 0,06                      |
| 7,500 % éch. 31/01/2027                                             | 7 100                               | 7 176                            | 0,11                      |
| 7,500 % éch. 16/02/2061                                             | 4 200                               | 3 637                            | 0,06                      |
| 7,625 % éch. 29/05/2032                                             | 2 200                               | 2 258                            | 0,03                      |
| 7,903 % éch. 21/02/2048                                             | 19 500                              | 17 923                           | 0,27                      |
| 8,150 % éch. 20/11/2059                                             | 2 400                               | 2 221                            | 0,03                      |
| 8,500 % éch. 31/01/2047                                             | 15 900                              | 15 603                           | 0,23                      |
| 8,625 % éch. 04/02/2030                                             | 3 800                               | 4 068                            | 0,06                      |
| 8,750 % éch. 30/09/2051                                             | 2 000                               | 1 983                            | 0,03                      |
| 8,875 % éch. 29/05/2050                                             | 700                                 | 700                              | 0,01                      |
| 9,450 % éch. 04/02/2033                                             | 13 000                              | 14 454                           | 0,21                      |
| 19,698 % éch. 14/10/2030                                            | EGP 746 100                         | 14 458                           | 0,21                      |
| 21,954 % éch. 04/03/2028                                            | 2 191 300                           | 43 239                           | 0,64                      |
| Total Égypte                                                        |                                     | 167 896                          | 2,48                      |
| <b>SALVADOR</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Comision Ejecutiva Hidroeléctrica del Rio Lempa                     |                                     |                                  |                           |
| 8,650 % éch. 24/01/2033                                             | \$ 13 600                           | 14 383                           | 0,21                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement salvadorien               |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 18/01/2027                                             | 900                                 | 904                              | 0,01                      |
| 7,125 % éch. 20/01/2050                                             | 219                                 | 204                              | 0,00                      |
| 8,625 % éch. 28/02/2029                                             | 140                                 | 148                              | 0,00                      |
| 9,250 % éch. 17/04/2030                                             | 250                                 | 270                              | 0,01                      |
| 9,500 % éch. 15/07/2052                                             | 6 200                               | 7 021                            | 0,10                      |
| 9,650 % éch. 21/11/2054                                             | 6 700                               | 7 699                            | 0,12                      |
|                                                                     |                                     | 16 246                           | 0,24                      |
| Total Salvador                                                      |                                     | 30 629                           | 0,45                      |
| <b>FRANCE</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Orange S.A.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 13/01/2033                                             | 2 800                               | 2 748                            | 0,04                      |

| DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 5,000 % éch. 13/01/2036                                 | \$ 9 800                            | \$ 9 577                         | 0,14                      |
| Total France                                            |                                     | 12 325                           | 0,18                      |
| <b>GABON</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement gabonais      |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 06/02/2031                                 | 400                                 | 345                              | 0,01                      |
| 9,500 % éch. 18/02/2029                                 | 15 900                              | 15 208                           | 0,22                      |
| Total Gabon                                             |                                     | 15 553                           | 0,23                      |
| <b>GÉORGIE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| Georgian Railway JSC                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 17/06/2028                                 | 300                                 | 288                              | 0,00                      |
| <b>GHANA</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement ghanéen       |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 03/07/2026 (d)                             | \$ 413                              | 412                              | 0,01                      |
| 0,000 % éch. 03/01/2030 (d)                             | 2 124                               | 1 908                            | 0,03                      |
| 5,000 % éch. 03/07/2029                                 | 29 395                              | 29 088                           | 0,43                      |
| 5,000 % éch. 03/07/2035                                 | 2 217                               | 2 058                            | 0,03                      |
| 8,500 % éch. 15/02/2028                                 | GHS 39 148                          | 3 262                            | 0,05                      |
| 8,650 % éch. 13/02/2029                                 | 20 504                              | 1 641                            | 0,02                      |
| 8,800 % éch. 12/02/2030                                 | 8 025                               | 613                              | 0,01                      |
| 8,950 % éch. 11/02/2031                                 | 39 874                              | 2 936                            | 0,04                      |
| 9,100 % éch. 10/02/2032                                 | 29 170                              | 2 081                            | 0,03                      |
| 9,250 % éch. 08/02/2033                                 | 30 000                              | 2 094                            | 0,03                      |
| 9,850 % éch. 03/02/2037                                 | 1 445                               | 95                               | 0,00                      |
| Total Ghana                                             |                                     | 46 188                           | 0,68                      |
| <b>GUATEMALA</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| Industrial Subordinated Trust 2.0                       |                                     |                                  |                           |
| 6,550 % éch. 15/04/2036                                 | \$ 9 600                            | 9 755                            | 0,15                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement guatémaltèque |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 05/06/2027                                 | 15 535                              | 15 509                           | 0,23                      |
| 4,650 % éch. 07/10/2041                                 | 800                                 | 701                              | 0,01                      |
| 4,875 % éch. 13/02/2028                                 | 13 685                              | 13 678                           | 0,20                      |
| 6,050 % éch. 06/08/2031                                 | 2 400                               | 2 470                            | 0,04                      |
| 6,250 % éch. 15/08/2036                                 | 7 300                               | 7 638                            | 0,11                      |
| 6,550 % éch. 06/02/2037                                 | 6 700                               | 7 169                            | 0,10                      |
| 6,600 % éch. 13/06/2036                                 | 8 700                               | 9 290                            | 0,14                      |
| 6,875 % éch. 15/08/2055                                 | 5 600                               | 6 114                            | 0,09                      |
| 8,125 % éch. 06/10/2034                                 | 1 708                               | 1 982                            | 0,03                      |
|                                                         |                                     | 64 551                           | 0,95                      |
| Total Guatemala                                         |                                     | 74 306                           | 1,10                      |
| <b>HONG KONG</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| AIA Group Ltd.                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,200 % éch. 16/09/2040                                 | 900                                 | 694                              | 0,01                      |
| Fortune Star BVI Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 27/01/2027                                 | 3 900                               | 3 861                            | 0,06                      |
| 6,800 % éch. 09/09/2029                                 | 2 500                               | 2 476                            | 0,04                      |
| 8,500 % éch. 19/05/2028                                 | 7 600                               | 7 808                            | 0,11                      |
| Total Hong Kong                                         |                                     | 14 839                           | 0,22                      |
| <b>HONGRIE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| MVM Energetika Zrt                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 09/06/2028                                 | 5 500                               | 5 737                            | 0,09                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois      |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 21/09/2051 (k)                             | 2 500                               | 1 603                            | 0,02                      |
| 4,000 % éch. 25/07/2029 (k)                             | € 13 650                            | 15 989                           | 0,24                      |
| 5,250 % éch. 16/06/2029 (k)                             | \$ 12 200                           | 12 363                           | 0,18                      |
| 5,375 % éch. 26/09/2030 (k)                             | 9 700                               | 9 855                            | 0,14                      |
| 5,500 % éch. 16/06/2034 (k)                             | 700                                 | 713                              | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 26/03/2036 (k)                             | 9 100                               | 9 150                            | 0,13                      |
| 6,000 % éch. 26/09/2035 (k)                             | 9 100                               | 9 473                            | 0,14                      |
| 6,125 % éch. 22/05/2028 (k)                             | 18 600                              | 19 073                           | 0,28                      |

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,250 % éch. 22/09/2032 (k)                               | \$ 4 300                            | \$ 4 551                         | 0,07                      |
| 6,750 % éch. 23/09/2055 (k)                               | 5 500                               | 6 001                            | 0,09                      |
| 7,625 % éch. 29/03/2041 (k)                               | 4 300                               | 5 113                            | 0,08                      |
| Magyar Export-Import Bank                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 16/05/2029                                   | € 8 850                             | 10 770                           | 0,16                      |
| Magyar Fejlesztési Bank Zrt                               |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 29/06/2028                                   | \$ 13 700                           | 14 117                           | 0,21                      |
|                                                           |                                     | 118 771                          | 1,75                      |
| Total Hongrie                                             |                                     | 124 508                          | 1,84                      |
| <b>INDE</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                                     |                                  |                           |
| IIFL Finance Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 24/07/2028                                   | 6 300                               | 6 490                            | 0,10                      |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.                        |                                     |                                  |                           |
| 7,110 % éch. 11/03/2032                                   | 7 500                               | 7 604                            | 0,11                      |
| Muthoot Finance Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 02/03/2030                                   | 13 200                              | 13 184                           | 0,20                      |
| Sammaan Capital Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 16/10/2030                                   | 6 989                               | 7 076                            | 0,10                      |
| Total Inde                                                |                                     | 34 354                           | 0,51                      |
| <b>INDONÉSIE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                      |                                     |                                  |                           |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT                               |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 24/03/2028                                   | 10 700                              | 10 679                           | 0,16                      |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT                      |                                     |                                  |                           |
| 7,150 % éch. 22/10/2031 (g)(i)                            | 19 200                              | 19 186                           | 0,28                      |
| Danantara Investment Management PT                        |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 18/06/2031                                   | 18 400                              | 18 381                           | 0,27                      |
| 5,950 % éch. 18/06/2036                                   | 16 500                              | 16 468                           | 0,24                      |
| Freeport Indonesia PT                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 14/04/2052                                   | 8 775                               | 8 591                            | 0,13                      |
| Indonesia Asahan Aluminium PT                             |                                     |                                  |                           |
| 5,450 % éch. 15/05/2030                                   | 11 800                              | 11 883                           | 0,18                      |
| 5,800 % éch. 15/05/2050                                   | 3 800                               | 3 593                            | 0,05                      |
| LLPL Capital Pte. Ltd.                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 04/02/2039                                   | 4 178                               | 4 246                            | 0,06                      |
| Pelabuhan Indonesia Persero PT                            |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 05/05/2045 (k)                               | 3 693                               | 3 440                            | 0,05                      |
| Pertamina Hulu Energi PT                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 21/05/2030                                   | 10 000                              | 9 986                            | 0,15                      |
| Pertamina Persero PT                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 03/05/2042                                   | 10 800                              | 10 537                           | 0,16                      |
| 6,450 % éch. 30/05/2044                                   | 8 200                               | 8 368                            | 0,12                      |
| 6,500 % éch. 07/11/2048                                   | 2 900                               | 2 958                            | 0,04                      |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 30/06/2050                                   | 27 200                              | 18 953                           | 0,28                      |
| 4,375 % éch. 05/02/2050                                   | 5 800                               | 4 338                            | 0,06                      |
| 4,750 % éch. 03/02/2031                                   | 8 500                               | 8 293                            | 0,12                      |
| 5,250 % éch. 24/10/2042                                   | 5 300                               | 4 723                            | 0,07                      |
| 5,250 % éch. 15/05/2047                                   | 12 100                              | 10 480                           | 0,16                      |
| 5,450 % éch. 03/02/2036                                   | 7 800                               | 7 469                            | 0,11                      |
| 6,150 % éch. 21/05/2048                                   | 5 800                               | 5 549                            | 0,08                      |
| 6,250 % éch. 25/01/2049                                   | 12 500                              | 12 210                           | 0,18                      |
|                                                           |                                     | 200 331                          | 2,95                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                              |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien      |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/01/2033                                   | € 6 700                             | 7 554                            | 0,11                      |
| 4,100 % éch. 04/03/2034                                   | 300                                 | 337                              | 0,01                      |
| 4,125 % éch. 15/01/2037                                   | 14 100                              | 15 494                           | 0,23                      |
| 4,460 % éch. 04/03/2038                                   | 17 400                              | 19 361                           | 0,29                      |
| 5,125 % éch. 29/05/2038                                   | 7 750                               | 9 112                            | 0,13                      |
| 5,350 % éch. 11/02/2049                                   | \$ 200                              | 192                              | 0,00                      |
| 5,650 % éch. 11/01/2053                                   | 800                                 | 785                              | 0,01                      |
| 5,690 % éch. 29/05/2036                                   | 10 300                              | 10 524                           | 0,16                      |
| 6,750 % éch. 15/01/2044                                   | 2 300                               | 2 550                            | 0,04                      |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                        |                                     |                                  |                           |
| 3,800 % éch. 23/06/2050                                   | 6 600                               | 4 875                            | 0,07                      |
| 5,650 % éch. 25/11/2054                                   | 900                                 | 883                              | 0,01                      |
|                                                           |                                     | 71 667                           | 1,06                      |
| Total Indonésie                                           |                                     | 271 998                          | 4,01                      |



| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>INTERNATIONALES</b>                 |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b> |                                     |                                  |                           |
| République du Sénégal                  |                                     |                                  |                           |
| 8,407 % éch. 22/12/2028                | € 7 050                             | \$ 4 156                         | 0,06                      |
| State Oil, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| 6,232 % éch. 22/07/2030                | \$ 4 400                            | 4 387                            | 0,07                      |
| Total Internationales                  |                                     | 8 543                            | 0,13                      |

|                                                   |       |       |      |
|---------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>IRAK</b>                                       |       |       |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                      |       |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement irakien |       |       |      |
| 5,800 % éch. 15/01/2028 (k)                       | 1 425 | 1 415 | 0,02 |

|                                      |          |        |      |
|--------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>IRLANDE</b>                       |          |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |          |        |      |
| CIMA Finance DAC                     |          |        |      |
| 2,950 % éch. 05/09/2029              | 7 852    | 7 467  | 0,11 |
| Iridium Capital PLC                  |          |        |      |
| 9,250 % éch. 18/06/2029              | € 20 700 | 25 719 | 0,38 |
| Quercus Re DAC                       |          |        |      |
| 10,149 % éch. 06/01/2031             | 250      | 290    | 0,01 |
| 13,324 % éch. 07/01/2031             | 300      | 348    | 0,01 |
| Recoletos RE DAC                     |          |        |      |
| 5,289 % éch. 06/07/2032              | \$ 250   | 250    | 0,00 |
| Windmill Re DAC                      |          |        |      |
| 7,285 % éch. 05/07/2028              | € 250    | 294    | 0,00 |
| Yardstick RE DAC                     |          |        |      |
| 4,274 % éch. 08/07/2034              | 250      | 286    | 0,00 |
|                                      |          | 34 654 | 0,51 |

|                                        |        |        |      |
|----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b> |        |        |      |
| République du Panama                   |        |        |      |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                | 22 400 | 25 649 | 0,38 |

|                                                  |          |        |      |
|--------------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                     |          |        |      |
| Avenir Issuer Ireland DAC                        |          |        |      |
| 6,000 % éch. 22/03/2027                          | \$ 3 316 | 3 283  | 0,05 |
| 6,000 % éch. 25/10/2027                          | 3 223    | 3 188  | 0,05 |
| Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC |          |        |      |
| 6,927 % éch. 19/02/2027                          | 5 661    | 5 633  | 0,08 |
| 10,750 % éch. 26/06/2028                         | 15 225   | 15 591 | 0,23 |
| 10,750 % éch. 15/09/2028                         | 2 309    | 2 367  | 0,03 |
| 10,750 % éch. 05/02/2029                         | 813      | 835    | 0,01 |
|                                                  |          | 30 897 | 0,45 |
| Total Irlande                                    |          | 91 200 | 1,34 |

|                                      |        |        |      |
|--------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>ÎLE DE MAN</b>                    |        |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |        |      |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC       |        |        |      |
| 6,500 % éch. 15/04/2040              | 200    | 210    | 0,00 |
| Gohl Capital Holdings Ltd.           |        |        |      |
| 7,625 % éch. 29/10/2031 (g)          | 16 200 | 15 706 | 0,23 |
| 8,300 % éch. 29/04/2036 (g)          | 9 000  | 8 673  | 0,13 |
| Total Île de Man                     |        | 24 589 | 0,36 |

|                                      |        |        |      |
|--------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>ISRAËL</b>                        |        |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |        |      |
| Bank Hapoalim B.M.                   |        |        |      |
| 3,255 % éch. 21/01/2032 (i)          | 3 400  | 3 372  | 0,05 |
| 5,252 % éch. 14/01/2033              | 11 500 | 11 390 | 0,17 |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.            |        |        |      |
| 5,642 % éch. 29/06/2033              | 9 300  | 9 351  | 0,14 |
| ICL Group Ltd.                       |        |        |      |
| 6,036 % éch. 16/06/2036              | 13 200 | 13 201 | 0,19 |
| Israel Electric Corp. Ltd.           |        |        |      |
| 4,250 % éch. 14/08/2028              | 4 800  | 4 722  | 0,07 |
| 5,633 % éch. 28/01/2038              | 8 200  | 8 174  | 0,12 |
| 7,750 % éch. 15/12/2027              | 1 480  | 1 540  | 0,02 |
| Leviathan Bond Ltd.                  |        |        |      |
| 6,500 % éch. 30/06/2027              | 5 500  | 5 524  | 0,08 |
|                                      |        | 57 274 | 0,84 |

| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement israélien |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 15/01/2030                             | \$ 1 000                            | \$ 921                           | 0,02                      |
| 2,750 % éch. 03/07/2030                             | 3 800                               | 3 494                            | 0,05                      |
| 5,375 % éch. 19/02/2030                             | 9 500                               | 9 634                            | 0,14                      |
|                                                     |                                     | 14 049                           | 0,21                      |
| Total Israël                                        |                                     | 71 323                           | 1,05                      |

|                               |       |       |      |
|-------------------------------|-------|-------|------|
| <b>ITALIE</b>                 |       |       |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>  |       |       |      |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA |       |       |      |
| 5,875 % éch. 30/04/2029       | 3 000 | 3 099 | 0,05 |

|                             |         |        |      |
|-----------------------------|---------|--------|------|
| <b>CÔTE D'IVOIRE</b>        |         |        |      |
| République de Côte d'Ivoire |         |        |      |
| 4,912 % éch. 09/03/2027     | € 5 000 | 5 738  | 0,08 |
| 5,185 % éch. 05/03/2027     | 25 000  | 28 697 | 0,42 |
| 7,047 % éch. 10/09/2032     | 8 000   | 9 146  | 0,14 |
|                             |         | 43 581 | 0,64 |

|                                                    |           |        |      |
|----------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |           |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement ivoirien |           |        |      |
| 4,875 % éch. 30/01/2032                            | 8 019     | 9 070  | 0,14 |
| 5,250 % éch. 22/03/2030                            | 3 594     | 4 166  | 0,06 |
| 5,875 % éch. 17/10/2031                            | 3 070     | 3 619  | 0,05 |
| 6,625 % éch. 22/03/2048                            | 5 600     | 6 195  | 0,09 |
| 6,875 % éch. 17/10/2040                            | 2 250     | 2 648  | 0,04 |
| 8,075 % éch. 01/04/2036                            | \$ 10 600 | 11 615 | 0,17 |
| 8,250 % éch. 30/01/2037                            | 6 500     | 7 197  | 0,11 |
|                                                    |           | 44 510 | 0,66 |
| Total Côte d'Ivoire                                |           | 88 091 | 1,30 |

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>JAMAÏQUE</b>                      |       |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |       |       |      |
| TransJamaican Highway Ltd.           |       |       |      |
| 5,750 % éch. 10/10/2036              | 2 966 | 2 751 | 0,04 |

|                                      |         |       |      |
|--------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>  |         |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |         |       |      |
| GSG Bidco Ltd.                       |         |       |      |
| 4,700 % éch. 15/06/2031              | € 3 800 | 4 309 | 0,06 |
| 5,375 % éch. 15/06/2036              | 4 100   | 4 653 | 0,07 |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes   |         | 8 962 | 0,13 |

|                                                     |          |       |      |
|-----------------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>JORDANIE</b>                                     |          |       |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |          |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement jordanien |          |       |      |
| 5,750 % éch. 31/01/2027                             | \$ 7 400 | 7 454 | 0,11 |

|                                               |       |        |      |
|-----------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>KAZAKHSTAN</b>                             |       |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>          |       |        |      |
| Kaspi.KZ JSC                                  |       |        |      |
| 5,900 % éch. 28/04/2031                       | 4 900 | 4 896  | 0,07 |
| KazMunayGas National Co. JSC                  |       |        |      |
| 3,500 % éch. 14/04/2033                       | 2 200 | 1 996  | 0,03 |
| 5,750 % éch. 19/04/2047                       | 5 893 | 5 625  | 0,09 |
| 6,375 % éch. 24/10/2048                       | 2 847 | 2 866  | 0,04 |
| Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. |       |        |      |
| 3,250 % éch. 15/08/2030                       | 5 000 | 4 642  | 0,07 |
| 4,000 % éch. 15/08/2026                       | 150   | 150    | 0,00 |
|                                               |       | 20 175 | 0,30 |

|                                                  |           |        |      |
|--------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                     |           |        |      |
| Baiterek National Investment Holding JSC         |           |        |      |
| 5,450 % éch. 08/05/2028                          | 9 800     | 9 897  | 0,15 |
| 16,950 % éch. 02/04/2029 KZT                     | 5 209 000 | 11 069 | 0,16 |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                         | 3 621 500 | 7 798  | 0,11 |
| Development Bank of Kazakhstan JSC               |           |        |      |
| 18,400 % éch. 16/10/2028                         | 5 050 000 | 10 999 | 0,16 |
| Obligation internationale du gouvernement kazakh |           |        |      |
| 4,875 % éch. 14/10/2044                          | \$ 1 200  | 1 098  | 0,02 |
|                                                  |           | 40 861 | 0,60 |
| Total Kazakhstan                                 |           | 61 036 | 0,90 |

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>KENYA</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| République du Kenya                                                 |                                     |                                  |                           |
| 9,086 % éch. 05/04/2028                                             | \$ 4 133                            | \$ 4 150                         | 0,06                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République du Kenya |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 09/10/2033                                             | 9 800                               | 9 895                            | 0,15                      |
| 8,800 % éch. 09/10/2038                                             | 7 000                               | 7 058                            | 0,10                      |
| 9,500 % éch. 05/03/2036                                             | 18 900                              | 20 119                           | 0,30                      |
| 9,750 % éch. 16/02/2031                                             | 19 200                              | 20 920                           | 0,31                      |
|                                                                     |                                     | 57 992                           | 0,86                      |
| Total Kenya                                                         |                                     | 62 142                           | 0,92                      |

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>KOWEÏT</b>                        |       |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |       |       |      |
| National Bank of Kuwait SAKP         |       |       |      |
| 5,250 % éch. 10/02/2036 (i)          | 6 000 | 5 954 | 0,09 |

|                                                     |        |        |      |
|-----------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |        |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït |        |        |      |
| 3,500 % éch. 20/03/2027                             | 4 300  | 4 278  | 0,07 |
| 4,652 % éch. 09/10/2035                             | 32 700 | 31 973 | 0,47 |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (j)                         | 25 300 | 25 257 | 0,37 |
|                                                     |        | 61 508 | 0,91 |
| Total Koweït                                        |        | 67 462 | 1,00 |

|                                      |        |        |      |
|--------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>KIRGHIZISTAN</b>                  |        |        |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |        |      |
| Eldik Bank OAO                       |        |        |      |
| 8,500 % éch. 23/04/2031              | 10 700 | 10 739 | 0,16 |

|                                                  |        |        |      |
|--------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>LETTONIE</b>                                  |        |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                     |        |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement letton |        |        |      |
| 5,125 % éch. 30/07/2034                          | 10 600 | 10 730 | 0,16 |

|                                                    |        |        |      |
|----------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>LIBAN</b>                                       |        |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |        |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement libanais |        |        |      |
| 5,800 % éch. 14/04/2020 ^                          | 5 000  | 1 235  | 0,02 |
| 6,100 % éch. 04/10/2022 ^                          | 6 000  | 1 485  | 0,02 |
| 6,375 % éch. 09/03/2020 ^                          | 2 700  | 666    | 0,01 |
| 6,400 % éch. 26/05/2023 ^                          | 15 700 | 3 891  | 0,06 |
| 6,600 % éch. 27/11/2026 ^                          | 15 000 | 3 742  | 0,05 |
| 6,850 % éch. 23/03/2027 ^                          | 14 600 | 3 654  | 0,05 |
| 8,250 % éch. 12/04/2021 ^                          | 6 700  | 1 798  | 0,03 |
| 8,250 % éch. 17/05/2034 ^                          | 10 000 | 2 664  | 0,04 |
| Total Liban                                        |        | 19 135 | 0,28 |

|                                                     |         |        |      |
|-----------------------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>LITUANIE</b>                                     |         |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |         |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement lituanien |         |        |      |
| 4,125 % éch. 22/01/2041                             | € 8 900 | 10 201 | 0,15 |

|                              |         |        |      |
|------------------------------|---------|--------|------|
| <b>LUXEMBOURG</b>            |         |        |      |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>    |         |        |      |
| DrillCo Holding Lux S.A. (j) | 364 034 | 8 342  | 0,12 |
| Foresea Holding S.A.         | 143 033 | 3 278  | 0,05 |
|                              |         | 11 620 | 0,17 |

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |
| Chile Electricity Lux MPC SARL       |                                     |                                  |                           |
| 5,580 % éch. 20/10/2035              | \$ 7 429                            | 7 553                            | 0,11                      |
| 5,672 % éch. 20/10/2035              | 2 718                               | 2 781                            | 0,04                      |
| FORESEA Holding S.A.                 |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/06/2030              | 6 316                               | 6 239                            | 0,09                      |
| Green Palm Bidco SARL                |                                     |                                  |                           |
| 5,957 % éch. 30/06/2041              | 7 000                               | 7 078                            | 0,10                      |
| 6,462 % éch. 30/06/2046              | 7 100                               | 7 197                            | 0,11                      |

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

| DESCRIPTION                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Greensail Pipelines Bidco SARL |                                     |                                  |                           |
| 5,853 % éch. 23/02/2036        | \$ 4 900                            | \$ 5 006                         | 0,07                      |
| 6,103 % éch. 23/08/2042        | 7 000                               | 7 149                            | 0,11                      |
| 6,129 % éch. 23/02/2038        | 4 700                               | 4 870                            | 0,07                      |
| 6,510 % éch. 23/02/2042        | 2 800                               | 2 960                            | 0,04                      |
| 6,510 % éch. 23/02/2042 (k)    | 1 800                               | 1 903                            | 0,03                      |
| Guara Norte SARL               |                                     |                                  |                           |
| 5,198 % éch. 15/06/2034        | 5 140                               | 4 971                            | 0,07                      |
| Kernel Holding S.A.            |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 27/10/2027        | 2 200                               | 2 147                            | 0,03                      |
| Luminis S.A.                   |                                     |                                  |                           |
| 9,649 % éch. 15/09/2038        | 25 900                              | 30 251                           | 0,45                      |
| MHP Lux S.A.                   |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 19/09/2029        | 4 800                               | 4 469                            | 0,07                      |
| 10,500 % éch. 28/07/2029       | 3 700                               | 3 859                            | 0,06                      |
| Poinsettia Finance Ltd.        |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 17/06/2031        | 8 869                               | 8 740                            | 0,13                      |
| PRIO Luxembourg Holding SARL   |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 15/10/2030        | 12 350                              | 12 118                           | 0,18                      |
| Virtuo2 Finance SARL           |                                     |                                  |                           |
| 7,930 % éch. 12/01/2034        | € 10 300                            | 14 214                           | 0,21                      |
|                                |                                     | 133 505                          | 1,97                      |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                          |           |         |      |
|--------------------------|-----------|---------|------|
| Eagle Funding Luxco SARL | \$ 36 700 | 36 895  | 0,54 |
| 5,500 % éch. 17/08/2030  |           |         |      |
| Total Luxembourg         |           | 182 020 | 2,68 |

### MACÉDOINE DU NORD

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                                |         |       |      |
|----------------------------------------------------------------|---------|-------|------|
| Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du Nord |         |       |      |
| 6,960 % éch. 13/03/2027                                        | € 7 000 | 8 141 | 0,12 |

### MALAISIE

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                         |          |        |      |
|-------------------------|----------|--------|------|
| Axiata SPV2 Bhd.        |          |        |      |
| 2,163 % éch. 19/08/2030 | \$ 1 900 | 1 721  | 0,02 |
| Khazanah Capital Ltd.   |          |        |      |
| 4,876 % éch. 01/06/2033 | 2 900    | 2 933  | 0,04 |
| Petronas Capital Ltd.   |          |        |      |
| 4,500 % éch. 18/03/2045 | 400      | 355    | 0,01 |
| 4,550 % éch. 21/04/2050 | 9 200    | 8 044  | 0,12 |
|                         |          | 13 053 | 0,19 |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                     |        |        |      |
|-------------------------------------|--------|--------|------|
| Export-Import Bank of Malaysia Bhd. |        |        |      |
| 4,250 % éch. 06/06/2029             | 18 100 | 17 759 | 0,26 |
| Total Malaisie                      |        | 30 812 | 0,45 |

### ACTIONS

### MEXIQUE

#### ACTIONS ORDINAIRES

|                                        |        |   |      |
|----------------------------------------|--------|---|------|
| Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (c) | 39 443 | 0 | 0,00 |
|----------------------------------------|--------|---|------|

VALEUR  
NOMINALE  
(en milliers)

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                         |          |        |      |
|-----------------------------------------|----------|--------|------|
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC | \$ 7 100 | 7 054  | 0,10 |
| 6,000 % éch. 14/05/2036                 |          |        |      |
| Banco Nacional de Mexico S.A.           |          |        |      |
| 6,697 % éch. 07/08/2036 (i)             | 2 900    | 2 860  | 0,04 |
| 6,697 % éch. 07/08/2036 (i)(j)          | 26 200   | 25 837 | 0,38 |
| BBVA Bancomer S.A.                      |          |        |      |
| 7,625 % éch. 11/02/2035 (i)             | 11 700   | 12 092 | 0,18 |
| 8,450 % éch. 29/06/2038 (i)             | 2 400    | 2 591  | 0,04 |
| CFE Fibra                               |          |        |      |
| 5,875 % éch. 23/09/2040                 | 4 274    | 4 171  | 0,06 |
| Comision Federal de Electricidad        |          |        |      |
| 6,500 % éch. 28/01/2051                 | 2 000    | 1 955  | 0,03 |
| Corp. GEO S.A.B. de C.V.                |          |        |      |
| 8,875 % éch. 25/09/2014 ^               | 13 920   | 0      | 0,00 |
| 9,250 % éch. 30/06/2020 ^               | 1 000    | 0      | 0,00 |

| DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| COX Asset Mexico S.A. de C.V.             |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 08/01/2032                   | \$ 8 000                            | \$ 8 125                         | 0,12                      |
| 7,750 % éch. 08/05/2036                   | 7 700                               | 7 885                            | 0,12                      |
| Esentia Energy Development S.A.B. de C.V. |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 30/07/2033                   | 1 700                               | 1 697                            | 0,03                      |
| Industrias Penoles S.A.B. de C.V.         |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 06/08/2050                   | 1 700                               | 1 398                            | 0,02                      |
| Minera Mexico S.A. de C.V.                |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 12/02/2032                   | 3 300                               | 3 340                            | 0,05                      |
| Petroleos Mexicanos                       |                                     |                                  |                           |
| 6,350 % éch. 12/02/2048                   | 27 367                              | 22 577                           | 0,33                      |
| 6,375 % éch. 23/01/2045                   | 13 050                              | 11 134                           | 0,16                      |
| 6,625 % éch. 15/06/2035 (k)               | 7 450                               | 7 238                            | 0,11                      |
| 6,625 % éch. 15/06/2038                   | 200                                 | 186                              | 0,00                      |
| 6,750 % éch. 21/09/2047                   | 16 980                              | 14 547                           | 0,21                      |
| 6,840 % éch. 23/01/2030                   | 278                                 | 286                              | 0,00                      |
| 6,950 % éch. 28/01/2060                   | 35 847                              | 30 177                           | 0,45                      |
| 7,690 % éch. 23/01/2050                   | 98 436                              | 91 878                           | 1,36                      |
|                                           |                                     | 257 028                          | 3,79                      |

### CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                       |        |        |      |
|-----------------------|--------|--------|------|
| Petroleos Mexicanos   |        |        |      |
| TBD % éch. 30/11/2026 | 20 703 | 20 703 | 0,30 |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                    |           |         |      |
|----------------------------------------------------|-----------|---------|------|
| Obligation internationale du gouvernement mexicain |           |         |      |
| 3,000 % éch. 03/12/2026 (f) MXN                    | 1 441     | 82      | 0,00 |
| 3,750 % éch. 19/04/2071                            | \$ 12 600 | 7 270   | 0,11 |
| 3,771 % éch. 24/05/2061                            | 8 400     | 5 057   | 0,08 |
| 4,750 % éch. 22/03/2031                            | 1 600     | 1 563   | 0,02 |
| 4,750 % éch. 08/03/2044                            | 300       | 242     | 0,00 |
| 4,875 % éch. 19/05/2033                            | 29 950    | 28 453  | 0,42 |
| 5,000 % éch. 27/04/2051                            | 6 800     | 5 382   | 0,08 |
| 5,125 % éch. 19/03/2038                            | € 6 900   | 7 858   | 0,12 |
| 5,375 % éch. 22/03/2033                            | \$ 15 200 | 14 904  | 0,22 |
| 5,625 % éch. 09/02/2034                            | 15 300    | 15 074  | 0,22 |
| 5,625 % éch. 22/09/2035                            | 15 000    | 14 603  | 0,22 |
| 5,750 % éch. 12/10/2110                            | 49 150    | 40 242  | 0,59 |
| 5,850 % éch. 02/07/2032                            | 6 800     | 6 875   | 0,10 |
| 6,050 % éch. 11/01/2040                            | 1 500     | 1 457   | 0,02 |
| 6,125 % éch. 09/02/2038                            | 14 600    | 14 341  | 0,21 |
| 6,250 % éch. 27/08/2037                            | 15 000    | 15 019  | 0,22 |
| 6,338 % éch. 04/05/2053                            | 900       | 845     | 0,01 |
| 6,400 % éch. 07/05/2054                            | 10 600    | 10 014  | 0,15 |
| 6,625 % éch. 29/01/2038                            | 6 800     | 6 977   | 0,10 |
| 6,750 % éch. 09/02/2056                            | 20 600    | 20 219  | 0,30 |
| 6,875 % éch. 13/05/2037                            | 50 800    | 53 355  | 0,79 |
| 7,375 % éch. 13/05/2055                            | 13 900    | 14 765  | 0,22 |
|                                                    |           | 284 597 | 4,20 |
| Total Mexique                                      |           | 562 328 | 8,29 |

### MONGOLIE

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                  |        |        |      |
|--------------------------------------------------|--------|--------|------|
| City of Ulaanbaatar Mongolia                     |        |        |      |
| 7,750 % éch. 21/08/2027                          | 20 630 | 21 056 | 0,31 |
| Obligation internationale du gouvernement mongol |        |        |      |
| 3,500 % éch. 07/07/2027                          | 8 900  | 8 735  | 0,13 |
| 5,950 % éch. 09/03/2032                          | 5 150  | 5 172  | 0,08 |
| Total Mongolie                                   |        | 34 963 | 0,52 |

### MAROC

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                         |        |        |      |
|-------------------------|--------|--------|------|
| OCP S.A.                |        |        |      |
| 3,750 % éch. 23/06/2031 | 6 950  | 6 422  | 0,09 |
| 5,125 % éch. 23/06/2051 | 11 650 | 9 445  | 0,14 |
| 6,700 % éch. 01/03/2036 | 9 400  | 9 827  | 0,15 |
|                         |        | 25 694 | 0,38 |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                    |          |        |      |
|----------------------------------------------------|----------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement marocain |          |        |      |
| 5,125 % éch. 26/05/2038                            | € 15 900 | 18 573 | 0,27 |
| Total Maroc                                        |          | 44 267 | 0,65 |

| DESCRIPTION                    | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| PAYS-BAS                       |         |                                  |                           |
| ACTIONS ORDINAIRES             |         |                                  |                           |
| Stichting Administratiekantoor |         |                                  |                           |
| T.K.H. Holding (c)             | 13 638  | \$ 0                             | 0,00                      |

VALEUR  
NOMINALE  
(en milliers)

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                                                              |          |        |      |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|--------|------|
| Ardshinbank CJSC Via Dilijan Finance BV                                      |          |        |      |
| 6,600 % éch. 22/01/2031                                                      | \$ 1 400 | 1 398  | 0,02 |
| Douro Finance BV                                                             |          |        |      |
| 0,000 % éch. 04/06/2031                                                      | € 7 050  | 7 121  | 0,10 |
| Prosus NV                                                                    |          |        |      |
| 2,031 % éch. 03/08/2032                                                      | 1 200    | 1 235  | 0,02 |
| 3,257 % éch. 19/01/2027                                                      | \$ 2 400 | 2 377  | 0,04 |
| 3,832 % éch. 08/02/2051                                                      | 1 900    | 1 270  | 0,02 |
| 4,027 % éch. 03/08/2050                                                      | 1 600    | 1 122  | 0,02 |
| Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % en espèces ou 15,000 % en PIK) |          |        |      |
| 15,000 % éch. 31/12/2044 ^ (b)                                               | 3 439    | 69     | 0,00 |
| Veon Midco BV                                                                |          |        |      |
| 6,950 % éch. 01/06/2031                                                      | 9 550    | 9 541  | 0,14 |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                                                      | 8 900    | 8 885  | 0,13 |
| Yinson Bergein Production BV                                                 |          |        |      |
| 8,498 % éch. 31/01/2045                                                      | 10 064   | 10 759 | 0,16 |
| Yinson Boronia Production BV                                                 |          |        |      |
| 8,947 % éch. 31/07/2042                                                      | 7 383    | 8 126  | 0,12 |
|                                                                              |          | 51 903 | 0,77 |

### CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                         |        |        |      |
|-------------------------|--------|--------|------|
| Veon Amsterdam          |        |        |      |
| 7,924 % éch. 25/03/2027 | 16 300 | 16 279 | 0,24 |
| Total Pays-Bas          |        | 68 182 | 1,01 |

### NIGERIA

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                         |           |        |      |
|-------------------------|-----------|--------|------|
| BOI Finance BV          |           |        |      |
| 7,500 % éch. 16/02/2027 | € 15 700  | 18 312 | 0,27 |
| Dangote Fertiliser Ltd. |           |        |      |
| 7,750 % éch. 05/05/2031 | \$ 10 400 | 10 468 | 0,15 |
|                         |           | 28 780 | 0,42 |

### CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                          |           |        |      |
|--------------------------|-----------|--------|------|
| Bank of Industry Ltd.    |           |        |      |
| 3,895 % éch. 23/08/2027  | € 6 813   | 7 772  | 0,11 |
| Nigeria                  |           |        |      |
| 11,300 % éch. 19/12/2032 | \$ 12 000 | 12 165 | 0,18 |
|                          |           | 19 937 | 0,29 |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                    |        |         |      |
|----------------------------------------------------|--------|---------|------|
| Obligation internationale du gouvernement nigérian |        |         |      |
| 6,125 % éch. 28/09/2028                            | 25 930 | 25 993  | 0,38 |
| 6,500 % éch. 28/11/2027                            | 3 744  | 3 772   | 0,06 |
| 7,375 % éch. 28/09/2033                            | 2 900  | 2 930   | 0,04 |
| 7,625 % éch. 28/11/2047 (k)                        | 3 886  | 3 822   | 0,06 |
| 8,631 % éch. 13/01/2036                            | 11 900 | 12 931  | 0,19 |
| 9,130 % éch. 13/01/2046                            | 17 500 | 19 414  | 0,29 |
|                                                    |        | 68 862  | 1,02 |
| Total Nigeria                                      |        | 117 579 | 1,73 |

### OMAN

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                   |        |        |      |
|---------------------------------------------------|--------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement omanais |        |        |      |
| 5,625 % éch. 17/01/2028                           | 10 090 | 10 201 | 0,15 |
| 6,000 % éch. 01/08/2029                           | 18 300 | 18 889 | 0,28 |
| 6,250 % éch. 25/01/2031                           | 8 900  | 9 386  | 0,14 |
| 6,500 % éch. 08/03/2047                           | 3 473  | 3 711  | 0,05 |
| 6,750 % éch. 17/01/2048                           | 4 300  | 4 726  | 0,07 |
| 7,000 % éch. 25/01/2051                           | 3 050  | 3 480  | 0,05 |
| Total Oman                                        |        | 50 393 | 0,74 |

### PAKISTAN

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                       |       |       |      |
|-------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais |       |       |      |
| 6,875 % éch. 05/12/2027                               | 4 500 | 4 546 | 0,07 |



| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>JUSTE<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>JUSTE<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>JUSTE<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,975 % éch. 24/04/2029                              | \$ 18 200                           | \$ 18 260                        | 0,27                      | <b>PÉROU</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>QATAR</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 08/04/2031                              | 4 500                               | 4 540                            | 0,07                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 08/04/2051                              | 1 900                               | 1 921                            | 0,03                      | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.        |                                     |                                  |                           | QatarEnergy                                          |                                     |                                  |                           |
| Pakistan Water & Power Development Authority         |                                     |                                  |                           | 9,700 % éch. 05/03/2045                             | PEN 45 300                          | \$ 14 233                        | 0,21                      | 1,375 % éch. 12/09/2026                              | \$ 300                              | \$ 298                           | 0,01                      |
| 7,500 % éch. 04/06/2031                              | 10 802                              | 10 586                           | 0,15                      | 10,100 % éch. 15/12/2043                            | 43 565                              | 14 055                           | 0,21                      | 3,125 % éch. 12/07/2041                              | 24 550                              | 18 581                           | 0,27                      |
| Total Pakistan                                       |                                     | 39 853                           | 0,59                      | lnRetail Consumer                                   |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 12/07/2051                              | 50 400                              | 34 547                           | 0,51                      |
| <b>PANAMA</b>                                        |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 22/03/2028                             | \$ 4 400                            | 4 243                            | 0,06                      | 4,625 % éch. 23/06/2029                              | 8 800                               | 8 746                            | 0,13                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | Niagara Energy SAC                                  |                                     |                                  |                           | QatarEnergy LNG                                      |                                     |                                  |                           |
| Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.             |                                     |                                  |                           | 5,746 % éch. 03/10/2034                             | 13 001                              | 13 041                           | 0,19                      | 5,838 % éch. 30/09/2027                              | 2 256                               | 2 266                            | 0,03                      |
| 5,125 % éch. 11/08/2061                              | 6 700                               | 5 691                            | 0,08                      | Petroleos del Peru S.A.                             |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 64 438                           | 0,95                      |
| Banco General S.A.                                   | 400                                 | 382                              | 0,01                      | 4,750 % éch. 19/06/2032                             | 29 600                              | 25 205                           | 0,37                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 07/05/2031 (g)(i)                       | 7 000                               | 6 691                            | 0,10                      | 5,625 % éch. 19/06/2047                             | 40 744                              | 29 159                           | 0,43                      | Obligation internationale du gouvernement qatari     |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 07/05/2031 (g)                          |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                              | 13 200                              | 13 271                           | 0,20                      |
| Banco Nacional de Panama                             |                                     |                                  |                           | Corp. Financiera de Desarrollo S.A.                 |                                     |                                  |                           | Total Qatar                                          |                                     | 77 709                           | 1,15                      |
| 2,500 % éch. 11/08/2030                              | 1 500                               | 1 341                            | 0,02                      | 2,400 % éch. 28/09/2027                             | 700                                 | 679                              | 0,01                      | <b>ROUMANIE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Empresa de Transmision Electrica S.A.                |                                     |                                  |                           | Fondo MIVIVIENDA S.A.                               |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 02/05/2049                              | 6 800                               | 5 475                            | 0,08                      | 4,625 % éch. 12/04/2027                             | 517                                 | 519                              | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement roumain    |                                     |                                  |                           |
| Generadora de Gatun S.A.                             |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 31/03/2031                             | 5 900                               | 5 952                            | 0,09                      | 2,625 % éch. 02/12/2040 (k)                          | € 7 050                             | 5 451                            | 0,08                      |
| 6,874 % éch. 30/09/2044                              | 12 950                              | 13 384                           | 0,20                      | Obligation internationale du gouvernement péruvien  |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 13/04/2042 (k)                          | 2 500                               | 1 935                            | 0,03                      |
|                                                      |                                     | 32 964                           | 0,49                      | 3,230 % éch. 28/07/2121                             | 2 107                               | 1 175                            | 0,02                      | 2,875 % éch. 13/04/2042 (k)                          | \$ 5 800                            | 5 731                            | 0,08                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/01/2072                             | 570                                 | 364                              | 0,01                      | 3,000 % éch. 27/02/2027 (k)                          | € 12 400                            | 9 308                            | 0,14                      |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen   |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 12/08/2034                             | PEN 42 100                          | 12 066                           | 0,18                      | 3,375 % éch. 28/01/2050 (k)                          | 4 300                               | 4 369                            | 0,06                      |
| 4,500 % éch. 15/05/2047                              | 5 900                               | 4 889                            | 0,07                      | 5,500 % éch. 30/03/2036                             | \$ 3 200                            | 3 236                            | 0,05                      | 4,000 % éch. 14/02/2051 (k)                          | \$ 2 300                            | 1 554                            | 0,02                      |
| 4,500 % éch. 16/04/2050                              | 6 200                               | 4 979                            | 0,07                      | 5,875 % éch. 08/08/2054 (k)                         | 14 270                              | 14 245                           | 0,21                      | 5,125 % éch. 24/09/2031 (k)                          | € 2 600                             | 3 041                            | 0,05                      |
| 4,500 % éch. 19/01/2063                              | 6 000                               | 4 650                            | 0,07                      | 6,150 % éch. 12/08/2032                             | PEN 23 800                          | 7 560                            | 0,11                      | 5,250 % éch. 30/05/2032 (k)                          | 7 800                               | 9 105                            | 0,13                      |
| 5,227 % éch. 23/02/2034                              | 1 100                               | 1 083                            | 0,02                      | 6,200 % éch. 30/06/2055                             | \$ 6 450                            | 6 666                            | 0,10                      | 5,375 % éch. 07/06/2033 (k)                          | 10 850                              | 12 533                           | 0,19                      |
| 5,662 % éch. 23/02/2038                              | 800                                 | 799                              | 0,01                      | 6,850 % éch. 12/08/2035                             | PEN 152 870                         | 47 183                           | 0,69                      | 5,625 % éch. 30/05/2037 (k)                          | 8 900                               | 10 041                           | 0,15                      |
| 6,400 % éch. 14/02/2035                              | 1 400                               | 1 482                            | 0,02                      | 6,900 % éch. 12/08/2037                             | 9 100                               | 2 735                            | 0,04                      | 5,750 % éch. 16/09/2030 (k)                          | \$ 14 500                           | 14 583                           | 0,22                      |
| 6,700 % éch. 26/01/2036                              | 3 900                               | 4 204                            | 0,06                      | 6,950 % éch. 12/08/2031                             | 5 441                               | 1 815                            | 0,02                      | 5,875 % éch. 11/07/2032 (k)                          | € 16 000                            | 19 185                           | 0,28                      |
| 6,853 % éch. 28/03/2054 (k)                          | 8 900                               | 9 656                            | 0,14                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                             | 25 000                              | 8 214                            | 0,12                      | 6,125 % éch. 07/10/2037 (k)                          | 7 900                               | 9 200                            | 0,14                      |
| 6,875 % éch. 31/01/2036                              | 6 500                               | 7 105                            | 0,11                      | 7,600 % éch. 12/08/2039                             | 14 450                              | 4 552                            | 0,07                      | 6,375 % éch. 18/09/2033 (k)                          | 8 100                               | 9 875                            | 0,15                      |
| 7,875 % éch. 01/03/2057 (k)                          | 3 600                               | 4 360                            | 0,07                      |                                                     |                                     | 116 961                          | 1,73                      | 6,500 % éch. 07/10/2045 (k)                          | 1 900                               | 2 195                            | 0,03                      |
| 8,000 % éch. 01/03/2038                              | 4 042                               | 4 756                            | 0,07                      | Total Pérou                                         |                                     | 216 897                          | 3,20                      | 6,750 % éch. 11/07/2039 (k)                          | 12 900                              | 15 657                           | 0,23                      |
| 8,125 % éch. 28/04/2034                              | 90                                  | 104                              | 0,00                      | <b>PHILIPPINES</b>                                  |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 17/01/2033 (k)                          | \$ 9 200                            | 9 777                            | 0,14                      |
|                                                      |                                     | 48 067                           | 0,71                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | Total Roumanie                                       |                                     | 143 540                          | 2,12                      |
| Total Panama                                         |                                     | 81 031                           | 1,20                      | BDO Unibank, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | <b>RWANDA</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>PARAGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 03/12/2030                             | \$ 300                              | 297                              | 0,00                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | San Miguel Global Power Holdings Corp.              |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement rwandais   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen |                                     |                                  |                           | 8,125 % éch. 02/12/2029 (g)                         | 21 100                              | 20 995                           | 0,31                      | 5,500 % éch. 09/08/2031                              | 3 600                               | 3 450                            | 0,05                      |
| 2,739 % éch. 29/01/2033                              | 700                                 | 622                              | 0,01                      |                                                     |                                     | 21 292                           | 0,31                      | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                               |                                     |                                  |                           |
| 3,849 % éch. 28/06/2033                              | 5 650                               | 5 297                            | 0,08                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 30/03/2050                              | 3 800                               | 3 529                            | 0,05                      | Obligation internationale du gouvernement philippin |                                     |                                  |                           | Riyad Bank                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,850 % éch. 21/08/2033                              | 2 900                               | 3 005                            | 0,05                      | 2,650 % éch. 10/12/2045                             | 10 200                              | 6 542                            | 0,10                      | 5,805 % éch. 14/01/2036 (i)                          | 23 400                              | 23 079                           | 0,34                      |
| 6,000 % éch. 09/02/2036                              | 2 150                               | 2 254                            | 0,03                      | 2,950 % éch. 05/05/2045                             | 2 400                               | 1 638                            | 0,02                      | Saudi Arabian Oil Co.                                |                                     |                                  |                           |
| 6,650 % éch. 04/03/2055                              | 8 300                               | 8 935                            | 0,13                      | 3,700 % éch. 01/03/2041                             | 650                                 | 531                              | 0,01                      | 3,500 % éch. 24/11/2070                              | 40 100                              | 24 531                           | 0,36                      |
| 7,900 % éch. 09/02/2031                              | PYG 41 896 000                      | 6 629                            | 0,10                      | 5,325 % éch. 24/06/2036                             | 17 400                              | 17 409                           | 0,26                      | 5,875 % éch. 17/07/2064                              | 15 500                              | 14 562                           | 0,22                      |
| 8,500 % éch. 04/03/2035                              | 40 929 000                          | 6 533                            | 0,10                      | 5,750 % éch. 27/01/2051 (k)                         | 23 900                              | 23 931                           | 0,35                      | 6,375 % éch. 02/06/2055                              | 11 100                              | 11 314                           | 0,17                      |
| 8,500 % éch. 04/04/2038                              | 5 676 000                           | 899                              | 0,01                      | 6,375 % éch. 23/10/2034                             | 1 747                               | 1 885                            | 0,03                      |                                                      |                                     | 73 486                           | 1,09                      |
| Total Paraguay                                       |                                     | 37 703                           | 0,56                      |                                                     |                                     | 51 936                           | 0,77                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Total Philippines                                   |                                     | 73 228                           | 1,08                      | 3,450 % éch. 02/02/2061                              | 9 200                               | 5 843                            | 0,09                      |
| <b>POLOGNE</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 21/01/2055                              | 7 900                               | 5 521                            | 0,08                      |
| mBank S.A.                                           |                                     |                                  |                           | 4,778 % éch. 25/09/2035                             | € 200                               | 235                              | 0,00                      | 4,500 % éch. 26/10/2046                              | 1 800                               | 1 498                            | 0,02                      |
| ORLEN S.A.                                           |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 30/01/2035                             | \$ 14 600                           | 15 128                           | 0,22                      | 4,625 % éch. 04/10/2047                              | 15 500                              | 13 095                           | 0,19                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 15 363                           | 0,22                      | 5,125 % éch. 13/01/2028                              | 9 600                               | 9 667                            | 0,14                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 13/01/2035                              | 3 100                               | 3 210                            | 0,05                      |
| Bank Gospodarstwa Krajowego                          |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 38 834                           | 0,57                      |
| 6,250 % éch. 09/07/2054                              | 13 850                              | 14 207                           | 0,21                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | Total Arabie saoudite                                |                                     | 112 320                          | 1,66                      |
| Obligation internationale du gouvernement polonais   |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 11/01/2044 (k)                         | € 4 850                             | 5 540                            | 0,08                      | <b>SÉNÉGAL</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 04/10/2033 (k)                          | \$ 4 400                            | 4 386                            | 0,07                      | 5,375 % éch. 12/02/2035 (k)                         | 16 000                              | 16 359                           | 0,24                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 04/04/2053 (k)                          | 8 600                               | 8 158                            | 0,12                      | 5,500 % éch. 18/03/2054 (k)                         | 8 600                               | 8 150                            | 0,12                      | Obligation internationale du gouvernement sénégalais |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 56 800                           | 0,84                      | 4,750 % éch. 13/03/2028                              | € 20 867                            | 13 394                           | 0,20                      |
| Total Pologne                                        |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 72 163                           | 1,06                      | 5,375 % éch. 08/06/2037                              | 7 100                               | 4 331                            | 0,06                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 23/05/2033 (k)                          | \$ 28 900                           | 15 451                           | 0,23                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 10/06/2031 (k)                          | 11 800                              | 6 369                            | 0,09                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           | Total Sénégal                                        |                                     | 39 545                           | 0,58                      |

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

| DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>SERBIE</b>                                          |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Telecommunications Co. Telekom Srbija AD Belgrade      |                                     |                                  |                           | 3,350 % éch. 15/03/2033                                                    | \$ 6 192                            | \$ 5 967                         | 0,09                      | Türkiye Varlik Fonu Yonetimi A/S                    |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 18/05/2031                                | \$ 11 400                           | \$ 11 380                        | 0,17                      | 3,600 % éch. 15/06/2035                                                    | 3 000                               | 2 510                            | 0,04                      | 7,750 % éch. 10/09/2035                             | \$ 13 600                           | \$ 13 864                        | 0,20                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/05/2036 (k)                                                | 5 069                               | 5 102                            | 0,07                      |                                                     |                                     | 49 316                           | 0,73                      |
| Obligation internationale du gouvernement serbe        |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/02/2038                                                    | 15 443                              | 15 628                           | 0,23                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>              |                                     |                                  |                           |
| 2,125 % éch. 01/12/2030                                | 200                                 | 175                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 15/04/2028                                                    | 5 748                               | 5 562                            | 0,08                      | SOCAR Turkey Enerji A/S                             |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 06/05/2038                                | € 7 750                             | 8 873                            | 0,13                      | Total Sri Lanka                                                            |                                     | 53 855                           | 0,79                      | 5,558 % éch. 11/08/2026                             | € 18 884                            | 21 568                           | 0,32                      |
| 5,500 % éch. 06/05/2036                                | \$ 8 000                            | 7 850                            | 0,12                      | <b>SUPRANATIONALES</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.                     |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 12/06/2034                                | 6 300                               | 6 462                            | 0,10                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           | 5,401 % éch. 15/12/2028                             | 5 400                               | 6 198                            | 0,09                      |
| 6,250 % éch. 26/05/2028                                | 10 300                              | 10 509                           | 0,15                      | Africa Finance Corp.                                                       |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 27 766                           | 0,41                      |
| 6,500 % éch. 26/09/2033                                | 450                                 | 476                              | 0,01                      | 2,870 % éch. 13/08/2031                                                    | 600                                 | 540                              | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 26/09/2033 (k)                            | 17 650                              | 18 661                           | 0,27                      | 2,900 % éch. 21/07/2031                                                    | 600                                 | 541                              | 0,01                      | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S             |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     | 53 006                           | 0,78                      | Banque africaine de développement                                          |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/09/2030                             | \$ 11 600                           | 11 749                           | 0,17                      |
| Total Serbie                                           |                                     | 64 386                           | 0,95                      | (g)(i)                                                                     | 14 700                              | 14 489                           | 0,21                      | Obligation internationale du gouvernement turc      |                                     |                                  |                           |
| <b>SINGAPOUR</b>                                       |                                     |                                  |                           | Banque Ouest Africaine de Développement                                    |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 11/05/2047 (k)                         | 46 000                              | 37 336                           | 0,55                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 14/10/2040                                                    | € 9 700                             | 10 632                           | 0,16                      | 6,000 % éch. 14/01/2041                             | 10 735                              | 9 520                            | 0,14                      |
| Flex Ltd.                                              |                                     |                                  |                           | Total Supranationales                                                      |                                     | 26 202                           | 0,39                      | 6,875 % éch. 17/03/2036                             | 1 600                               | 1 596                            | 0,02                      |
| 4,875 % éch. 15/06/2029                                | 962                                 | 963                              | 0,02                      | <b>SURINAME</b>                                                            |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 16/09/2035                             | 5 400                               | 5 421                            | 0,08                      |
| Yinson Production Financial Services Pte. Ltd.         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | 40,149 % éch. 16/06/2027                            | TRY 452 400                         | 9 839                            | 0,14                      |
| 9,625 % éch. 03/05/2029                                | 3 900                               | 4 133                            | 0,06                      | Obligation internationale du gouvernement du Suriname                      |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 19/08/2026                            | 51 800                              | 1 114                            | 0,02                      |
| Total Singapour                                        |                                     | 5 096                            | 0,08                      | 7,700 % éch. 06/11/2030                                                    | \$ 9 100                            | 9 498                            | 0,14                      | 40,760 % éch. 17/05/2028                            | 689 800                             | 14 927                           | 0,22                      |
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 06/11/2035                                                    | 3 600                               | 3 946                            | 0,06                      | Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | Total Suriname                                                             |                                     | 13 444                           | 0,20                      | 6,375 % éch. 03/10/2030                             | \$ 13 500                           | 13 252                           | 0,20                      |
| Eskom Holdings                                         |                                     |                                  |                           | <b>TADJIKISTAN</b>                                                         |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 03/07/2028                             | 4 100                               | 4 165                            | 0,06                      |
| 4,314 % éch. 23/07/2027                                | 18 150                              | 17 977                           | 0,26                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 108 919                          | 1,60                      |
| 6,350 % éch. 10/08/2028                                | 12 900                              | 13 125                           | 0,19                      | Obligation internationale du gouvernement de la République du Tadjikistan  |                                     |                                  |                           | Total Turquie                                       |                                     | 186 001                          | 2,74                      |
| 8,450 % éch. 10/08/2028                                | 200                                 | 211                              | 0,00                      | 7,125 % éch. 14/09/2027                                                    | 200                                 | 202                              | 0,00                      | <b>UKRAINE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>SAÏLOI FINANCIER USA LLC</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>TANZANIE</b>                                                            |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 03/05/2029                                | 4 238                               | 4 441                            | 0,07                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement ukrainien |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 10/04/2033                                | 3 000                               | 3 107                            | 0,05                      | Ministère des finances de Tanzanie                                         |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 01/02/2030                             | 2 478                               | 1 784                            | 0,03                      |
|                                                        |                                     | 38 861                           | 0,57                      | 7,859 % éch. 26/04/2028                                                    | € 4 473                             | 5 119                            | 0,08                      | 0,000 % éch. 01/02/2034                             | 7 769                               | 4 409                            | 0,06                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>THAÏLANDE</b>                                                           |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 01/02/2035                             | 9 089                               | 5 485                            | 0,08                      |
| Transnet SOC Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/02/2032                             | 45 807                              | 37 986                           | 0,56                      |
| 10,658 % éch. 02/03/2028                               | ZAR 88 571                          | 5 400                            | 0,08                      | Bangkok Bank PCL                                                           |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/02/2029 (k)                         | 16 300                              | 13 757                           | 0,20                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | 5,082 % éch. 26/11/2035                                                    | \$ 11 300                           | 11 143                           | 0,16                      | 4,500 % éch. 01/02/2034                             | 21 293                              | 15 012                           | 0,22                      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           | GC Treasury Center Co. Ltd.                                                |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/02/2035                             | 9 388                               | 6 524                            | 0,10                      |
| 4,300 % éch. 12/10/2028                                | \$ 2 200                            | 2 175                            | 0,03                      | 6,500 % éch. 10/09/2030 (g)                                                | 9 500                               | 9 401                            | 0,14                      | 4,500 % éch. 01/02/2036                             | 6 737                               | 4 621                            | 0,07                      |
| 5,000 % éch. 12/10/2046                                | 7 700                               | 6 051                            | 0,09                      | 7,125 % éch. 10/03/2035 (g)                                                | 6 500                               | 6 437                            | 0,09                      | Total Ukraine                                       |                                     | 89 578                           | 1,32                      |
| 5,375 % éch. 24/07/2044                                | 400                                 | 340                              | 0,01                      | PTTEP Treasury Center Co. Ltd.                                             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 30/09/2049                                | 4 400                               | 3 730                            | 0,05                      | 3,903 % éch. 06/12/2059                                                    | 550                                 | 414                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 28/02/2031                                | ZAR 32 010                          | 1 886                            | 0,03                      | Total Thaïlande                                                            |                                     | 27 395                           | 0,40                      | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC                    |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 11/12/2055                                | \$ 11 500                           | 11 496                           | 0,17                      | <b>TRINITÉ-ET-TOBAGO</b>                                                   |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 02/11/2047                             | 5 200                               | 4 667                            | 0,07                      |
| 7,300 % éch. 20/04/2052                                | 5 300                               | 5 354                            | 0,08                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           | Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC            |                                     |                                  |                           |
| 7,950 % éch. 19/11/2054                                | 7 300                               | 7 897                            | 0,12                      | National Gas Co. of Trinidad & Tobago Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 02/10/2054                             | 9 400                               | 8 695                            | 0,13                      |
| 8,500 % éch. 31/01/2037 (k)                            | ZAR 943 500                         | 57 347                           | 0,84                      | 6,050 % éch. 15/01/2036                                                    | 5 070                               | 4 613                            | 0,07                      | 5,500 % éch. 08/05/2034                             | 4 400                               | 4 508                            | 0,06                      |
| 8,875 % éch. 28/02/2035 (k)                            | 445 900                             | 28 194                           | 0,42                      | Trinidad Generation Unlimited                                              |                                     |                                  |                           | Abu Dhabi Future Energy Co. PJSC Masdar             |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 191 800                             | 11 838                           | 0,17                      | 7,750 % éch. 16/06/2033                                                    | 3 800                               | 4 004                            | 0,06                      | 4,875 % éch. 21/05/2030                             | 5 300                               | 5 297                            | 0,08                      |
|                                                        |                                     | 136 308                          | 2,01                      | Total Trinité-et-Tobago                                                    |                                     | 8 617                            | 0,13                      | 4,875 % éch. 25/07/2033                             | 13 400                              | 13 194                           | 0,19                      |
| Total Afrique du Sud                                   |                                     | 180 569                          | 2,66                      | <b>TUNISIE</b>                                                             |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 21/05/2035                             | 6 000                               | 6 064                            | 0,09                      |
| <b>CORÉE DU SUD</b>                                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | Abu Dhabi National Energy Co. PJSC                  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de la Banque centrale de Tunisie |                                     |                                  |                           | 4,696 % éch. 24/04/2033                             | 2 000                               | 1 968                            | 0,03                      |
| Mirae Asset Securities Co. Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 3,280 % éch. 09/08/2027                                                    | ¥ 200 000                           | 1 180                            | 0,02                      | Adnoc Murban Rsc Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 26/01/2029                                | \$ 800                              | 819                              | 0,01                      | <b>TURQUIE</b>                                                             |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 11/09/2054                             | 20 800                              | 18 813                           | 0,28                      |
| <b>ESPAGNE</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           | DAE Sukuk Dift Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | Coca-Cola Icecek A/S                                                       |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 16/10/2030                             | 11 800                              | 11 379                           | 0,17                      |
| EnfraGen Energia Sur S.A.U.                            |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 20/01/2029                                                    | \$ 700                              | 682                              | 0,01                      | Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC                          |                                     |                                  |                           |
| 8,499 % éch. 30/06/2032                                | 12 790                              | 13 366                           | 0,20                      | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S                                |                                     |                                  |                           | 5,794 % éch. 30/06/2053                             | 26 700                              | 26 472                           | 0,39                      |
| <b>SRI LANKA</b>                                       |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 15/11/2028                                                    | 500                                 | 514                              | 0,01                      | DP World Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | QNB Bank A/S                                                               |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 30/09/2049 (k)                         | 800                                 | 655                              | 0,01                      |
| Obligation internationale du gouvernement sri-lankais  |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 11/02/2031                                                    | 12 000                              | 11 679                           | 0,17                      | 4,700 % éch. 30/09/2049                             | 800                                 | 655                              | 0,01                      |
| 3,100 % éch. 15/01/2030                                | 18 681                              | 19 086                           | 0,28                      | Türkcell İletişim Hizmetleri A/S                                           |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 25/09/2048                             | 7 475                               | 6 938                            | 0,10                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 7,450 % éch. 24/01/2030                                                    | 7 200                               | 7 395                            | 0,11                      | 6,850 % éch. 02/07/2037                             | 4 580                               | 4 936                            | 0,07                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | Turkish Airlines Pass-Through Trust                                        |                                     |                                  |                           | Emirates NBD Bank PJSC                              |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 15/09/2028                                                    | 1 307                               | 1 294                            | 0,02                      | 5,125 % éch. 29/06/2031                             | 22 500                              | 22 500                           | 0,33                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | Türkiye Vakıflar Bankası TAO                                               |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                           |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 31/07/2030                                                    | 13 800                              | 13 888                           | 0,21                      | 4,789 % éch. 03/06/2031                             | 26 900                              | 26 939                           | 0,40                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | MDGH GMTN RSC Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 21/05/2050                             | 1 600                               | 1 219                            | 0,02                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | 5,084 % éch. 22/05/2053                             | 2 500                               | 2 264                            | 0,03                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 01/05/2034                             | 5 600                               | 5 891                            | 0,09                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 173 054                          | 2,55                      |

|                                                                   |  |  |  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUITE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                         |  |  |        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUITE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET                                                                |  |  |      |                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUITE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|-------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|--|--|--------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--|----------|-------------------------|--|-------|---------------------------------------------------|----|------|-----------------------------------------------|-------------------------|--|--|-------------------------|--|--|-------|--|--|------|--|--|------|--|--|
| DESCRIPTION                                                       |  |  |  |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION             |  |  |        |                                     |                                  | DESCRIPTION                                                                              |  |  |      |                         |                                     | DESCRIPTION                      |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                             |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |  |  |  |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/11/2036 |  |  | \$ 239 |                                     |                                  | 73                                                                                       |  |  | 0,00 |                         |                                     | 4,261 % éch. 10/10/2051          |                           |  | \$ 4 800 |                         |  | 4 740 |                                                   |    | 0,07 |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 3,875 % éch. 16/04/2050                                           |  |  |  | \$ 13 600                           |                                  |                           | \$ 10 501               |  |  | 0,15   |                                     |                                  | 6,502 % éch. 25/11/2036                                                                  |  |  |      | 284                     |                                     |                                  | 292                       |  |          | 0,00                    |  |       | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.               |    |      |                                               | 4,445 % éch. 25/09/2037 |  |  | 121                     |  |  | 117   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 3,900 % éch. 09/09/2050                                           |  |  |  | 1 700                               |                                  |                           | 1 220                   |  |  | 0,02   |                                     |                                  | 5,113 % éch. 25/02/2033                                                                  |  |  |      | 124                     |                                     |                                  | 121                       |  |          | 0,00                    |  |       | CitiMortgage Alternative Loan Trust               |    |      |                                               | 4,413 % éch. 25/10/2036 |  |  | 770                     |  |  | 602   |  |  | 0,01 |  |  |      |  |  |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                           |  |  |  | 19 700                              |                                  |                           | 19 636                  |  |  | 0,29   |                                     |                                  | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                                      |  |  |      | 89                      |                                     |                                  | 85                        |  |          | 0,00                    |  |       | Countrywide Alternative Loan Trust                |    |      |                                               | 4,113 % éch. 25/05/2036 |  |  | 962                     |  |  | 347   |  |  | 0,01 |  |  |      |  |  |
| 4,750 % éch. 22/09/2036                                           |  |  |  | 15 400                              |                                  |                           | 15 273                  |  |  | 0,23   |                                     |                                  | 4,033 % éch. 25/08/2036                                                                  |  |  |      | 1 612                   |                                     |                                  | 1 445                     |  |          | 0,02                    |  |       | 4,394 % éch. 20/12/2035                           |    |      |                                               | 440                     |  |  | 422                     |  |  | 0,01  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                           |  |  |  | 20 300                              |                                  |                           | 20 648                  |  |  | 0,30   |                                     |                                  | Lehman XS Trust                                                                          |  |  |      | 1 259                   |                                     |                                  | 551                       |  |          | 0,01                    |  |       | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust    |    |      |                                               | 4,155 % éch. 25/11/2034 |  |  | 91                      |  |  | 88    |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 5,500 % éch. 30/04/2054                                           |  |  |  | 9 050                               |                                  |                           | 8 895                   |  |  | 0,13   |                                     |                                  | MASTR Asset-Backed Securities Trust                                                      |  |  |      | 185                     |                                     |                                  | 185                       |  |          | 0,00                    |  |       | 4,423 % éch. 25/08/2037                           |    |      |                                               | 550                     |  |  | 463                     |  |  | 0,01  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| Département des finances du gouvernement de Sharjah               |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,203 % éch. 25/11/2036                                                                  |  |  |      | 932                     |                                     |                                  | 544                       |  |          | 0,01                    |  |       | 3,961 % éch. 20/05/2036                           |    |      |                                               | 65                      |  |  | 63                      |  |  | 0,00  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 4,000 % éch. 28/07/2050                                           |  |  |  | 4 300                               |                                  |                           | 2 836                   |  |  | 0,04   |                                     |                                  | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                                   |  |  |      | 1 259                   |                                     |                                  | 551                       |  |          | 0,01                    |  |       | 4,309 % éch. 25/11/2037                           |    |      |                                               | 333                     |  |  | 316                     |  |  | 0,01  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 4,625 % éch. 13/02/2032                                           |  |  |  | € 8 100                             |                                  |                           | 9 222                   |  |  | 0,14   |                                     |                                  | 3,963 % éch. 25/02/2037                                                                  |  |  |      | 185                     |                                     |                                  | 185                       |  |          | 0,00                    |  |       | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust |    |      |                                               | 4,113 % éch. 25/05/2036 |  |  | 962                     |  |  | 347   |  |  | 0,01 |  |  |      |  |  |
| 6,500 % éch. 23/11/2032                                           |  |  |  | \$ 13 700                           |                                  |                           | 14 243                  |  |  | 0,21   |                                     |                                  | 4,528 % éch. 25/01/2035                                                                  |  |  |      | 1 259                   |                                     |                                  | 551                       |  |          | 0,01                    |  |       | 4,155 % éch. 25/11/2034                           |    |      |                                               | 91                      |  |  | 88                      |  |  | 0,00  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| Total Émirats arabes unis                                         |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                                       |  |  |      | 165                     |                                     |                                  | 31                        |  |          | 0,00                    |  |       | 4,423 % éch. 25/08/2037                           |    |      |                                               | 550                     |  |  | 463                     |  |  | 0,01  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| ROYAUME-UNI                                                       |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Option One Mortgage Loan Trust                                                           |  |  |      | 590                     |                                     |                                  | 417                       |  |          | 0,01                    |  |       | GSMPs Mortgage Loan Trust                         |    |      |                                               | 4,113 % éch. 25/01/2036 |  |  | 107                     |  |  | 87    |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,203 % éch. 25/05/2037                                                                  |  |  |      | 462                     |                                     |                                  | 279                       |  |          | 0,00                    |  |       | GSR Mortgage Loan Trust                           |    |      |                                               | 4,479 % éch. 25/01/2036 |  |  | 16                      |  |  | 15    |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| Antofagasta PLC                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed                                                 |  |  |      | 3 900                   |                                     |                                  | 3 590                     |  |          | 0,05                    |  |       | 5,744 % éch. 19/10/2035                           |    |      |                                               | 90                      |  |  | 41                      |  |  | 0,00  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 2,375 % éch. 14/10/2030                                           |  |  |  | 2 200                               |                                  |                           | 1 989                   |  |  | 0,03   |                                     |                                  | Pass-Through Certificates                                                                |  |  |      | 780                     |                                     |                                  | 256                       |  |          | 0,00                    |  |       | HomeBanc Mortgage Trust                           |    |      |                                               | 4,283 % éch. 25/01/2036 |  |  | 102                     |  |  | 100   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 5,625 % éch. 09/09/2035                                           |  |  |  | 7 600                               |                                  |                           | 7 704                   |  |  | 0,11   |                                     |                                  | 4,543 % éch. 25/09/2035                                                                  |  |  |      | 1 388                   |                                     |                                  | 1 350                     |  |          | 0,00                    |  |       | 4,403 % éch. 25/03/2035                           |    |      |                                               | 51                      |  |  | 50                      |  |  | 0,00  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 6,250 % éch. 02/05/2034                                           |  |  |  | 4 200                               |                                  |                           | 4 454                   |  |  | 0,07   |                                     |                                  | Renaissance Home Equity Loan Trust                                                       |  |  |      | 5,797 % éch. 25/08/2036 |                                     |                                  | 780                       |  |          | 256                     |  |       | 0,00                                              |    |      | 4,283 % éch. 25/01/2036                       |                         |  |  | 102                     |  |  | 100   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| ICBC Standard Bank PLC                                            |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Saxon Asset Securities Trust                                                             |  |  |      | 138                     |                                     |                                  | 135                       |  |          | 0,00                    |  |       | Impac CMB Trust                                   |    |      |                                               | 4,403 % éch. 25/03/2035 |  |  | 51                      |  |  | 50    |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 20,000 % éch. 18/09/2029                                          |  |  |  | UZS 410 475 000                     |                                  |                           | 34 157                  |  |  | 0,50   |                                     |                                  | Soundview Home Loan Trust                                                                |  |  |      | 138                     |                                     |                                  | 135                       |  |          | 0,00                    |  |       | IndyMac Mortgage Loan Trust                       |    |      |                                               | 3,393 % éch. 25/11/2037 |  |  | 143                     |  |  | 118   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 20,000 % éch. 13/12/2029                                          |  |  |  | 142 776 000                         |                                  |                           | 11 881                  |  |  | 0,18   |                                     |                                  | 3,933 % éch. 25/08/2037                                                                  |  |  |      | 481                     |                                     |                                  | 422                       |  |          | 0,01                    |  |       | 4,123 % éch. 25/02/2037                           |    |      |                                               | 1 038                   |  |  | 1 013                   |  |  | 0,02  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| NAK Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance PLC                       |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,263 % éch. 25/11/2036                                                                  |  |  |      | 51                      |                                     |                                  | 49                        |  |          | 0,00                    |  |       | 4,403 % éch. 25/07/2045                           |    |      |                                               | 234                     |  |  | 175                     |  |  | 0,00  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 7,125 % éch. 19/07/2026                                           |  |  |  | € 3 131                             |                                  |                           | 3 275                   |  |  | 0,05   |                                     |                                  | 4,663 % éch. 25/10/2037                                                                  |  |  |      | 1 055                   |                                     |                                  | 840                       |  |          | 0,01                    |  |       | JPMorgan Resecuritization Trust                   |    |      |                                               | 2,500 % éch. 25/03/2056 |  |  | 47                      |  |  | 46    |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                    |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                            |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       | Lehman XS Trust                                   |    |      |                                               | 4,143 % éch. 25/09/2046 |  |  | 1 592                   |  |  | 1 472 |  |  | 0,02 |  |  |      |  |  |
| 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                                       |  |  |  | \$ 49 971                           |                                  |                           | 40 704                  |  |  | 0,60   |                                     |                                  | Azul Secured Finance LLP                                                                 |  |  |      | 9 200                   |                                     |                                  | 8 823                     |  |          | 0,13                    |  |       | Residential Accredit Loans, Inc. Trust            |    |      |                                               | 6,000 % éch. 25/08/2036 |  |  | 240                     |  |  | 202   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| Sibanye-Stillwater UK Financing PLC                               |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 9,875 % éch. 15/02/2031                                                                  |  |  |      | 52 400                  |                                     |                                  | 53 482                    |  |          | 0,79                    |  |       | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust    |    |      |                                               | 4,660 % éch. 25/09/2037 |  |  | 19                      |  |  | 17    |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 6,250 % éch. 15/11/2031                                           |  |  |  | 2 200                               |                                  |                           | 2 178                   |  |  | 0,03   |                                     |                                  | Beignet Investor LLC                                                                     |  |  |      | 8 750                   |                                     |                                  | 9 086                     |  |          | 0,13                    |  |       | Structured Asset Mortgage Investments Trust       |    |      |                                               | 4,063 % éch. 25/02/2037 |  |  | 544                     |  |  | 536   |  |  | 0,01 |  |  |      |  |  |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                              |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Cantor Fitzgerald LP                                                                     |  |  |      | 12 600                  |                                     |                                  | 12 521                    |  |          | 0,19                    |  |       | SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust      |    |      |                                               | 4,461 % éch. 25/10/2037 |  |  | 370                     |  |  | 329   |  |  | 0,01 |  |  |      |  |  |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                                           |  |  |  | £ 1 600                             |                                  |                           | 2 256                   |  |  | 0,03   |                                     |                                  | 7,200 % éch. 12/12/2028                                                                  |  |  |      | 11 300                  |                                     |                                  | 11 269                    |  |          | 0,17                    |  |       | TBW Mortgage-Backed Trust                         |    |      |                                               | 6,540 % éch. 25/01/2037 |  |  | 1 189                   |  |  | 253   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC                     |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | PacifiCorp                                                                               |  |  |      | 8,200 % éch. 06/04/2028 |                                     |                                  | 2 916                     |  |          | 2 992                   |  |       | 0,04                                              |    |      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                         |  |  | 3,976 % éch. 25/02/2037 |  |  | 124   |  |  | 113  |  |  | 0,00 |  |  |
| 8,250 % éch. 09/07/2026 ^                                         |  |  |  | \$ 15 330                           |                                  |                           | 12 993                  |  |  | 0,19   |                                     |                                  | 7,950 % éch. 06/01/2027                                                                  |  |  |      | 1 420                   |                                     |                                  | 1 441                     |  |          | 0,02                    |  |       | 4,133 % éch. 25/05/2034                           |    |      |                                               | 97                      |  |  | 92                      |  |  | 0,00  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| Vedanta Resources Finance PLC                                     |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Rutas 2 & 7 Finance Ltd.                                                                 |  |  |      | 3 920                   |                                     |                                  | 3 011                     |  |          | 0,04                    |  |       | 4,262 % éch. 25/03/2036                           |    |      |                                               | 730                     |  |  | 666                     |  |  | 0,01  |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 9,475 % éch. 24/07/2030                                           |  |  |  | 2 800                               |                                  |                           | 2 839                   |  |  | 0,04   |                                     |                                  | 0,000 % éch. 30/09/2036 (d)                                                              |  |  |      | 102 625                 |                                     |                                  | 1,51                      |  |          | 4,814 % éch. 25/01/2046 |  |       |                                                   | 72 |      |                                               | 65                      |  |  | 0,00                    |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 9,850 % éch. 24/04/2033                                           |  |  |  | 2 900                               |                                  |                           | 3 146                   |  |  | 0,05   |                                     |                                  | RD Michigan Property Owner LLC                                                           |  |  |      | 11 300                  |                                     |                                  | 11 269                    |  |          | 0,17                    |  |       | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust      |    |      |                                               | 6,787 % éch. 25/10/2036 |  |  | 177                     |  |  | 171   |  |  | 0,00 |  |  |      |  |  |
| 10,875 % éch. 17/09/2029                                          |  |  |  | 7 200                               |                                  |                           | 7 656                   |  |  | 0,11   |                                     |                                  | 7,500 % éch. 30/03/2045                                                                  |  |  |      | 11 300                  |                                     |                                  | 11 269                    |  |          | 0,17                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
| 11,250 % éch. 03/12/2031                                          |  |  |  | 5 300                               |                                  |                           | 5 818                   |  |  | 0,09   |                                     |                                  | Rio Oil Finance Trust                                                                    |  |  |      | 2 916                   |                                     |                                  | 2 992                     |  |          | 0,04                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 8,200 % éch. 06/04/2028                                                                  |  |  |      | 2 916                   |                                     |                                  | 2 992                     |  |          | 0,04                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 9,750 % éch. 06/01/2027                                                                  |  |  |      | 1 420                   |                                     |                                  | 1 441                     |  |          | 0,02                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Rutas 2 & 7 Finance Ltd.                                                                 |  |  |      | 3 920                   |                                     |                                  | 3 011                     |  |          | 0,04                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 0,000 % éch. 30/09/2036 (d)                                                              |  |  |      | 102 625                 |                                     |                                  | 1,51                      |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Ecopetrol S.A.                                                                           |  |  |      | 9 000                   |                                     |                                  | 9 033                     |  |          | 0,14                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 5,843 % éch. 18/12/2027                                                                  |  |  |      | 11 000                  |                                     |                                  | 11 027                    |  |          | 0,16                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Ministère des finances de l'Angola                                                       |  |  |      | 11 000                  |                                     |                                  | 11 027                    |  |          | 0,16                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 9,388 % éch. 16/02/2027                                                                  |  |  |      | 11 000                  |                                     |                                  | 11 027                    |  |          | 0,16                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Stepstone Group Midco GmbH                                                               |  |  |      | 16 500                  |                                     |                                  | 15 486                    |  |          | 0,23                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 6,885 % éch. 26/04/2032                                                                  |  |  |      | € 16 500                |                                     |                                  | 15 486                    |  |          | 0,23                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Ziraat Bank                                                                              |  |  |      | 12 100                  |                                     |                                  | 12 322                    |  |          | 0,18                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 6,764 % éch. 15/06/2034                                                                  |  |  |      | \$ 12 100               |                                     |                                  | 12 322                    |  |          | 0,18                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.                                  |  |  |      | 3 700                   |                                     |                                  | 3 663                     |  |          | 0,05                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,407 % éch. 15/11/2061                                                                  |  |  |      | 3 700                   |                                     |                                  | 3 663                     |  |          | 0,05                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Banc of America Mortgage Trust                                                           |  |  |      | 3                       |                                     |                                  | 2                         |  |          | 0,00                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,288 % éch. 25/02/2036                                                                  |  |  |      | 3                       |                                     |                                  | 2                         |  |          | 0,00                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | BCAP LLC Trust                                                                           |  |  |      | 2 475                   |                                     |                                  | 2 231                     |  |          | 0,03                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                              |  |  |      | 65                      |                                     |                                  | 58                        |  |          | 0,00                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,015 % éch. 25/05/2047                                                                  |  |  |      | 2                       |                                     |                                  | 2                         |  |          | 0,00                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 4,974 % éch. 25/01/2035                                                                  |  |  |      | 28                      |                                     |                                  | 27                        |  |          | 0,00                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                 |  |  |      | 1 700                   |                                     |                                  | 1 674                     |  |          | 0,03                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 5,044 % éch. 25/05/2035                                                                  |  |  |      | 1 700                   |                                     |                                  | 1 674                     |  |          | 0,03                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | Benchmark Mortgage Trust                                                                 |  |  |      | 1 700                   |                                     |                                  | 1 674                     |  |          | 0,03                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  | 3,666 % éch. 15/01/2051                                                                  |  |  |      | 1 700                   |                                     |                                  | 1 674                     |  |          | 0,03                    |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |
|                                                                   |  |  |  |                                     |                                  |                           |                         |  |  |        |                                     |                                  |                                                                                          |  |  |      |                         |                                     |                                  |                           |  |          |                         |  |       |                                                   |    |      |                                               |                         |  |  |                         |  |  |       |  |  |      |  |  |      |  |  |

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

| DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,000 % éch. 28/02/2030 | \$ 33 100                           | \$ 32 904                        | 0,49                      |
| 4,250 % éch. 15/01/2028 | 300                                 | 300                              | 0,00                      |
| 4,625 % éch. 30/04/2029 | 450                                 | 455                              | 0,01                      |
|                         |                                     | 162 988                          | 2,40                      |

| ACTIONS                                                             |   |         |      |
|---------------------------------------------------------------------|---|---------|------|
| <b>BONS DE SOUSCRIPTION</b>                                         |   |         |      |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071 (j) | 5 | 0       | 0,00 |
| Total États-Unis                                                    |   | 406 260 | 5,99 |

| DESCRIPTION                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>URUGUAY</b>                                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,250 % éch. 10/09/2060 | \$ 3 850                            | 3 587                            | 0,05                      |

| OUBÉKISTAN                                                         |       |        |      |
|--------------------------------------------------------------------|-------|--------|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                      |       |        |      |
| Uzbek Industrial and Construction Bank ATB 8,950 % éch. 24/07/2029 | 6 500 | 6 991  | 0,10 |
| Uzbekneftegaz JSC 4,750 % éch. 16/11/2028                          | 6 600 | 6 388  | 0,09 |
| 8,750 % éch. 07/05/2030                                            | 9 800 | 10 569 | 0,16 |
|                                                                    |       | 23 948 | 0,35 |

| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                   |         |       |      |
|---------------------------------------------------|---------|-------|------|
| Joint Stock Co. Asakabank 5,084 % éch. 07/12/2027 | € 5 900 | 6 729 | 0,10 |

| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                            |                |        |      |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------|------|
| National Bank of Uzbekistan 8,500 % éch. 05/07/2029                              | \$ 10 400      | 11 097 | 0,16 |
| 19,875 % éch. 05/07/2027                                                         | UZS 62 500 000 | 5 508  | 0,08 |
| Obligation internationale de la République d'Ouzbékistan 5,375 % éch. 29/05/2027 | € 8 000        | 9 279  | 0,14 |
| Obligation internationale du gouvernement ouzbek 3,700 % éch. 25/11/2030         | \$ 200         | 187    | 0,00 |
| 3,900 % éch. 19/10/2031                                                          | 10 700         | 9 953  | 0,15 |
|                                                                                  |                | 36 024 | 0,53 |
| Total Ouzbékistan                                                                |                | 66 701 | 0,98 |

| VENEZUELA                                             |        |        |      |
|-------------------------------------------------------|--------|--------|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |        |        |      |
| Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % éch. 12/04/2027 ^ | 79 470 | 29 324 | 0,43 |
| 5,500 % éch. 12/04/2037 ^                             | 19 365 | 7 117  | 0,11 |
| 6,000 % éch. 16/05/2024 ^                             | 34 990 | 13 191 | 0,19 |
| 6,000 % éch. 15/11/2026 ^                             | 13 040 | 4 923  | 0,07 |
| 8,500 % éch. 27/10/2020 ^                             | 13 295 | 13 949 | 0,21 |
| 9,750 % éch. 17/05/2035 ^                             | 31 660 | 14 162 | 0,21 |
| 12,750 % éch. 17/02/2022 ^                            | 780    | 391    | 0,01 |
|                                                       |        | 83 057 | 1,23 |

| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                           |        |        |      |
|---------------------------------------------------------------------------------|--------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien 7,000 % éch. 31/03/2038 ^ | 20 150 | 8 866  | 0,13 |
| 7,650 % éch. 21/04/2025 ^                                                       | 25 613 | 11 526 | 0,17 |

| DESCRIPTION                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 7,750 % éch. 13/10/2019 ^  | \$ 20 130                           | \$ 8 953                         | 0,13                      |
| 8,250 % éch. 13/10/2024 ^  | 23 245                              | 10 576                           | 0,15                      |
| 9,000 % éch. 07/05/2023 ^  | 13 378                              | 6 354                            | 0,09                      |
| 9,250 % éch. 15/09/2027 ^  | 18 940                              | 9 352                            | 0,14                      |
| 9,250 % éch. 07/05/2028 ^  | 52 898                              | 25 523                           | 0,38                      |
| 11,750 % éch. 21/10/2026 ^ | 940                                 | 517                              | 0,01                      |
| 11,950 % éch. 05/08/2031 ^ | 6 150                               | 3 352                            | 0,05                      |
|                            |                                     | 85 019                           | 1,25                      |
|                            |                                     | 168 076                          | 2,48                      |

Total Venezuela

| ZAMBIE                                                                    |     |     |      |
|---------------------------------------------------------------------------|-----|-----|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                     |     |     |      |
| Obligation internationale du gouvernement zambien 5,750 % éch. 30/06/2033 | 181 | 179 | 0,00 |

| INSTRUMENTS À COURT TERME             |          |        |      |
|---------------------------------------|----------|--------|------|
| BILLETS À COURT TERME                 |          |        |      |
| Kona Spc Ltd. 5,718 % éch. 15/09/2026 | € 20 300 | 23 218 | 0,34 |

| BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN             |           |        |      |
|-------------------------------------|-----------|--------|------|
| 23,650 % éch. 13/10/2026 (d)(e) EGP | 449 000   | 8 568  | 0,13 |
| 23,700 % éch. 15/09/2026 (d)(e)     | 28 900    | 561    | 0,01 |
| 24,000 % éch. 13/10/2026 (d)(e)     | 655 000   | 12 499 | 0,18 |
| 24,050 % éch. 20/10/2026 (d)(e)     | 125 200   | 2 379  | 0,03 |
| 24,060 % éch. 20/10/2026 (d)(e)     | 15 100    | 287    | 0,00 |
| 24,200 % éch. 22/09/2026 (d)(e)     | 137 200   | 2 653  | 0,04 |
| 24,449 % éch. 10/11/2026 (d)(e)     | 57 575    | 1 080  | 0,02 |
| 24,449 % éch. 17/11/2026 (d)(e)     | 200 000   | 3 735  | 0,05 |
| 24,550 % éch. 10/11/2026 (d)(e)     | 137 875   | 2 587  | 0,04 |
| 24,651 % éch. 10/11/2026 (d)(e)     | 2 049 200 | 38 447 | 0,57 |
| 26,001 % éch. 07/07/2026 (d)(e)     | 364 325   | 7 379  | 0,11 |
|                                     |           | 80 175 | 1,18 |

| BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN             |            |        |      |
|-------------------------------------|------------|--------|------|
| 20,537 % éch. 14/01/2027 (d)(e) NGN | 19 699 30  | 0      | 0,19 |
| 20,607 % éch. 21/01/2027 (d)(e)     | 18 930 700 | 12 331 | 0,18 |
| 20,677 % éch. 28/01/2027 (d)(e)     | 19 005 700 | 12 324 | 0,18 |
| 21,064 % éch. 13/10/2026 (d)(e)     | 1 503 600  | 1 031  | 0,01 |
| 21,150 % éch. 20/10/2026 (d)(e)     | 1 503 600  | 1 028  | 0,02 |
| 21,186 % éch. 07/07/2026 (d)(e)     | 3 359 687  | 2 441  | 0,04 |
| 21,265 % éch. 20/10/2026 (d)(e)     | 1 503 600  | 1 028  | 0,02 |
| 21,270 % éch. 01/09/2026 (d)(e)     | 839 000    | 590    | 0,01 |
| 21,310 % éch. 20/10/2026 (d)(e)     | 213 547    | 146    | 0,00 |
| 21,323 % éch. 20/10/2026 (d)(e)     | 300 700    | 206    | 0,00 |
| 21,333 % éch. 15/09/2026 (d)(e)     | 726 000    | 506    | 0,01 |
| 21,380 % éch. 03/11/2026 (d)(e)     | 10 269 900 | 6 972  | 0,10 |

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 21,445 % éch. 27/10/2026 (d)(e) NGN | 6 676 800                           | \$ 4 544                         | 0,07                      |
| 21,488 % éch. 03/11/2026 (d)(e)     | 6 676 600                           | 4 533                            | 0,07                      |
| 21,702 % éch. 18/08/2026 (d)(e)     | 11 575 200                          | 8 192                            | 0,12                      |
|                                     |                                     | 68 760                           | 1,02                      |

| BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN             |        |        |      |
|--------------------------------------|--------|--------|------|
| 3,655 % éch. 20/08/2026 (d)(e)(l)    | \$ 700 | 696    | 0,01 |
| 3,659 % éch. 16/07/2026 (d)(e)(l)    | 1 040  | 1 038  | 0,02 |
| 3,671 % éch. 27/08/2026 (d)(e)(l)    | 178    | 177    | 0,00 |
| 3,678 % éch. 21/07/2026 (d)(e)(l)    | 2 000  | 1 996  | 0,03 |
| 3,678 % éch. 11/08/2026 (d)(e)(l)    | 1 699  | 1 692  | 0,03 |
| 3,679 % éch. 30/07/2026 (d)(e)(l)    | 2 248  | 2 242  | 0,03 |
| 3,680 % éch. 21/07/2026 (d)(e)(l)    | 1 200  | 1 198  | 0,02 |
| 3,683 % éch. 04/08/2026 (a)(d)(e)(l) | 1 433  | 1 428  | 0,02 |
| 3,694 % éch. 28/07/2026 (d)(e)(l)    | 200    | 199    | 0,00 |
| 3,696 % éch. 13/08/2026 (a)(d)(e)(l) | 2 900  | 2 887  | 0,04 |
| 3,697 % éch. 15/09/2026 (d)(e)(l)    | 100    | 99     | 0,00 |
| 3,699 % éch. 04/08/2026 (a)(d)(e)(l) | 687    | 685    | 0,01 |
| 3,700 % éch. 10/09/2026 (d)(e)(l)    | 18 500 | 18 367 | 0,27 |
| 3,702 % éch. 11/08/2026 (d)(e)(l)    | 2 600  | 2 589  | 0,04 |
| 3,702 % éch. 01/09/2026 (a)(d)(e)(l) | 400    | 398    | 0,01 |
| 3,704 % éch. 28/07/2026 (d)(e)(l)    | 1 200  | 1 197  | 0,02 |
| 3,707 % éch. 08/09/2026 (d)(e)(l)    | 200    | 199    | 0,00 |
| 3,713 % éch. 11/08/2026 (d)(e)(l)    | 889    | 885    | 0,01 |
| 3,713 % éch. 27/08/2026 (d)(e)(l)    | 1 480  | 1 471  | 0,02 |
| 3,715 % éch. 04/08/2026 (a)(d)(e)(l) | 400    | 399    | 0,01 |
| 3,722 % éch. 10/09/2026 (d)(e)(l)    | 1 000  | 993    | 0,01 |
| 3,723 % éch. 10/09/2026 (d)(e)(l)    | 300    | 298    | 0,00 |
| 3,839 % éch. 20/10/2026 (d)(e)       | 41 600 | 41 116 | 0,61 |
|                                      |        | 82 249 | 1,21 |

|                                     |  |              |        |
|-------------------------------------|--|--------------|--------|
| Total des Instruments à court terme |  | 254 402      | 3,75   |
| Total des Valeurs mobilières        |  | \$ 7 193 377 | 106,08 |

| ACTIONS                                                                         |         |          |      |
|---------------------------------------------------------------------------------|---------|----------|------|
| FONDS D'INVESTISSEMENT                                                          |         |          |      |
| ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF                                               |         |          |      |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | 392 914 | 3 918    | 0,06 |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (h)          | 384 360 | 6 019    | 0,09 |
| Total des Fonds d'investissement                                                |         | \$ 9 937 | 0,15 |

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

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

**CONTRATS À TERME STANDARDISÉS**

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026           | 250                | \$ (146)                          | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 3 856              | 1 033                             | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 1 676              | (2 581)                           | (0,04)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 10                 | (5)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026           | 2 115              | (217)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 3 043              | (361)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 3 235              | 749                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 13 036             | 11 124                            | 0,16                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026           | 116                | (163)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 1 054              | 2 657                             | 0,04                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | <b>\$ 12 090</b>                  | <b>0,18</b>         |
|                                                                                                   |       |                   |                    | <b>\$ 12 090</b>                  | <b>0,18</b>         |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)**

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

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>**

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Oracle Corp.        | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 25 000                        | \$ 1                              | 0,00                |
| Oracle Corp.        | 1,000                | 20/12/2027      | 10 000                           | 28                                | 0,00                |
|                     |                      |                 |                                  | <b>\$ 29</b>                      | <b>0,00</b>         |

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>**

| Indice/Tranches                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | (1,000) %           | 20/12/2030      | \$ 5 500                         | \$ (111)                          | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | (1,000)             | 20/06/2031      | 296 800                          | (864)                             | (0,01)              |
|                                |                     |                 |                                  | <b>\$ (975)</b>                   | <b>(0,01)</b>       |

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>**

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-43 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/06/2030      | \$2 500                          | \$ 99                             | 0,00                |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 69 150                           | 848                               | 0,01                |
|                                |                      |                 |                                  | <b>\$ 947</b>                     | <b>0,01</b>         |

**SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT**

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 %   | 15/06/2029      | \$ 11 100         | \$ (388)                          | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 21/06/2027      | 13 700            | (1 185)                           | (0,02)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 15/12/2028      | 400               | (29)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 15/12/2031      | 5 700             | (775)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250     | 21/12/2046      | 1 200             | 642                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,500     | 15/06/2046      | 600               | 330                               | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 19/03/2030      | 60 200            | 1 120                             | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2030      | 28 600            | 296                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 17/06/2031      | 1 650             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2035      | 18 900            | (313)                             | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2055      | 34 300            | (1 334)                           | (0,02)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2055      | 8 000             | (199)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,325     | 31/08/2030      | 187 420           | 3 337                             | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      | 40 500            | 1 354                             | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      | 152 400           | (1 556)                           | (0,02)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 75 150            | 985                               | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      | 12 640            | 299                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730     | 03/08/2033      | 3 300             | (37)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 07/08/2033      | 3 700             | (39)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/12/2028      | 2 100             | 66                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 26 000            | (45)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 13 800            | 331                               | 0,00                |



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

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable       | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------|-------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 %      | 18/12/2029         | \$ 15 525            | \$ 38                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 18/12/2029         | 1 060                | (4)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 17/12/2030         | 39 300               | 774                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 17/12/2032         | 144 100              | 3 791                                   | 0,06                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 20/06/2034         | 29 100               | 561                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 20/06/2034         | 14 800               | (396)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 18/12/2034         | 5 900                | (20)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 17/12/2035         | 32 600               | 895                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 20/06/2036         | 3 300                | 78                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 20/06/2039         | 3 600                | 284                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 20/06/2039         | 11 400               | (68)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 18/12/2039         | 11 500               | 517                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750        | 17/12/2055         | 58 000               | (2 336)                                 | (0,03)                 |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830        | 12/10/2053         | 2 300                | (130)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870        | 17/10/2053         | 1 900                | (95)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880        | 16/10/2053         | 2 300                | (112)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000        | 30/11/2030         | 62 380               | (229)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030        | 04/10/2033         | 300                  | 3                                       | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150        | 12/10/2033         | 4 500                | 87                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155        | 02/10/2033         | 6 200                | 121                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165        | 27/09/2033         | 7 200                | 148                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170        | 03/10/2033         | 8 900                | 184                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175        | 10/10/2033         | 5 300                | 110                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220        | 20/10/2033         | 4 000                | 95                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230        | 23/10/2033         | 2 200                | 54                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250        | 20/03/2034         | 58 400               | 1 202                                   | 0,02                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255        | 23/10/2033         | 2 400                | 63                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393        | 25/10/2033         | 400                  | 14                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450        | 31/10/2033         | 3 800                | 153                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 9,842        | 04/01/2027         | BRL 454 300          | (7 388)                                 | (0,11)                 |
| À recevoir                              | CDI BRL à un an               | 11,253       | 04/01/2027         | 303 800              | 2 949                                   | 0,04                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,550       | 04/01/2027         | 21 000               | (173)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,570       | 04/01/2027         | 270 400              | (2 211)                                 | (0,03)                 |
| À recevoir                              | CDI BRL à un an               | 12,716       | 02/01/2029         | 1 800                | 8                                       | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,015       | 02/01/2029         | 155 000              | (576)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | CDI BRL à un an               | 13,030       | 02/01/2029         | 134 800              | 554                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | CDI BRL à un an               | 13,055       | 04/01/2027         | 102 700              | 78                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,056       | 02/01/2029         | 302 600              | (1 449)                                 | (0,02)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,255       | 02/01/2031         | 250 200              | (872)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,265       | 02/01/2029         | 136 700              | (449)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,310       | 02/01/2029         | 89 300               | (316)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,320       | 02/01/2029         | 177 600              | (631)                                   | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,350       | 02/01/2031         | 27 200               | (89)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,370       | 03/01/2033         | 124 300              | (404)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,440       | 02/01/2031         | 66 500               | (187)                                   | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,520       | 02/01/2031         | 180 200              | (444)                                   | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,560       | 02/01/2031         | 149 900              | (336)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,615       | 02/01/2029         | 117 500              | (339)                                   | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,670       | 02/01/2031         | 32 100               | (55)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,681       | 02/01/2031         | 131 000              | (212)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,685       | 02/01/2029         | 117 500              | (291)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | CDI BRL à un an               | 14,410       | 04/01/2027         | 454 300              | (229)                                   | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | JIBAR ZAR à 3 mois            | 6,770        | 10/03/2028         | ZAR 226 900          | (123)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CHILIBOR CLP à 6 mois         | 4,855        | 18/12/2033         | CLP 10 615 700       | (43)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | CHILIBOR CLP à 6 mois         | 5,511        | 13/11/2033         | 11 556 400           | (495)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,075        | 03/10/2029         | CZK 754 000          | (582)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,325        | 09/05/2030         | 1 148 000            | 1 500                                   | 0,02                   |
| À recevoir                              | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,363        | 29/05/2030         | 1 601 300            | 1 256                                   | 0,02                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,489        | 30/10/2029         | 707 100              | 171                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,530        | 15/07/2029         | 1 215 700            | 123                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,636        | 09/02/2031         | 2 950 022            | 1 536                                   | 0,02                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,715        | 18/11/2030         | 2 662 000            | 1 937                                   | 0,03                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,920        | 09/02/2031         | 244 900              | (232)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 3,930        | 22/05/2036         | 435 700              | 97                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,049        | 12/12/2030         | 672 800              | 577                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,250        | 18/04/2029         | 353 200              | (341)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,470        | 25/05/2031         | 417 156              | 334                                     | 0,01                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,480        | 11/03/2036         | 1 463 333            | 1 532                                   | 0,02                   |
| À payer                                 | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,625        | 25/05/2036         | 346 836              | 563                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,250        | 20/03/2044         | € 2 500              | 197                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>               | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,500        | 16/09/2031         | 191 870              | (108)                                   | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>               | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,750        | 16/09/2036         | 211 700              | (32)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,818        | 26/06/2029         | 35 200               | (935)                                   | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                  | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,000        | 16/09/2056         | 12 980               | (4)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,300        | 03/10/2033         | 5 100                | 316                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,370        | 09/10/2028         | 1 800                | 72                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,450        | 20/10/2028         | 8 200                | 350                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | BBR HUF à 6 mois              | 5,935        | 08/05/2030         | HUF 20 486 000       | 2 215                                   | 0,03                   |
| À recevoir                              | BBR HUF à 6 mois              | 6,040        | 15/04/2036         | 1 252 700            | (393)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | BBR HUF à 6 mois              | 6,070        | 15/04/2036         | 2 028 000            | (652)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | BBR HUF à 6 mois              | 6,190        | 18/11/2030         | 5 752 700            | (1 681)                                 | (0,02)                 |

| Taux variable à payer/à recevoir                          | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                                | BBR HUF à 6 mois        | 6,410 %   | 21/11/2030      | HUF | 7 566 400         | \$ (2 219)                        | (0,03)              |
| À recevoir                                                | BBR HUF à 6 mois        | 6,430     | 14/04/2036      |     | 1 314 800         | (540)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                                | BBR HUF à 6 mois        | 6,439     | 24/11/2030      |     | 2 295 600         | (687)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                                | BBR HUF à 6 mois        | 6,485     | 14/04/2036      |     | 1 305 700         | (554)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                                | BBR HUF à 6 mois        | 6,500     | 25/11/2030      |     | 570 700           | (175)                             | 0,00                |
| À payer                                                   | BBR HUF à 6 mois        | 6,910     | 19/03/2036      |     | 2 790 700         | 1 491                             | 0,02                |
| À payer                                                   | BBR HUF à 6 mois        | 7,020     | 16/03/2036      |     | 5 538 900         | 3 118                             | 0,05                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | BBR HUF à 6 mois        | 7,050     | 11/03/2036      |     | 2 631 062         | (1 241)                           | (0,02)              |
| À recevoir                                                | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,075     | 11/04/2030      | PLN | 126 100           | (212)                             | 0,00                |
| À payer                                                   | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,655     | 16/03/2036      |     | 33 200            | 310                               | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,678     | 11/03/2036      |     | 28 500            | 283                               | 0,00                |
| À payer                                                   | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,828     | 17/03/2036      |     | 16 600            | 217                               | 0,00                |
| À payer                                                   | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,855     | 10/02/2030      |     | 126 100           | 1 031                             | 0,02                |
| À recevoir                                                | TIIE MXN à 28 jours     | 8,193     | 04/06/2036      | MXN | 82 800            | (25)                              | 0,00                |
| À payer                                                   | TIIE MXN à 28 jours     | 8,280     | 06/03/2036      |     | 79 000            | 56                                | 0,00                |
| À payer                                                   | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 04/06/2036      |     | 3 800             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                                                | TIIE MXN à 28 jours     | 8,873     | 23/11/2034      |     | 1 331 200         | (4 092)                           | (0,06)              |
| À payer                                                   | TIIE MXN à 28 jours     | 9,080     | 23/11/2034      |     | 193 900           | 739                               | 0,01                |
| À payer                                                   | TIIE MXN à 28 jours     | 9,265     | 23/11/2034      |     | 505 300           | 2 257                             | 0,03                |
| À payer                                                   | TIIE MXN à 28 jours     | 9,335     | 23/11/2034      |     | 206 400           | 973                               | 0,01                |
| À payer                                                   | TIIE MXN à 28 jours     | 9,375     | 23/11/2034      |     | 389 700           | 1 379                             | 0,02                |
|                                                           |                         |           |                 |     |                   | \$ 4 845                          | 0,07                |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés compensés</b> |                         |           |                 |     |                   | <b>\$ 4 846</b>                   | <b>0,07</b>         |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et qu'un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant égal au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et qu'un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou les titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Montant maximum potentiel que le Fonds peut être tenu de verser en tant que vendeur de protection de crédit ou peut recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit si un événement de crédit survient tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option de vente - EUR contre BRL hors cote | BRL 5,850       | 19/08/2026        | 45 741                           | \$ 657 | \$ 231       | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - EUR contre BRL hors cote | BRL 6,250       | 19/08/2026        | 45 741                           | \$ (736)   | \$ (270)     | (0,01)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 29 842                           | (383)      | (93)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | 375,000         | 10/11/2026        | 30 494                           | (484)      | (262)        | 0,00                |
|              |                                           |                 |                   |                                  | \$ (1 603) | \$ (625)     | (0,01)              |

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/reçues | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000) %           | 20/06/2035      | \$ 3 800                         | \$ 263               | \$ (147)                          | \$ 116       | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen | (1,000)             | 20/12/2029      | 2 000                            | 69                   | (94)                              | (25)         | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement hongrois | (1,000)             | 20/12/2029      | 9 000                            | 71                   | (224)                             | (153)        | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)             | 20/06/2035      | 4 100                            | 274                  | (149)                             | 125          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/06/2034      | 32 700                           | (355)                | (23)                              | (378)        | (0,01)              |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)             | 20/06/2035      | 5 700                            | 389                  | (215)                             | 174          | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)             | 20/06/2035      | 900                              | 61                   | (33)                              | 28           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen | (1,000)             | 20/12/2029      | 4 050                            | 123                  | (173)                             | (50)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/06/2034      | 13 900                           | (159)                | (1)                               | (160)        | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000)             | 20/06/2034      | 25 800                           | (291)                | (7)                               | (298)        | 0,00                |
|              |                                                    |                     |                 |                                  | \$ 445               | \$ (1 066)                        | \$ (621)     | (0,01)              |



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

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000 %              | 20/12/2026      | \$ 300                           | \$ 5                   | \$ 1                              | \$ 6         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/06/2035      | 2 500                            | (289)                  | 115                               | (174)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/12/2026      | 700                              | 4                      | (1)                               | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/12/2027      | 5 000                            | (18)                   | 78                                | 60           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/12/2030      | 2 700                            | (137)                  | 102                               | (35)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2026      | 5 000                            | (100)                  | 98                                | (2)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/06/2027      | 4 400                            | (121)                  | 108                               | (13)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2028      | 1 300                            | (289)                  | 261                               | (28)         | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/12/2026      | 16 000                           | (190)                  | 203                               | 13           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain              | 1,000                | 20/06/2031      | 8 600                            | (91)                   | (1)                               | (92)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain              | 1,000                | 20/12/2035      | 3 800                            | (441)                  | 142                               | (299)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/12/2028      | 14 000                           | (1 126)                | 1 006                             | (120)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/12/2035      | 400                              | (67)                   | 13                                | (54)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/12/2026      | 2 000                            | 33                     | 9                                 | 42           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/12/2027      | 2 500                            | (171)                  | 187                               | 16           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/12/2026      | 6 800                            | 39                     | (10)                              | 29           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/06/2027      | 10 000                           | (182)                  | 264                               | 82           | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/12/2026      | 4 900                            | 6                      | 13                                | 19           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/12/2027      | 9 300                            | 19                     | 68                                | 87           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement philippin                 | 1,000                | 20/06/2031      | 21 200                           | 44                     | 311                               | 355          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien                  | 1,000                | 20/06/2030      | 200                              | 4                      | 0                                 | 4            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement serbe                     | 1,000                | 20/12/2027      | 1 800                            | (160)                  | 170                               | 10           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain              | 1,000                | 20/06/2031      | 100                              | (1)                    | 0                                 | (1)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2031      | 7 300                            | (373)                  | (1)                               | (374)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/12/2026      | 2 292                            | 14                     | 34                                | 48           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/06/2027      | 6 200                            | 74                     | 145                               | 219          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/12/2035      | 1 400                            | (206)                  | 72                                | (134)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien                | 5,000                | 20/12/2026      | 10 000                           | 157                    | 46                                | 203          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien                | 5,000                | 20/12/2027      | 10 000                           | 328                    | 131                               | 459          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2026      | 16 700                           | (290)                  | 282                               | (8)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/06/2027      | 16 600                           | (200)                  | 151                               | (49)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2029      | 3 300                            | (534)                  | 406                               | (128)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen                  | 1,000                | 20/06/2031      | 5 600                            | 24                     | 10                                | 34           | 0,00                |
| BRC          | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/12/2026      | 2 600                            | (16)                   | 18                                | 2            | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/12/2027      | 27 500                           | (674)                  | 562                               | (112)        | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/06/2030      | 7 900                            | (690)                  | 451                               | (239)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement roumain                   | 1,000                | 20/12/2029      | 3 600                            | (157)                  | 147                               | (10)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien                  | 1,000                | 20/06/2030      | 65 500                           | 925                    | 309                               | 1 234        | 0,02                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien                  | 1,000                | 20/12/2030      | 25 000                           | 343                    | 120                               | 463          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain              | 1,000                | 20/06/2031      | 1 100                            | (14)                   | 2                                 | (12)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2031      | 4 000                            | (234)                  | 29                                | (205)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/12/2035      | 20 000                           | (3 329)                | 607                               | (2 722)      | (0,04)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/06/2027      | 9 800                            | (1 515)                | 1 862                             | 347          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement angolais                  | 1,000                | 20/06/2027      | 2 100                            | (67)                   | 44                                | (23)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/12/2026      | 2 965                            | 24                     | 38                                | 62           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/06/2027      | 10 354                           | (71)                   | 437                               | 366          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/12/2026      | 5 000                            | (237)                  | 251                               | 14           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/06/2035      | 2 500                            | (291)                  | 117                               | (174)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/12/2026      | 12 900                           | 14                     | 25                                | 39           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/06/2027      | 7 000                            | 9                      | 26                                | 35           | 0,00                |
| BSS<br>CBK   | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/12/2030      | 100                              | (5)                    | 4                                 | (1)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/06/2031      | 29 100                           | (582)                  | 14                                | (568)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire          | 1,000                | 20/06/2030      | 2 625                            | (331)                  | 248                               | (83)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | 1,000                | 20/06/2030      | 7 000                            | (450)                  | 429                               | (21)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien                | 5,000                | 20/06/2027      | 5 200                            | 176                    | 21                                | 197          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/12/2026      | 6 000                            | 11                     | 12                                | 23           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/06/2028      | 7 100                            | (8)                    | 90                                | 82           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen                  | 1,000                | 20/06/2030      | 300                              | (13)                   | 16                                | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement péruvien                  | 1,000                | 20/06/2030      | 32 900                           | (197)                  | 804                               | 607          | 0,01                |
|              | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/12/2026      | 6 600                            | (64)                   | 69                                | 5            | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/06/2031      | 17 100                           | (818)                  | (23)                              | (841)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2030      | 10 000                           | (825)                  | 520                               | (305)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/12/2035      | 15 000                           | (1 270)                | 122                               | (1 148)      | (0,02)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/12/2030      | 7 900                            | (396)                  | 294                               | (102)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/06/2031      | 27 600                           | (1 337)                | 798                               | (539)        | (0,01)              |
|              | Eskom                                                               | 4,650                | 30/06/2029      | 14 667                           | 0                      | 751                               | 751          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2029      | 600                              | (99)                   | 76                                | (23)         | 0,00                |
| GLM<br>GST   | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2030      | 20 000                           | (1 650)                | 1 039                             | (611)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2028      | 1 250                            | (270)                  | 243                               | (27)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/12/2026      | 8 517                            | 44                     | 135                               | 179          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/06/2027      | 21 561                           | (2 044)                | 2 807                             | 763          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/12/2030      | 39 100                           | (893)                  | 664                               | (229)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/12/2026      | 3 600                            | 33                     | (17)                              | 16           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement indonésien                | 1,000                | 20/06/2031      | 88 600                           | 82                     | 362                               | 444          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/06/2027      | 2 600                            | (62)                   | 54                                | (8)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2027      | 2 100                            | (81)                   | 64                                | (17)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen                  | 1,000                | 20/06/2030      | 800                              | (34)                   | 43                                | 9            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement polonais                  | 1,000                | 20/12/2029      | 22 200                           | 291                    | 172                               | 463          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien                  | 1,000                | 20/06/2030      | 68 000                           | 1 007                  | 274                               | 1 281        | 0,02                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2030      | 4 400                            | (434)                  | 300                               | (134)        | 0,00                |

| Contrepartie | Entité de référence                                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000 %              | 20/06/2027      | \$ 1 900                         | \$ 26                  | \$ 41                            | \$ 67        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/12/2026      | 7 700                            | 41                     | (8)                              | 33           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement chilien                   | 1,000                | 20/06/2027      | 10 000                           | (178)                  | 260                              | 82           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/12/2026      | 12 100                           | 15                     | 21                               | 36           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000                | 20/06/2031      | 5 300                            | (112)                  | 9                                | (103)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien                | 5,000                | 20/06/2027      | 14 800                           | 488                    | 71                               | 559          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2027      | 5 000                            | (215)                  | 175                              | (40)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2028      | 5 000                            | (1 158)                | 1 052                            | (106)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien                  | 1,000                | 20/06/2030      | 500                              | 9                      | 0                                | 9            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain              | 1,000                | 20/12/2035      | 1 200                            | (139)                  | 45                               | (94)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/12/2029      | 6 700                            | (462)                  | 311                              | (151)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2030      | 67 000                           | (6 433)                | 4 385                            | (2 048)      | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/12/2035      | 15 000                           | (2 487)                | 445                              | (2 042)      | (0,03)              |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin                  | 5,000                | 20/06/2027      | 23 355                           | (1 280)                | 2 107                            | 827          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/06/2027      | 8 200                            | (508)                  | 549                              | 41           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien                 | 1,000                | 20/12/2029      | 100                              | 0                      | 0                                | 0            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire          | 1,000                | 20/06/2030      | 1 400                            | (175)                  | 131                              | (44)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | 1,000                | 20/06/2030      | 17 500                           | (1 170)                | 1 118                            | (52)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/06/2027      | 200                              | (1)                    | 2                                | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/06/2028      | 3 000                            | (10)                   | 45                               | 35           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/12/2029      | 600                              | (6)                    | 13                               | 7            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2028      | 5 000                            | (1 137)                | 1 031                            | (106)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2029      | 5 000                            | (900)                  | 706                              | (194)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/06/2030      | 500                              | (132)                  | 108                              | (24)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/12/2030      | 1 100                            | (98)                   | 34                               | (64)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen                  | 1,000                | 20/06/2030      | 500                              | (22)                   | 28                               | 6            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen                  | 1,000                | 20/06/2031      | 2 000                            | 10                     | 2                                | 12           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement péruvien                  | 1,000                | 20/12/2026      | 3 000                            | (10)                   | 22                               | 12           | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                                 | 1,000                | 20/12/2026      | 25 000                           | (154)                  | 174                              | 20           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement qatari                    | 1,000                | 20/12/2026      | 5 300                            | 77                     | (53)                             | 24           | 0,00                |
|              | SoftBank Group Corp.                                                | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 2 838 100                      | (295)                  | 181                              | (114)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/12/2028      | \$ 20 200                        | (1 826)                | 1 653                            | (173)        | 0,00                |
| MYI          | Obligation internationale du gouvernement saoudien                  | 1,000                | 20/12/2030      | 12 500                           | 177                    | 55                               | 232          | 0,00                |
|              |                                                                     |                      |                 |                                  | \$ (38 499)            | \$ 34 556                        | \$ (3 943)   | (0,06)              |

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et qu'un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou les titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et qu'un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant égal au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Montant maximum potentiel que le Fonds peut être tenu de verser en tant que vendeur de protection de crédit ou peut recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit si un événement de crédit survient tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis.

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 49          | \$ 34             | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 74          | 58                | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 20           | CAD 29            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 29          | \$ 20             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9            | AUD 14            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL 162 333     | \$ 31 247         | 0                  | (116)                 | (116)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | DOP 200 084     | 3 401             | 24                 | 0                     | 24                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1 600         | 2 137             | 13                 | 0                     | 13                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 3 576         | 22                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 154       | 125               | 8                  | 0                     | 8                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 23 146      | 6 838             | 52                 | 0                     | 52                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON 35 497      | € 6 751           | 0                  | (15)                  | (15)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 818        | 1 562             | 0                  | (32)                  | (32)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 808           | KRW 4 276 439     | 0                  | (46)                  | (46)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 838           | PEN 23 140        | 0                  | (52)                  | (52)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP 44 511      | \$ 751            | 11                 | 0                     | 11                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 129         | 43                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 27 580       | BRL 144 416       | 104                | 0                     | 104                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 130             | HKD 1 016         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 482 392     | \$ 959            | 0                  | (25)                  | (25)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 12 856      | 3 783             | 24                 | 0                     | 24                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP 49 601      | 804               | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$ 3 667        | BRL 19 444        | 9                  | 0                     | 9                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 80 294 448  | \$ 20 185         | 0                  | (2 211)               | (2 211)                                | (0,03)              |
| BPS          | 07/2026           | BRL 163 133     | € 27 502          | 0                  | (75)                  | (75)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19 150          | \$ 3 678          | 0                  | (22)                  | (22)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 12 495      | 1 846             | 6                  | 0                     | 6                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 93 879      | 4 511             | 88                 | 0                     | 88                                     | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | €               | 18 208            | \$ 20 668          | \$ 0                  | \$ (149)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 249               | 85                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 12 097            | 76                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 25 853 487        | 17 108             | 409                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | RON             | 103               | 23                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 33 216            | BRL 167 785        | 0                     | (800)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 9 377             | € 8 216            | 20                    | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 701             | INR 452 808        | 75                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 677             | KWD 818            | 0                     | (37)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 525               | SEK 5 000          | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 26 676            | \$ 1 626           | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 14 561 613        | 821                | 15                    | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 31 965            | 9 300              | 0                     | (45)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 203               | IDR 3 672 994      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 27                | INR 2 526          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 5                 | THB 148            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 3 678             | BRL 19 571         | 22                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | IDR             | 3 697 977         | \$ 203             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 06/2027           | \$              | 1 393             | KWD 423            | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD             | 5 486             | \$ 18 859          | 968                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2029           |                 | 1 333             | 4 584              | 236                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 05/2030           |                 | 3 875             | 13 345             | 684                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2030           |                 | 1 260             | 4 248              | 130                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2031           |                 | 3 606             | 12 153             | 358                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 06/2031           |                 | 2 962             | 9 963              | 269                   | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | €               | 13 446            | RON 70 728         | 40                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 80                | \$ 93              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 276               | 93                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 8 386             | 2 065              | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 13 849            | 4 096              | 38                    | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON             | 66 821            | € 12 719           | 0                     | (27)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 722             | CZK 120 000        | 0                     | (69)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 42 309            | TRY 2 004 202      | 345                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 141 005           | \$ 8 682           | 92                    | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 08/2026           | COP             | 2 506 179         | 664                | 0                     | (58)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 63                | 44                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 3 081             | 3 592              | 70                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 64 105            | 403                | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 40 580            | 11 853             | 83                    | (126)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 47                | € 41               | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 254             | PEN 24 752         | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 44                | AUD 63             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 10/2026           | PEN             | 24 865            | \$ 7 254           | 0                     | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 95 790 817        | 25 137             | 0                     | (2 525)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           | EGP             | 84 350            | 1 683              | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 390               | 451                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 223 986           | 733                | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 278               | 96                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 290 216           | 192                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 142 333           | 40 565             | 75                    | (1 245)                                 | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$              | 1 615             | BRL 8 153          | 0                     | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 9 816             | COP 34 418 819     | 124                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 151             | EGP 172 798        | 342                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 11 707            | € 10 037           | 0                     | (231)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17 010            | HUF 5 311 009      | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1                 | KZT 547            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 32 211            | PEN 109 311        | 24                    | (187)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 435               | PLN 1 589          | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 34 703 112        | \$ 9 128           | 0                     | (830)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 422               | 146                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 5 178 244         | 55 241             | 764                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | PEN             | 47 508            | 14 020             | 117                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 13 028 736        | 3 552              | 0                     | (162)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 3 489 935         | 196                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 1 007 310         | 1 996              | 0                     | (57)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 24 887            | 7 252              | 2                     | (28)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 722             | COP 14 454 593     | 398                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 1 683             | EGP 86 669         | 24                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 871               | IDR 15 734 329     | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 17                | PEN 58             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 9 648 775         | \$ 2 708           | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 14 503            | 4 273              | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 12 903 500        | 985                | 0                     | (74)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 25 712 065        | 7 109              | 0                     | (111)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN             | 845 595           | 518                | 0                     | (63)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 9 558             | 2 794              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | IDR             | 15 839 683        | 871                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN             | 11 700            | 3 433              | 28                    | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 03/2027           |                 | 67 075            | 19 286             | 0                     | (193)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 101 447           | 4 872              | 93                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 748 704           | 7 928              | 26                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             | 5 689 631         | 12 005             | 201                   | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |                | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | NOK             | 2 868          | \$ 309            | \$ 19              | \$ 0                  | \$ 19                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON             | 2 786          | 616               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 291          | INR 510 346       | 92                 | 0                     | 92                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11 413         | KZT 6 156 947     | 1 415              | 0                     | 1 415                                   | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 3 328          | PEN 11 256        | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 615            | PLN 2 283         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | UZS             | 111 366 258    | \$ 8 938          | 0                  | (322)                 | (322)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 68 395         | 4 225             | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT             | 3 331 226      | 6 895             | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 247            | INR 23 265        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 548          | NGN 2 275 866     | 74                 | 0                     | 74                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP             | 207 849        | \$ 3 729          | 0                  | (357)                 | (357)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 2 181 152      | 120               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 28 160         | 8 290             | 61                 | (4)                   | 57                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 7 928          | INR 753 778       | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 957            | KZT 485 582       | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2 134          | PEN 7 261         | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | UZS             | 18 007 133     | \$ 1 413          | 0                  | (71)                  | (71)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 38 366         | 11 090            | 0                  | (110)                 | (110)                                   | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 174 931 921    | 13 676            | 0                  | (680)                 | (680)                                   | (0,01)              |
|              | 11/2026           | KZT             | 1 322 451      | 2 670             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | UZS             | 160 691 700    | 12 306            | 0                  | (811)                 | (811)                                   | (0,01)              |
|              | 12/2026           | \$              | 536            | KZT 281 673       | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | UZS             | 92 295 141     | \$ 7 099          | 0                  | (417)                 | (417)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD             | 29             | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 12 430         | 1 837             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 6 395          | 8 600             | 112                | 0                     | 112                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 73             | 42                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 11 456         | 3 388             | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 2 976          | 307               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 115            | 90                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 649          | CNH 45 225        | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11 603         | € 10 174          | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 25             | HUF 7 751         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 823          | ¥ 295 018         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 616          | PLN 5 954         | 0                  | (32)                  | (32)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 87 276         | \$ 5 289          | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 45 126         | 6 649             | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 13 696 666     | 3 628             | 0                  | (314)                 | (314)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 10 174         | 11 619            | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 180            | 63                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 294 246        | 1 823             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 20             | AUD 29            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 42             | NZD 73            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 307            | SEK 2 971         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 19 897         | \$ 5 858          | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 162            | INR 15 530        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| 07/2026      | BRL               | 119 206         | \$ 22 928      | 0                 | (102)              | (102)                 | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | COP               | 264 861         | 70             | 0                 | (7)                | (7)                   | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | DOP               | 132 166         | 2 180          | 1                 | (34)               | (33)                  | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | €                 | 27 668          | BRL 163 133    | 0                 | (116)              | (116)                 | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | RON               | 952             | \$ 210         | 3                 | 0                  | 3                     | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | \$                | 17 498          | BRL 94 728     | 803               | 0                  | 803                   | 0,01                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 1 944           | CAD 2 767      | 6                 | 0                  | 6                     | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 25 648          | COP 89 202 546 | 161               | (55)               | 106                   | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 3               | PLN 11         | 0                 | 0                  | 0                     | 0,00                                    |                     |
| 08/2026      | BRL               | 163 133         | € 27 419       | 118               | 0                  | 118                   | 0,00                                    |                     |
| 08/2026      | CAD               | 2 763           | \$ 1 944       | 0                 | (6)                | (6)                   | 0,00                                    |                     |
| 08/2026      | DOP               | 101 121         | 1 687          | 12                | (5)                | 7                     | 0,00                                    |                     |
| 08/2026      | \$                | 21              | INR 2 022      | 0                 | 0                  | 0                     | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      | COP               | 12 826 921      | \$ 3 675       | 19                | 0                  | 19                    | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      | DOP               | 640 592         | 10 538         | 55                | (124)              | (69)                  | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      | IDR               | 10 058 788      | 560            | 4                 | (1)                | 3                     | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      | \$                | 6 778           | BRL 35 722     | 21                | 0                  | 21                    | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      |                   | 192             | INR 18 466     | 2                 | 0                  | 2                     | 0,00                                    |                     |
| 09/2026      |                   | 334             | THB 10 768     | 0                 | (8)                | (8)                   | 0,00                                    |                     |
| 10/2026      | DOP               | 29 066          | \$ 488         | 9                 | 0                  | 9                     | 0,00                                    |                     |
| 10/2026      | \$                | 16 147          | BRL 85 835     | 79                | 0                  | 79                    | 0,00                                    |                     |
| 11/2026      | COP               | 78 648 838      | \$ 21 924      | 24                | (167)              | (143)                 | 0,00                                    |                     |
| 11/2026      | DOP               | 383 935         | 6 314          | 0                 | (7)                | (7)                   | 0,00                                    |                     |
| 12/2026      |                   | 61 947          | 1 037          | 22                | 0                  | 22                    | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | \$                | 155             | HUF 47 284     | 0                 | (3)                | (3)                   | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | AUD               | 945             | \$ 663         | 8                 | 0                  | 8                     | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | EGP               | 179 082         | 2 902          | 0                 | (709)              | (709)                 | (0,01)                                  |                     |
| 07/2026      | £                 | 52              | 70             | 1                 | 0                  | 1                     | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | HUF               | 676 160         | 2 211          | 40                | 0                  | 40                    | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | ILS               | 731             | 245            | 0                 | (1)                | (1)                   | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | KZT               | 128 333         | 268            | 2                 | 0                  | 2                     | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      | \$                | 5 827           | BRL 30 132     | 0                 | (5)                | (5)                   | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 912             | EGP 48 336     | 69                | 0                  | 69                    | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 821             | NOK 8 126      | 0                 | 0                  | 0                     | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 396             | PLN 1 444      | 0                 | (12)               | (12)                  | 0,00                                    |                     |

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

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|--------|
| MBC          | 08/2026              | ILS                | 695                  | \$ 239                | \$ 5                     | \$ 0                                          | \$ 5                   | 0,00   |
|              | 08/2026              | NOK                | 8 130                | 821                   | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 556                  | AUD 795               | 0                        | (5)                                           | (5)                    | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 483                  | HKD 3 775             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | MXN                | 270 319              | \$ 15 559             | 187                      | 0                                             | 187                    | 0,00   |
|              | 09/2026              | PKR                | 781 362              | 2 622                 | 0                        | (151)                                         | (151)                  | 0,00   |
|              | 09/2026              | TWD                | 23 061               | 729                   | 7                        | 0                                             | 7                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 41                   | INR 3 902             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              |                    | 176                  | THB 5 683             | 0                        | (4)                                           | (4)                    | 0,00   |
|              | 10/2026              | UZS                | 94 055 954           | \$ 7 412              | 0                        | (310)                                         | (310)                  | 0,00   |
|              | 12/2026              | \$                 | 60                   | MXN 1 061             | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 06/2027              | UZS                | 2 515 318            | \$ 186                | 0                        | (13)                                          | (13)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              | AUD                | 14                   | 10                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | CHF                | 820                  | 1 047                 | 31                       | 0                                             | 31                     | 0,00   |
|              | 07/2026              | COP                | 15 178 217           | 4 007                 | 0                        | (376)                                         | (376)                  | (0,01) |
|              | 07/2026              | €                  | 11 264               | 13 087                | 209                      | 0                                             | 209                    | 0,00   |
|              | 07/2026              | INR                | 751 662              | 7 960                 | 26                       | 0                                             | 26                     | 0,00   |
|              | 07/2026              | ¥                  | 59 733               | 376                   | 8                        | 0                                             | 8                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | NOK                | 6 816                | 735                   | 46                       | 0                                             | 46                     | 0,00   |
|              | 07/2026              | NZD                | 721                  | 413                   | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | SEK                | 1 817                | 187                   | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 453                  | EGP 22 897            | 10                       | 0                                             | 10                     | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 12 682               | € 10 956              | 0                        | (156)                                         | (156)                  | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 2 357                | £ 1 756               | 0                        | (27)                                          | (27)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 12 272               | INR 1 182 921         | 205                      | 0                                             | 205                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 48 558               | KRW 73 607 954        | 0                        | (1 014)                                       | (1 014)                | (0,01) |
|              | 07/2026              |                    | 264                  | NOK 2 621             | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | €                  | 614                  | \$ 701                | 0                        | (2)                                           | (2)                    | 0,00   |
|              | 08/2026              | NOK                | 2 622                | 264                   | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 10                   | AUD 14                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 413                  | NZD 721               | 0                        | (3)                                           | (3)                    | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 187                  | SEK 1 814             | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00   |
| MYI          | 09/2026              | EGP                | 150 351              | \$ 2 700              | 0                        | (256)                                         | (256)                  | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 8 062                | INR 766 604           | 1                        | (27)                                          | (26)                   | 0,00   |
|              | 10/2026              | EGP                | 218 199              | \$ 4 203              | 0                        | (54)                                          | (54)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 122                  | 140                   | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | £                  | 53                   | 70                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 768                  | AUD 1 100             | 0                        | (6)                                           | (6)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 57                   | € 50                  | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 1 077                | £ 813                 | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 73                   | KZT 39 396            | 10                       | 0                                             | 10                     | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 462                  | NZD 800               | 0                        | (7)                                           | (7)                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 27                   | SGD 35                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 10/2026              |                    | 5 881                | AZN 10 522            | 260                      | 0                                             | 260                    | 0,00   |
| NSL          | 10/2026              |                    | 11 159               | PEN 38 366            | 41                       | 0                                             | 41                     | 0,00   |
|              | 12/2026              | PEN                | 38 366               | \$ 11 128             | 0                        | (51)                                          | (51)                   | 0,00   |
|              | 10/2027              | \$                 | 11 763               | AZN 21 644            | 569                      | 0                                             | 569                    | 0,01   |
|              | 07/2026              |                    | 12 410               | INR 1 193 911         | 191                      | 0                                             | 191                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 59                   | TRY 2 790             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | IDR                | 2 130 678            | \$ 120                | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
| SCX          | 07/2026              | COP                | 12 826 921           | 3 330                 | 0                        | (372)                                         | (372)                  | (0,01) |
|              | 07/2026              | €                  | 6 273                | 7 292                 | 120                      | 0                                             | 120                    | 0,00   |
|              | 07/2026              | KZT                | 1 057 064            | 2 186                 | 0                        | (24)                                          | (24)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              | PEN                | 13 084               | 3 818                 | 0                        | (17)                                          | (17)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 16 333               | INR 1 565 524         | 191                      | 0                                             | 191                    | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 3 862                | KZT 2 084 173         | 485                      | 0                                             | 485                    | 0,01   |
| SOG          | 07/2026              |                    | 3 479                | PEN 11 910            | 13                       | 0                                             | 13                     | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 455                  | HKD 3 563             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 52                   | INR 5 023             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | EGP                | 95 761               | \$ 1 864              | 0                        | (22)                                          | (22)                   | 0,00   |
|              | 09/2026              | IDR                | 5 480 130            | 305                   | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00   |
|              | 09/2026              | KZT                | 157 927              | 314                   | 0                        | (8)                                           | (8)                    | 0,00   |
|              | 09/2026              | PEN                | 11 948               | 3 479                 | 0                        | (15)                                          | (15)                   | 0,00   |
|              | 09/2026              | \$                 | 2 186                | KZT 1 083 138         | 22                       | 0                                             | 22                     | 0,00   |
|              | 09/2026              |                    | 121                  | THB 3 903             | 0                        | (3)                                           | (3)                    | 0,00   |
|              | 11/2026              | UGX                | 4 973 094            | \$ 1 283              | 0                        | (34)                                          | (34)                   | 0,00   |
|              | 12/2026              | COP                | 123 060 888          | 30 908                | 0                        | (3 417)                                       | (3 417)                | (0,05) |
|              | 07/2026              | CNH                | 20 298               | 3 001                 | 10                       | 0                                             | 10                     | 0,00   |
| SSB          | 07/2026              | €                  | 6 694                | RON 35 318            | 49                       | 0                                             | 49                     | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 598 766              | \$ 698 485            | 13 916                   | 0                                             | 13 916                 | 0,21   |
|              | 07/2026              | ¥                  | 155 543              | 979                   | 22                       | 0                                             | 22                     | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 705                  | EGP 37 364            | 54                       | 0                                             | 54                     | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 688 783              | € 605 524             | 3 513                    | 0                                             | 3 513                  | 0,05   |
|              | 07/2026              |                    | 146                  | SGD 189               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | €                  | 605 524              | \$ 689 717            | 0                        | (3 506)                                       | (3 506)                | (0,05) |
|              | 08/2026              | SGD                | 189                  | 146                   | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              | CAD                | 2 844                | 2 062                 | 58                       | 0                                             | 58                     | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 1 579                | 1 795                 | 1                        | (11)                                          | (10)                   | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 18                   | CAD 25                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 8 316                | £ 6 291               | 34                       | 0                                             | 34                     | 0,00   |
|              | 08/2026              | CAD                | 25                   | \$ 18                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00   |
|              | 08/2026              | £                  | 6 291                | 8 316                 | 0                        | (34)                                          | (34)                   | 0,00   |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| UAG          | 08/2026           | \$ 8 025        | € 7 029           | \$ 22              | \$ 0                  | \$ 22                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 626             | PLN 2 288         | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 24              | SGD 32            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 21 702 545  | \$ 5 747          | 0                  | (500)                 | (500)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 47 369 414      | 12 946            | 0                  | (555)                 | (555)                                   | (0,01)              |
|              | 10/2026           | HUF 2 052 013   | 5 521             | 0                  | (225)                 | (225)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | 2 528 129       | € 7 014           | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
| WST          | 12/2026           | COP 244 732 630 | \$ 61 731         | 0                  | (6 531)               | (6 531)                                 | (0,10)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 015        | CHF 820           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 817         | \$ 1 015          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 30 426          | \$ (32 177)           | \$ (1 751)                              | (0,02)              |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie M Détail en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 923         | \$ 637            | \$ 0               | \$ (3)                | \$ (3)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 179        | AUD 1 655         | 0                  | (32)                  | (32)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 633             | 918               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD 4           | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | AUD 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 2               | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 950         | \$ 660            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$ 950          | AUD 1 333         | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 659             | 950               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 37          | \$ 26             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 24           | AUD 34            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 128             | 179               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| DUB FAR      | 07/2026           | AUD 926         | \$ 643            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 224        | AUD 1 716         | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 642             | 926               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 1 575       | \$ 1 102          | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 094        | AUD 1 565         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 962         | \$ 663            | 1                  | (4)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 31           | AUD 44            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 3           | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | \$ 619          | AUD 900           | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 293             | 411               | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 2           | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 23              | \$ (128)              | \$ (105)                                | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | \$ 58           | CHF 46            | \$ 0               | \$ (2)                | \$ (2)                                  | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 4 195           | 3 279             | 0                  | (130)                 | (130)                                   | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 5 633           | 4 415             | 0                  | (159)                 | (159)                                   | (0,01)              |
| SOG          | 07/2026           | CHF 3 996       | \$ 4 940          | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 940        | CHF 3 982         | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 4 990           | 3 923             | 0                  | (127)                 | (127)                                   | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | 45              | 36                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 3 984       | \$ 4 935          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 935        | CHF 3 970         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 20              | \$ (438)              | \$ (418)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 1 010        | € 868             | \$ 0               | \$ (18)               | \$ (18)                                 | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 6 061         | \$ 6 881          | 0                  | (49)                  | (49)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 016 170    | € 872 311         | 9                  | (18 865)              | (18 856)                                | (0,28)              |
|              | 07/2026           | € 2 707         | \$ 3 148          | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$ 958 677      | € 822 239         | 0                  | (18 611)              | (18 611)                                | (0,27)              |
|              | 07/2026           | 2 384           | 2 045             | 0                  | (47)                  | (47)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 833 671       | \$ 950 800        | 0                  | (2 336)               | (2 336)                                 | (0,03)              |
| FAR          | 08/2026           | \$ 952 082      | € 833 671         | 2 331              | 0                     | 2 331                                   | 0,03                |
| MBC          | 07/2026           | € 921 901       | \$ 1 048 032      | 672                | (6 650)               | (5 978)                                 | (0,09)              |
|              | 07/2026           | \$ 99 237       | € 85 486          | 0                  | (1 501)               | (1 501)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 1 009 705       | 887 779           | 6 651              | 0                     | 6 651                                   | 0,10                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | € 886 700       | \$ 1 008 621      | \$ 0               | \$ (5 143)            | \$ (5 143)                              | (0,08)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 013 466    | € 868 780         | 0                  | (20 190)              | (20 190)                                | (0,30)              |
|              | 08/2026           | 1 009 990       | 886 700           | 5 133              | 0                     | 5 133                                   | 0,08                |
| SSB          | 07/2026           | € 688           | \$ 784            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 785          | € 688             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 14 851          | \$ (73 412)           | \$ (58 561)                             | (0,86)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 43 856       | £ 32 667          | \$ 0               | \$ (499)              | \$ (499)                                | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | £ 375           | \$ 503            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 29 990          | 39 552            | 0                  | (253)                 | (253)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 49 712       | £ 37 112          | 9                  | (464)                 | (455)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 39 551          | 29 990            | 253                | 0                     | 253                                     | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | 252             | 188               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 811           | 2 090             | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | £ 8             | \$ 10             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 46 847       | £ 34 912          | 0                  | (510)                 | (510)                                   | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 29            | \$ 38             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$ 411          | £ 306             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 20            | \$ 27             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 6 290           | 8 278             | 0                  | (71)                  | (71)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 8 278        | £ 6 290           | 71                 | 0                     | 71                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 34 934        | \$ 46 239         | 0                  | (127)                 | (127)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 143          | £ 107             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | 46 237          | 34 934            | 128                | 0                     | 128                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 34 711        | \$ 45 853         | 0                  | (217)                 | (217)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 11           | £ 8               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 8             | \$ 11             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 45 852       | £ 34 711          | 217                | 0                     | 217                                     | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 1 052         | \$ 1 391          | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 391        | £ 1 052           | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 688             | \$ (2 192)            | \$ (1 504)                              | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 17 304       | NOK 160 204       | \$ 0               | \$ (1 115)            | \$ (1 115)                              | (0,02)              |
| BPS          | 07/2026           | NOK 392         | \$ 41             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 2 576           | 271               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 716             | 74                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 200       | NOK 94 458        | 0                  | (655)                 | (655)                                   | (0,01)              |
| DUB          | 07/2026           | 12 291          | 114 200           | 0                  | (750)                 | (750)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | 25              | 242               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | NOK 121 410     | \$ 12 266         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$ 12 266       | NOK 121 463       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 157 407     | \$ 15 846         | 6                  | (67)                  | (61)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 962       | NOK 101 696       | 0                  | (685)                 | (685)                                   | (0,01)              |
| MYI          | 08/2026           | 15 694          | 156 029           | 67                 | 0                     | 67                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 580         | \$ 61             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | \$ 303          | NOK 2 827         | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 402             | 3 722             | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 93              | \$ (3 319)            | \$ (3 226)                              | (0,05)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 4 395        | SEK 40 646        | \$ 0               | \$ (195)              | \$ (195)                                | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SEK 168         | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3            | SEK 30            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 5 171           | 47 832            | 0                  | (229)                 | (229)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | SEK 26 973      | \$ 2 780          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2 780        | SEK 26 925        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 40 754      | \$ 4 186          | 0                  | (25)                  | (25)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 800        | SEK 44 593        | 0                  | (193)                 | (193)                                   | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | 4 180           | 40 624            | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 354         | \$ 37             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 24           | SEK 226           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 33              | \$ (650)              | \$ (617)                                | (0,01)              |





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

Des titres d'une juste valeur globale de 1 498 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 4 198 \$ (31 décembre 2025 : 11 869 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2025 : 3 539 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 114 480 \$ (31 décembre 2025 : 101 544 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 66                                                                             | \$ 6 822 053                                         | \$ 371 258                                        | \$ 7 193 377        |
| Fonds d'investissement                        | 9 937                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 9 937               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (1 916)                                                                           | (53 743)                                             | 751                                               | (54 908)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 423                                                  | 0                                                 | 423                 |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 8 087</b>                                                                   | <b>\$ 6 768 733</b>                                  | <b>\$ 372 009</b>                                 | <b>\$ 7 148 829</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Prix cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1                                                                             | \$ 6 060 289                                         | \$ 328 772                                        | \$ 6 389 062        |
| Fonds d'investissement                        | 419 546                                                                          | 0                                                    | 0                                                 | 419 546             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 568                                                                            | 12 138                                               | 1 139                                             | 14 845              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                | 27                                                   | 396                                               | 423                 |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 421 115</b>                                                                | <b>\$ 6 072 454</b>                                  | <b>\$ 330 307</b>                                 | <b>\$ 6 823 876</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|--------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 1,950 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (4 873)        | \$ (5 575)                               | (0,08)              |
|              | 3,820          | 18/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (34 076)      | (34 235)                                 | (0,51)              |
|              | 3,860          | 10/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (23 043)         | (23 391)                                 | (0,35)              |
|              | 3,860          | 10/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (11 797)         | (11 975)                                 | (0,18)              |
|              | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (3 836)        | (4 389)                                  | (0,06)              |
|              | 2,200          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (5 306)          | (6 071)                                  | (0,09)              |
|              | 2,250          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (14 291)         | (16 353)                                 | (0,24)              |
|              | 2,300          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (24 066)         | (27 539)                                 | (0,41)              |
|              | 3,000          | 28/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1 116)       | (1 119)                                  | (0,02)              |
|              | 3,400          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 457)          | (4 541)                                  | (0,07)              |
| BRC          | 3,450          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (13 608)         | (13 870)                                 | (0,20)              |
|              | 3,500          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 399)          | (1 426)                                  | (0,02)              |
|              | 3,500          | 20/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 145)          | (2 172)                                  | (0,03)              |
|              | 3,500          | 06/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 276)          | (3 303)                                  | (0,05)              |
|              | 3,800          | 05/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 848)          | (4 922)                                  | (0,07)              |
|              | 3,800          | 11/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 475)          | (1 497)                                  | (0,02)              |
|              | 3,800          | 10/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 843)          | (3 889)                                  | (0,06)              |
|              | 3,850          | 10/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 696)          | (3 752)                                  | (0,06)              |
|              | 3,850          | 28/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (7 468)          | (7 495)                                  | (0,11)              |
|              | 3,850          | 12/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 796)          | (4 868)                                  | (0,07)              |
| JML          | 2,370          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (255)          | (291)                                    | 0,00                |
| MBC          | 3,800          | 28/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (7 464)       | (7 491)                                  | (0,11)              |
|              | 3,850          | 28/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (20 057)         | (20 130)                                 | (0,30)              |
|              | 3,870          | 09/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (7 527)          | (7 544)                                  | (0,11)              |
|              | 2,180          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (12 240)       | (14 006)                                 | (0,21)              |
| MEI          | 2,210          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 476)          | (5 121)                                  | (0,08)              |
|              | 2,230          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 294)          | (4 913)                                  | (0,07)              |
|              | 2,370          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (826)            | (945)                                    | (0,01)              |
|              | 2,410          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 653)          | (5 325)                                  | (0,08)              |
|              | 3,500          | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (4 261)       | (4 264)                                  | (0,06)              |
|              | 7,050          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | ZAR (348 887)    | (21 344)                                 | (0,32)              |
| MYI          | 7,150          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (906 674)      | (55 470)                                 | (0,82)              |
|              | 2,250          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (196)            | (224)                                    | 0,00                |
|              | 2,300          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (8 542)          | (9 775)                                  | (0,14)              |
|              | 2,320          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (6 411)          | (7 336)                                  | (0,11)              |
|              | 2,330          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (486)            | (556)                                    | (0,01)              |
|              | 2,350          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 888)          | (5 593)                                  | (0,08)              |

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| NOM                                    | 2,750          | 11/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1 637)       | \$ (1 644)                               | (0,02)              |
|                                        | 3,250          | 10/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 521)          | (4 555)                                  | (0,07)              |
|                                        | 3,450          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 542)          | (1 571)                                  | (0,02)              |
|                                        | 3,490          | 10/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 892)          | (3 923)                                  | (0,06)              |
|                                        | 3,490          | 29/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 820)          | (2 837)                                  | (0,04)              |
|                                        | 3,500          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 166)          | (4 247)                                  | (0,06)              |
|                                        | 3,600          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (9 792)          | (9 989)                                  | (0,15)              |
|                                        | 3,400          | 15/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (9 133)          | (9 174)                                  | (0,14)              |
|                                        | 3,550          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 040)          | (4 120)                                  | (0,06)              |
|                                        | 3,550          | 26/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (9 491)          | (9 495)                                  | (0,14)              |
| SCX                                    | 3,570          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 378)          | (1 405)                                  | (0,02)              |
|                                        | 3,850          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (42 247)         | (43 155)                                 | (0,64)              |
|                                        | 2,350          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (11 608)       | (13 283)                                 | (0,20)              |
|                                        | 2,950          | 27/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1 615)       | (1 624)                                  | (0,02)              |
|                                        | 3,000          | 09/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 342)          | (1 344)                                  | (0,02)              |
|                                        | 3,250          | 21/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (23 360)         | (23 510)                                 | (0,35)              |
|                                        | 3,350          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (824)            | (828)                                    | (0,01)              |
|                                        | 3,400          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 297)          | (1 321)                                  | (0,02)              |
|                                        | 3,500          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 339)          | (4 362)                                  | (0,06)              |
|                                        | 3,650          | 06/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 376)          | (1 397)                                  | (0,02)              |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                    |                  | \$ (511 839)                             | (7,55)              |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (665)                                                   | \$ 945                  | \$ 280                            | \$ 1 173                                                   | \$ (1 290)              | \$ (117)                          |
| BOA          | (4 405)                                                    | 4 418                   | 13                                | (1 904)                                                    | 1 879                   | (25)                              |
| BPS          | (17 117)                                                   | 18 850                  | 1 733                             | 2 085                                                      | (1 930)                 | 155                               |
| BRC          | (834)                                                      | 840                     | 6                                 | 9 343                                                      | (10 760)                | (1 417)                           |
| BSH          | (18 556)                                                   | 0                       | (18 556)                          | 69                                                         | 0                       | 69                                |
| BSS          | 347                                                        | 19 180                  | 19 527                            | (57)                                                       | 0                       | (57)                              |
| CBK          | (5 133)                                                    | 4 688                   | (445)                             | 757                                                        | (810)                   | (53)                              |
| DUB          | (3 265)                                                    | 2 800                   | (465)                             | (1 315)                                                    | 1 180                   | (135)                             |
| FAR          | (492)                                                      | 540                     | 48                                | (996)                                                      | 920                     | (76)                              |
| GLM          | 641                                                        | (700)                   | (59)                              | (598)                                                      | 590                     | (8)                               |
| GST          | 2 585                                                      | (2 570)                 | 15                                | 1 964                                                      | (1 970)                 | (6)                               |
| IND          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               | 61                                                         | 0                       | 61                                |
| JPM          | (5 330)                                                    | 5 560                   | 230                               | (6 509)                                                    | 6 350                   | (159)                             |
| MBC          | (3 241)                                                    | 3 120                   | (121)                             | 9 473                                                      | (10 350)                | (877)                             |
| MYC          | (84)                                                       | 0                       | (84)                              | (864)                                                      | 630                     | (234)                             |
| MYI          | 1 036                                                      | (920)                   | 116                               | (148)                                                      | (270)                   | (418)                             |
| NSL          | 193                                                        | 0                       | 193                               | 136                                                        | 0                       | 136                               |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (93)                                                       | 0                       | (93)                              |
| SCX          | (3 105)                                                    | 3 234                   | 129                               | 376                                                        | (320)                   | 56                                |
| SOG          | (6 149)                                                    | 6 320                   | 171                               | 3 175                                                      | (3 330)                 | (155)                             |
| SSB          | (57)                                                       | 0                       | (57)                              | 105                                                        | 0                       | 105                               |
| UAG          | (8 210)                                                    | 8 001                   | (209)                             | 13                                                         | 320                     | 333                               |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 33                                                         | 0                       | 33                                |

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

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 73,73            | 73,47                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 16,05            | 12,25                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 2,95             | 2,35                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,13             | 5,78                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,20             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,61             | 0,45                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,75             | 0,72                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Autres actifs                                                    | 5,57             | 4,94                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

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

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Angola                            | 1,33             | 0,54                 |
| Argentine                         | 3,62             | 3,31                 |
| Australie                         | 0,32             | 0,00                 |
| Azerbaïdjan                       | 0,35             | 1,05                 |
| Bahreïn                           | 1,09             | 0,70                 |
| Bénin                             | 0,20             | 0,04                 |
| Bermudes                          | 0,14             | 0,22                 |
| Bolivie                           | 0,21             | S/O                  |
| Bosnie-Herzégovine                | 0,32             | S/O                  |
| Brésil                            | 1,13             | 1,26                 |
| Bulgarie                          | 0,72             | 0,91                 |
| Cameroun                          | 0,67             | 0,43                 |
| Canada                            | 0,12             | 0,19                 |
| Îles Caïmans                      | 4,09             | 3,66                 |
| Chili                             | 2,80             | 2,70                 |
| Chine                             | 0,00             | 0,25                 |
| Colombie                          | 4,93             | 5,25                 |
| Congo                             | 0,92             | 0,27                 |
| Congo, République démocratique du | 0,33             | S/O                  |
| Costa Rica                        | 1,00             | 0,56                 |
| République tchèque                | 0,20             | 0,24                 |
| République dominicaine            | 1,98             | 2,29                 |
| Équateur                          | 0,85             | 1,23                 |
| Égypte                            | 2,48             | 2,31                 |
| Salvador                          | 0,45             | 0,53                 |
| France                            | 0,18             | S/O                  |
| Gabon                             | 0,23             | 0,21                 |
| Géorgie                           | 0,00             | 0,00                 |
| Ghana                             | 0,68             | 0,66                 |
| Guatemala                         | 1,10             | 1,21                 |
| Hong Kong                         | 0,22             | 0,65                 |
| Hongrie                           | 1,84             | 2,14                 |
| Inde                              | 0,51             | 0,62                 |
| Indonésie                         | 4,01             | 2,65                 |
| Internationales                   | 0,13             | 0,09                 |
| Irak                              | 0,02             | 0,03                 |
| Irlande                           | 1,34             | 1,47                 |
| Île de Man                        | 0,36             | 0,00                 |
| Israël                            | 1,05             | 0,79                 |
| Italie                            | 0,05             | 0,05                 |
| Côte d'Ivoire                     | 1,30             | 1,61                 |
| Jamaïque                          | 0,04             | 0,04                 |
| Japon                             | S/O              | 0,35                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,13             | S/O                  |
| Jordanie                          | 0,11             | 0,04                 |
| Kazakhstan                        | 0,90             | 0,66                 |
| Kenya                             | 0,92             | 1,03                 |
| Koweït                            | 1,00             | 0,67                 |
| Kirghizistan                      | 0,16             | S/O                  |
| Lettonie                          | 0,16             | 0,17                 |
| Liban                             | 0,28             | 0,16                 |
| Lituanie                          | 0,15             | S/O                  |
| Luxembourg                        | 2,68             | 2,42                 |
| Macédoine du Nord                 | 0,12             | 0,13                 |
| Malaisie                          | 0,45             | 0,50                 |
| Mexique                           | 8,29             | 7,41                 |
| Mongolie                          | 0,52             | 0,32                 |
| Maroc                             | 0,65             | 0,46                 |
| Pays-Bas                          | 1,01             | 0,62                 |
| Nigeria                           | 1,73             | 1,52                 |
| Oman                              | 0,74             | 1,03                 |
| Pakistan                          | 0,59             | 0,24                 |
| Panama                            | 1,20             | 1,53                 |
| Paraguay                          | 0,56             | 0,60                 |
| Pérou                             | 3,20             | 1,96                 |
| Philippines                       | 1,08             | 0,81                 |
| Pologne                           | 1,06             | 1,04                 |
| Qatar                             | 1,15             | 1,39                 |
| Roumanie                          | 2,12             | 2,10                 |
| Rwanda                            | 0,05             | 0,05                 |
| Arabie saoudite                   | 1,66             | 1,89                 |
| Sénégal                           | 0,58             | 0,69                 |
| Serbie                            | 0,95             | 0,94                 |
| Singapour                         | 0,08             | 0,22                 |
| Slovénie                          | 0,00             | 0,18                 |
| Afrique du Sud                    | 2,66             | 2,65                 |
| Corée du Sud                      | 0,05             | 0,25                 |
| Espagne                           | 0,20             | 0,20                 |
| Sri Lanka                         | 0,79             | 0,36                 |
| Supranationales                   | 0,39             | 0,40                 |
| Suriname                          | 0,20             | 0,14                 |
| Tadjikistan                       | 0,00             | 0,00                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Tanzanie                                                                                                 | 0,08             | 0,22                 |
| Thaïlande                                                                                                | 0,40             | 0,44                 |
| Trinité-et-Tobago                                                                                        | 0,13             | 0,13                 |
| Tunisie                                                                                                  | 0,02             | 0,02                 |
| Turquie                                                                                                  | 2,74             | 3,03                 |
| Ouganda                                                                                                  | 0,00             | 0,01                 |
| Ukraine                                                                                                  | 1,32             | 1,00                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 4,06             | 2,44                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 2,20             | 2,15                 |
| États-Unis                                                                                               | 5,99             | 5,83                 |
| Uruguay                                                                                                  | 0,05             | 0,05                 |
| Ouzbékistan                                                                                              | 0,98             | 0,91                 |
| Venezuela                                                                                                | 2,48             | 1,29                 |
| Îles Vierges britanniques                                                                                | S/O              | 0,11                 |
| Zambie                                                                                                   | 0,00             | 0,10                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 3,75             | 2,16                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 0,15             | 6,25                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,18             | (0,06)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,01)           | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,07             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | S/O                  |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01)           | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,06)           | (0,11)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,02)           | (0,21)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,96)           | 0,56                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,01             | 0,01                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (5,43)           | (1,66)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ARGENTINE</b>                                                           |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                         |                                     |                                  |                           | St Marys Cement, Inc. Canada                                           |                                     |                                  |                           | Interoceánica Finance Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                                                    | \$ 14 249                           | \$ 11 629                        | 0,34                      | 5,750 % éch. 02/04/2034 (j)                                            | \$ 10 500                           | \$ 10 800                        | 0,31                      | 0,000 % éch. 15/05/2030 (d)                                                           | \$ 1 434                            | \$ 1 207                         | 0,03                      |
| 1,000 % éch. 09/07/2029 (j)                                                | 7 850                               | 7 163                            | 0,21                      | Suzano Austria GmbH                                                    |                                     |                                  |                           | 7,860 % éch. 15/05/2030                                                               | 1 694                               | 1 728                            | 0,05                      |
| 3,500 % éch. 09/07/2041                                                    | 99 929                              | 74 946                           | 2,16                      | 3,750 % éch. 15/01/2031                                                | 9 000                               | 8 458                            | 0,25                      | Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                                    | 10 879                              | 8 730                            | 0,25                      | Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % en espèces ou 12,000 % en PIK)        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               | 62                                  | 3                                | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 09/01/2038 (j)                                                | 11 313                              | 9 469                            | 0,27                      | 11,000 % éch. 31/12/2028 ^ (b)                                         | 2 830                               | 85                               | 0,00                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 30/11/2029                                                    | 3 800                               | 3 487                            | 0,10                      | Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % en espèces ou 15,000 % en PIK)        |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 499                                 | 11                               | 0,00                      |
| Provincia de Buenos Aires                                                  |                                     |                                  |                           | 13,500 % éch. 31/12/2027 ^ (b)                                         | 1 263                               | 76                               | 0,00                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 01/09/2037                                                    | 3 896                               | 3 230                            | 0,09                      |                                                                        |                                     | 50 042                           | 1,45                      | 6,500 % éch. 28/12/2029 (b)                                                           | 835                                 | 19                               | 0,00                      |
| Provincia de la Rioja                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 24/02/2028 ^                                                  | 425                                 | 264                              | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien                    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 28/12/2030 (b)                                                           | 1 006                               | 18                               | 0,00                      |
| Provincia de Neuquen                                                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 23/04/2030                                                | € 7 500                             | 8 606                            | 0,25                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 27/04/2030                                                    | 197                                 | 197                              | 0,01                      | 5,500 % éch. 04/02/2033                                                | \$ 33 900                           | 33 449                           | 0,96                      | 7,000 % éch. 28/12/2031 (b)                                                           | 1 516                               | 26                               | 0,00                      |
| Total Argentine                                                            |                                     | 119 115                          | 3,44                      | 6,250 % éch. 18/03/2031                                                | 23 400                              | 24 245                           | 0,70                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| <b>BAHREIN</b>                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     | 66 300                           | 1,91                      | 7,250 % éch. 28/12/2032 (b)                                                           | 1 427                               | 29                               | 0,00                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | Total Brésil                                                           |                                     | 116 342                          | 3,36                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni                         |                                     |                                  |                           | <b>BULGARIE</b>                                                        |                                     |                                  |                           | 7,721 % éch. 28/12/2028 (b)                                                           | 341                                 | 6                                | 0,00                      |
| 4,250 % éch. 25/01/2028                                                    | 13 900                              | 13 442                           | 0,39                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           | Kingston Airport Revenue Finance Ltd.                                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 25/01/2033                                                    | 3 000                               | 2 740                            | 0,08                      | Obligation internationale du gouvernement bulgare                      |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/12/2036                                                               | 2 697                               | 2 738                            | 0,08                      |
| 5,450 % éch. 16/09/2032 (j)                                                | 1 400                               | 1 304                            | 0,04                      | 4,125 % éch. 07/05/2038                                                | € 6 700                             | 7 684                            | 0,22                      | Lima Metro Line Finance Ltd.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 30/09/2031                                                    | 5 500                               | 5 219                            | 0,15                      | 4,125 % éch. 18/07/2045                                                | 6 100                               | 6 702                            | 0,19                      | 5,875 % éch. 05/07/2034                                                               | 364                                 | 372                              | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 19/09/2044                                                    | 1 300                               | 1 080                            | 0,03                      | Total Bulgarie                                                         |                                     | 14 386                           | 0,41                      | MAF Sukuk Ltd.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 06/10/2037                                                    | 6 200                               | 5 846                            | 0,17                      | <b>CAMEROUN</b>                                                        |                                     |                                  |                           | 4,638 % éch. 14/05/2029                                                               | 3 600                               | 3 528                            | 0,10                      |
| 7,100 % éch. 03/02/2038                                                    | 7 100                               | 6 909                            | 0,20                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           | QNB Finance Ltd.                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 10/06/2036                                                    | 12 400                              | 12 276                           | 0,35                      | Obligation internationale du gouvernement de la République du Cameroun |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 30/09/2030                                                               | € 12 300                            | 13 727                           | 0,40                      |
| 7,500 % éch. 07/07/2037                                                    | 8 400                               | 8 547                            | 0,24                      | 8,875 % éch. 30/01/2033                                                | \$ 8 800                            | 8 684                            | 0,25                      | 4,679 % éch. 27/04/2029                                                               | \$ 11 900                           | 11 960                           | 0,35                      |
| CBB International Sukuk Programme Co. WLL                                  |                                     |                                  |                           | <b>ÎLES CAIMANS</b>                                                    |                                     |                                  |                           | TIB Diversified Payment Rights Finance Co.                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,874 % éch. 06/02/2034                                                    | 2 100                               | 2 038                            | 0,06                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                                      |                                     |                                  |                           | 6,551 % éch. 15/11/2034                                                               | 5 400                               | 5 486                            | 0,16                      |
| 6,124 % éch. 03/09/2034                                                    | 7 300                               | 7 176                            | 0,21                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                             |                                     |                                  |                           | Xiaomi Best Time International Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           |
| Total Bahrein                                                              |                                     | 66 577                           | 1,92                      | 4,935 % éch. 15/04/2031                                                | 65                                  | 65                               | 0,00                      | 4,100 % éch. 14/07/2051                                                               | 9 500                               | 7 341                            | 0,21                      |
| <b>BÉNIN</b>                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           | Total Îles Caimans                                                                    |                                     | 132 200                          | 3,82                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>CHILI</b>                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement béninois                         |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 22/01/2035                                                    | € 17 900                            | 19 368                           | 0,56                      | CIFI Holdings Group Co. Ltd.                                           |                                     |                                  |                           | Banco de Credito e Inversiones S.A.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,960 % éch. 13/02/2038                                                    | € 1 400                             | 1 490                            | 0,04                      | 0,000 % éch. 30/06/2029 (d)                                            | 2 813                               | 95                               | 0,00                      | 7,500 % éch. 12/12/2034 (g)(h)                                                        | 12 900                              | 13 645                           | 0,39                      |
| Benin Sukuk S.A.                                                           |                                     |                                  |                           | Country Garden Holdings Co. Ltd.                                       |                                     |                                  |                           | Banco del Estado de Chile                                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 29/01/2033                                                    | 4 500                               | 4 372                            | 0,13                      | 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                            | 1 434                               | 100                              | 0,01                      | 7,950 % éch. 02/05/2029 (g)(h)                                                        | 5 000                               | 5 288                            | 0,15                      |
| Total Bénin                                                                |                                     | 25 230                           | 0,73                      | Kaisa Group Holdings Ltd.                                              |                                     |                                  |                           | Caja de Compensacion de Asignacion Familiar de Los Andes                              |                                     |                                  |                           |
| <b>BERMUDES</b>                                                            |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2026 (d)                                            | 297                                 | 1                                | 0,00                      | 7,000 % éch. 30/07/2029 (j)                                                           | 15 200                              | 15 954                           | 0,46                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2027 (d)                                            | 371                                 | 3                                | 0,00                      | Colbun S.A.                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Star Energy Geothermal Darajat                                             |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)                                            | 593                                 | 4                                | 0,00                      | 5,375 % éch. 11/09/2035                                                               | 19 400                              | 19 211                           | 0,55                      |
| 4,850 % éch. 14/10/2038                                                    | 3 800                               | 3 575                            | 0,10                      | 0,000 % éch. 31/12/2029 (d)                                            | 593                                 | 4                                | 0,00                      | Empresa de los Ferrocarriles del Estado                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>BOLIVIE</b>                                                             |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2030 (d)                                            | 741                                 | 5                                | 0,00                      | 3,068 % éch. 18/08/2050                                                               | 600                                 | 381                              | 0,01                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                            | 741                                 | 3                                | 0,00                      | 3,830 % éch. 14/09/2061                                                               | 1 300                               | 892                              | 0,03                      |
| Obligation internationale du gouvernement bolivien                         |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 31/12/2032 (d)                                            | 1 292                               | 4                                | 0,00                      | Inversiones CMPC S.A.                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 20/03/2028 (j)                                                | 997                                 | 960                              | 0,03                      |                                                                        |                                     | 219                              | 0,01                      | 6,125 % éch. 26/02/2034 (j)                                                           | 10 000                              | 9 916                            | 0,29                      |
| 9,450 % éch. 14/05/2031 (j)                                                | 7 800                               | 8 001                            | 0,23                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                   |                                     |                                  |                           | 6,700 % éch. 09/12/2057 (j)                                                           | 15 100                              | 14 876                           | 0,43                      |
| Total Bolivie                                                              |                                     | 8 961                            | 0,26                      | Adib Sukuk Co. Ltd.                                                    |                                     |                                  |                           | Sociedad Química y Minera de Chile S.A.                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>BOSNIE-HERZÉGOVINE</b>                                                  |                                     |                                  |                           | 5,695 % éch. 15/11/2028                                                | 10 000                              | 10 214                           | 0,30                      | 5,625 % éch. 22/04/2056                                                               | 3 900                               | 3 873                            | 0,11                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                               |                                     |                                  |                           | Al Rajhi Sukuk Ltd.                                                    |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 07/11/2033 (j)                                                           | 12 100                              | 12 917                           | 0,37                      |
| Obligation internationale du gouvernement de la République serbe de Bosnie |                                     |                                  |                           | 5,651 % éch. 16/03/2036 (h)                                            | 11 500                              | 11 468                           | 0,33                      | Sociedad Transmisora Metropolitana SpA                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 02/04/2031                                                    | € 3 700                             | 4 293                            | 0,12                      | Alibaba Group Holding Ltd.                                             |                                     |                                  |                           | 6,385 % éch. 15/12/2055                                                               | 2 900                               | 2 963                            | 0,09                      |
| 6,375 % éch. 08/05/2033                                                    | 5 100                               | 5 848                            | 0,17                      | 2,700 % éch. 09/02/2041                                                | 4 800                               | 3 537                            | 0,10                      |                                                                                       |                                     | 99 916                           | 2,88                      |
| Total Bosnie-Herzégovine                                                   |                                     | 10 141                           | 0,29                      | Baidu, Inc.                                                            |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>BRÉSIL</b>                                                              |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 23/08/2031                                                | 1 900                               | 1 709                            | 0,05                      | Obligation internationale du gouvernement chilien                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                  |                           | Banco Mercantil del Norte S.A.                                         |                                     |                                  |                           | 3,100 % éch. 22/01/2061                                                               | 7 900                               | 4 963                            | 0,14                      |
| Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais                                 |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 24/01/2032 (g)(h)                                         | 2 000                               | 1 906                            | 0,06                      | 3,250 % éch. 21/09/2071                                                               | 4 800                               | 3 036                            | 0,09                      |
| 5,333 % éch. 15/02/2028                                                    | \$ 3 542                            | 3 560                            | 0,10                      | 8,375 % éch. 14/10/2030 (g)(h)                                         | 400                                 | 415                              | 0,01                      | 3,500 % éch. 25/01/2050                                                               | 8 600                               | 6 263                            | 0,18                      |
| Caixa Economica Federal                                                    |                                     |                                  |                           | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/04/2053                                                               | 12 600                              | 8 969                            | 0,26                      |
| 5,625 % éch. 13/05/2030                                                    | 6 300                               | 6 332                            | 0,19                      | 0,000 % éch. 05/06/2034 (d)                                            | 3 325                               | 2 729                            | 0,08                      | 4,340 % éch. 07/03/2042                                                               | 7 700                               | 6 818                            | 0,20                      |
| Rede D'or Finance SARL                                                     |                                     |                                  |                           | Burjeel Sukuk Ltd.                                                     |                                     |                                  |                           | Total Chili                                                                           |                                     | 30 049                           | 0,87                      |
| 6,550 % éch. 28/04/2036                                                    | 4 900                               | 4 754                            | 0,14                      | 7,000 % éch. 01/07/2031 (a)                                            | 2 200                               | 2 209                            | 0,06                      |                                                                                       |                                     | 129 965                          | 3,75                      |
| Sabesp Lux SARL                                                            |                                     |                                  |                           | FWD Group Holdings Ltd.                                                |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 20/08/2030                                                    | 16 200                              | 15 977                           | 0,46                      | 5,836 % éch. 22/09/2035                                                | 1 500                               | 1 503                            | 0,04                      | <b>CHINE</b>                                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                  |                           | Gaci First Investment Co.                                              |                                     |                                  |                           | <b>ACTIIONS ORDINAIRES</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 14/10/2028                                                | € 15 000                            | 16 867                           | 0,49                      | Country Garden Holdings Co.                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 14/10/2032                                                | 6 500                               | 7 291                            | 0,21                      | Ltd. (c)                                                                              | 986 840                             | 21                               | 0,00                      |
|                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 14/05/2056                                                | \$ 12 200                           | 12 219                           | 0,35                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                  |                           | Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.                          |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 15/07/2031                                                | 13 000                              | 11 650                           | 0,34                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Kaisa Group Holdings Ltd. (c)                                       | 4 769 241                           | \$ 29                            | 0,00                      | 6,400 % éch. 05/06/2049                               | \$ 500                              | \$ 491                           | 0,01                      | 9,500 % éch. 18/02/2029                               | \$ 12 000                           | \$ 11 478                        | 0,33                      |
|                                                                     |                                     | \$50                             | 0,00                      | 6,500 % éch. 15/02/2048                               | 200                                 | 199                              | 0,01                      | Total Gabon                                           |                                     | 11 650                           | 0,34                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 6,600 % éch. 01/06/2036                               | 43 100                              | 45 062                           | 1,30                      | <b>GÉORGIE</b>                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 6,850 % éch. 27/01/2045                               | 2 800                               | 2 880                            | 0,08                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,150 % éch. 24/02/2055                               | 11 600                              | 12 348                           | 0,36                      | Georgian Railway JSC                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 10,500 % éch. 15/03/2037                              | 609 400                             | 10 926                           | 0,32                      | 4,000 % éch. 17/06/2028                               | 10 700                              | 10 274                           | 0,30                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | 10,750 % éch. 01/06/2036                              | 121 050                             | 2 202                            | 0,06                      | <b>GHANA</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| Yango Justice International Ltd.                                    |                                     |                                  |                           | 11,250 % éch. 15/09/2035                              | 14 900                              | 278                              | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 17/02/2025 ^                                           | \$ 3 300                            | 3                                | 0,00                      | 13,625 % éch. 10/02/2034                              | 113 700                             | 2 324                            | 0,07                      | Obligation internationale du gouvernement ghanéen     |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 04/09/2024 ^                                           | 2 000                               | 2                                | 0,00                      | Total République dominicaine                          |                                     | 104 374                          | 3,01                      | 8,950 % éch. 11/02/2031                               | GHS 24 344                          | 1 792                            | 0,05                      |
|                                                                     |                                     | 5                                | 0,00                      | <b>ÉQUATEUR</b>                                       |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 03/01/2030 (d)                           | \$ 3 830                            | 3 441                            | 0,10                      |
| Total Chine                                                         |                                     | 55                               | 0,00                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 03/01/2037                               | 10 100                              | 6 008                            | 0,17                      |
| <b>COLOMBIE</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Corp. Quiport S.A.                                    |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 03/07/2029                               | 17 894                              | 17 707                           | 0,51                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 15/12/2037                               | \$ 800                              | 880                              | 0,03                      | 5,000 % éch. 03/07/2035                               | 8 418                               | 7 816                            | 0,23                      |
| Banco Davivienda S.A.                                               |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 8,650 % éch. 13/02/2029                               | GHS 26 495                          | 2 121                            | 0,06                      |
| 6,650 % éch. 22/04/2031 (g)(h)                                      | 4 620                               | 4 272                            | 0,13                      | Obligation internationale du gouvernement équatorien  |                                     |                                  |                           | 8,800 % éch. 12/02/2030                               | 26 530                              | 2 027                            | 0,06                      |
| 8,125 % éch. 02/07/2035 (h)                                         | 5 100                               | 5 291                            | 0,15                      | 0,000 % éch. 31/07/2030 (d)(j)                        | 3 228                               | 2 792                            | 0,08                      | 9,100 % éch. 10/02/2032                               | 11 400                              | 813                              | 0,02                      |
|                                                                     |                                     | 9 563                            | 0,28                      | 5,000 % éch. 31/07/2040                               | 500                                 | 420                              | 0,01                      | Total Ghana                                           |                                     | 41 725                           | 1,20                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | 6,900 % éch. 31/07/2035                               | 42 318                              | 38 940                           | 1,12                      | <b>GUATEMALA</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                 |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 29/01/2034                               | 2 400                               | 2 432                            | 0,07                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 19/02/2036                                             | € 900                               | 1 023                            | 0,03                      | 9,250 % éch. 29/01/2039                               | 2 600                               | 2 670                            | 0,08                      | Industrial Subordinated Trust 2.0                     |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 26/11/2034                                             | 2 700                               | 3 144                            | 0,09                      | Ecuador Social Bond SARL                              |                                     |                                  |                           | 6,550 % éch. 15/04/2036                               | \$ 17 300                           | 17 579                           | 0,51                      |
| 6,125 % éch. 21/01/2031                                             | \$ 3 200                            | 3 235                            | 0,09                      | 0,000 % éch. 30/01/2035 (d)                           | 4 681                               | 3 490                            | 0,10                      | <b>GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 21/01/2033                                             | 6 200                               | 6 305                            | 0,18                      | Total Équateur                                        |                                     | 51 624                           | 1,49                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| TES colombien                                                       |                                     |                                  |                           | <b>ÉGYPTE</b>                                         |                                     |                                  |                           | Globalworth Real Estate Investments Ltd.              |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 18/04/2029 (f)                                         | COP 18 082 402                      | 4 727                            | 0,14                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/03/2030                               | € 1 570                             | 1 833                            | 0,05                      |
| 3,000 % éch. 25/03/2033 (f)                                         | 3 234 925                           | 769                              | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement égyptien    |                                     |                                  |                           | <b>HONG KONG</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 22/03/2031 (f)                                         | 94 287 286                          | 27 111                           | 0,78                      | 7,500 % éch. 31/01/2027                               | 1 000                               | 1 011                            | 0,03                      | <b>TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 26/03/2031                                             | 10 524 300                          | 2 517                            | 0,07                      | 7,500 % éch. 16/02/2061                               | 14 800                              | 12 817                           | 0,37                      | Bauhinia Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                            | 52 750 100                          | 14 850                           | 0,43                      | 7,625 % éch. 20/05/2034                               | 44 600                              | 45 090                           | 1,30                      | 4,919 % éch. 19/10/2045                               | \$ 5 989                            | 5 981                            | 0,17                      |
| 11,500 % éch. 25/07/2046                                            | 3 257 000                           | 916                              | 0,03                      | 7,903 % éch. 21/02/2048                               | 3 700                               | 3 401                            | 0,10                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                            | 64 075 200                          | 18 254                           | 0,53                      | 8,150 % éch. 20/11/2059                               | 3 500                               | 3 238                            | 0,09                      | Fortune Star BVI Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                            | 82 312 900                          | 24 907                           | 0,72                      | 8,500 % éch. 31/01/2047                               | 2 000                               | 1 963                            | 0,06                      | 5,050 % éch. 27/01/2027                               | 3 100                               | 3 069                            | 0,09                      |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                                            | 32 764 300                          | 10 028                           | 0,29                      | 8,750 % éch. 30/09/2051                               | 8 500                               | 8 430                            | 0,24                      | 8,500 % éch. 19/05/2028                               | 4 800                               | 4 931                            | 0,14                      |
|                                                                     |                                     | 117 786                          | 3,40                      | 19,698 % éch. 14/10/2030                              | EGP 388 400                         | 7 526                            | 0,22                      | Lenovo Group Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| Total Colombie                                                      |                                     | 127 349                          | 3,68                      | 21,954 % éch. 04/03/2028                              | 1 286 900                           | 25 393                           | 0,73                      | 6,536 % éch. 27/07/2032                               | 6 800                               | 7 319                            | 0,21                      |
| <b>COSTA RICA</b>                                                   |                                     |                                  |                           | Total Égypte                                          |                                     | 108 869                          | 3,14                      | MTR Corp. Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>SALVADOR</b>                                       |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 10/06/2046                               | € 15 000                            | 16 933                           | 0,49                      |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain               |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     | 32 252                           | 0,93                      |
| 5,500 % éch. 21/11/2030                                             | € 12 000                            | 14 435                           | 0,41                      | Comision Ejecutiva Hidroelectrica del Rio Lempa       |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 30/04/2043                                             | \$ 18 950                           | 18 377                           | 0,53                      | 8,650 % éch. 24/01/2033                               | \$ 8 200                            | 8 672                            | 0,25                      | Obligation internationale du gouvernement hongkongais |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 27/04/2033                                             | € 200                               | 244                              | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 02/02/2051                               | \$ 4 200                            | 2 687                            | 0,08                      |
| 6,001 % éch. 16/01/2036                                             | 15 250                              | 18 460                           | 0,53                      | Obligation internationale du gouvernement salvadorien |                                     |                                  |                           | Total Hong Kong                                       |                                     | 40 920                           | 1,18                      |
| 7,158 % éch. 12/03/2045                                             | \$ 2 400                            | 2 657                            | 0,08                      | 7,125 % éch. 20/01/2050                               | 4 659                               | 4 337                            | 0,13                      | <b>HONGRIE</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,300 % éch. 13/11/2054                                             | 4 200                               | 4 751                            | 0,14                      | 7,625 % éch. 21/09/2034                               | 1 800                               | 1 830                            | 0,05                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| Total Costa Rica                                                    |                                     | 58 924                           | 1,70                      | 7,625 % éch. 01/02/2041                               | 250                                 | 254                              | 0,01                      | MVM Energetika Zrt                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>CHYPRE</b>                                                       |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 10/04/2032                               | 440                                 | 471                              | 0,01                      | 7,500 % éch. 09/06/2028                               | 4 400                               | 4 590                            | 0,13                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 17/04/2030                               | 6 800                               | 7 345                            | 0,21                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| Atrium Finance PLC                                                  |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 15/07/2052 (j)                           | 6 750                               | 7 643                            | 0,22                      | Obligation internationale du gouvernement hongrois    |                                     |                                  |                           |
| 2,625 % éch. 05/09/2027                                             | € 8 000                             | 8 795                            | 0,25                      | 9,650 % éch. 21/11/2054                               | 4 700                               | 5 401                            | 0,16                      | 1,750 % éch. 05/06/2035 (j)                           | € 31 700                            | 30 603                           | 0,88                      |
| <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                                           |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     | 27 281                           | 0,79                      | 4,875 % éch. 25/03/2038 (j)                           | 36 000                              | 43 325                           | 1,25                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           | Total Salvador                                        |                                     | 35 953                           | 1,04                      | 4,875 % éch. 22/03/2040 (j)                           | 17 800                              | 21 343                           | 0,62                      |
| EPH Financing International A/S                                     |                                     |                                  |                           | <b>ESTONIE</b>                                        |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 25/09/2052 (j)                           | \$ 1 200                            | 1 308                            | 0,04                      |
| 5,875 % éch. 30/11/2029                                             | 7 100                               | 8 634                            | 0,25                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     | 96 579                           | 2,79                      |
| <b>RÉPUBLIQUE DOMINICAINE</b>                                       |                                     |                                  |                           | Eesti Energia A/S                                     |                                     |                                  |                           | Total Hongrie                                         |                                     | 101 169                          | 2,92                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 15/07/2029 (g)                           | € 10 000                            | 12 014                           | 0,35                      | <b>INDE</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           | <b>FRANCE</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 30/01/2060                                             | \$ 29 500                           | 26 122                           | 0,75                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                  |                                     |                                  |                           | IIFL Finance Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 19/07/2028                                             | 1 520                               | 1 542                            | 0,04                      | Orange S.A.                                           |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 24/07/2028                               | 1 700                               | 1 751                            | 0,05                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 13/01/2033                               | \$ 1 500                            | 1 472                            | 0,04                      | Indian Railway Finance Corp. Ltd.                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 13/01/2036                               | 5 000                               | 4 886                            | 0,14                      | 3,570 % éch. 21/01/2032                               | 19 400                              | 18 060                           | 0,52                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | Total France                                          |                                     | 6 358                            | 0,18                      | 3,835 % éch. 13/12/2027                               | 3 500                               | 3 445                            | 0,10                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | <b>GABON</b>                                          |                                     |                                  |                           | IRB Infrastructure Developers Ltd.                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |                                     |                                  |                           | 7,110 % éch. 11/03/2032                               | 2 200                               | 2 230                            | 0,06                      |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement gabonais    |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 06/02/2031                               | 200                                 | 172                              | 0,01                      |                                                       |                                     |                                  |                           |



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

| DESCRIPTION                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Muthoot Finance Ltd.<br>5,750 % éch. 04/08/2030                                 | \$ 3 200                            | \$ 3 136                         | 0,09                      |
| ReNew Pvt Ltd.<br>5,875 % éch. 05/03/2027                                       | 1 202                               | 1 201                            | 0,04                      |
| Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.<br>6,500 % éch. 02/02/2031                         | 8 900                               | 8 808                            | 0,25                      |
| ReNew Wind Energy AP2<br>4,500 % éch. 14/07/2028                                | 10 000                              | 9 682                            | 0,28                      |
| SAEL Ltd.<br>7,800 % éch. 31/07/2031                                            | 9 516                               | 9 657                            | 0,28                      |
| Sammaan Capital Ltd.<br>7,500 % éch. 16/10/2030                                 | 5 690                               | 5 761                            | 0,17                      |
| Total Inde                                                                      |                                     | 63 731                           | 1,84                      |
| <b>INDONÉSIE</b>                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT<br>7,150 % éch. 22/10/2031 (g)(h)          | 9 400                               | 9 393                            | 0,27                      |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>1,300 % éch. 23/03/2034 | € 18 200                            | 16 759                           | 0,48                      |
| 4,460 % éch. 04/03/2038                                                         | 8 200                               | 9 124                            | 0,26                      |
| 5,125 % éch. 29/05/2038                                                         | 3 600                               | 4 233                            | 0,12                      |
| 5,690 % éch. 29/05/2036                                                         | \$ 5 100                            | 5 211                            | 0,15                      |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia<br>3,550 % éch. 09/06/2051                   | 5 300                               | 3 688                            | 0,11                      |
| 4,700 % éch. 06/06/2032                                                         | 1 200                               | 1 189                            | 0,04                      |
| 4,700 % éch. 06/06/2032 (j)                                                     | 28 400                              | 28 148                           | 0,81                      |
| 5,650 % éch. 25/11/2054                                                         | 200                                 | 196                              | 0,01                      |
|                                                                                 |                                     | 68 548                           | 1,98                      |
| Total Indonésie                                                                 |                                     | 77 941                           | 2,25                      |
| <b>INTERNATIONALES</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| République du Sénégal<br>8,407 % éch. 22/12/2028                                | € 4 500                             | 2 653                            | 0,08                      |
| <b>IRLANDE</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| Capital Four CLO DAC<br>3,415 % éch. 25/10/2038                                 | 2 100                               | 2 404                            | 0,07                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| CIMA Finance DAC<br>2,950 % éch. 05/09/2029                                     | \$ 3 862                            | 3 673                            | 0,10                      |
| Iridium Capital PLC<br>9,250 % éch. 18/06/2029                                  | € 17 800                            | 22 116                           | 0,64                      |
|                                                                                 |                                     | 25 789                           | 0,74                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| République du Panama<br>3,886 % éch. 05/03/2027                                 | 13 200                              | 15 115                           | 0,44                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| GPS Blue Financing DAC<br>5,645 % éch. 09/11/2041                               | \$ 400                              | 393                              | 0,01                      |
| Total Irlande                                                                   |                                     | 43 701                           | 1,26                      |
| <b>CÔTE D'IVOIRE</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| République de Côte d'Ivoire<br>5,185 % éch. 05/03/2027                          | € 17 600                            | 20 203                           | 0,58                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement ivoirien<br>6,625 % éch. 22/03/2048   | 3 000                               | 3 319                            | 0,10                      |
| 7,625 % éch. 30/01/2033                                                         | \$ 50 900                           | 54 463                           | 1,57                      |
|                                                                                 |                                     | 57 782                           | 1,67                      |
| Total Côte d'Ivoire                                                             |                                     | 77 985                           | 2,25                      |
| <b>JAMAÏQUE</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement jamaïcain<br>7,875 % éch. 28/07/2045  | 2 600                               | 3 148                            | 0,09                      |

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>JORDANIE</b>                                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement jordanien<br>5,750 % éch. 31/01/2027 (j)             | \$ 300                              | \$ 302                           | 0,01                      |
| 7,500 % éch. 13/01/2029                                                                        | 6 900                               | 7 214                            | 0,21                      |
| Total Jordanie                                                                                 |                                     | 7 516                            | 0,22                      |
| <b>KAZAKHSTAN</b>                                                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Baiterek National Investment Holding JSC<br>16,950 % éch. 02/04/2029                           | 2 580 500                           | 5 483                            | 0,16                      |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                                                                       | 1 719 500                           | 3 703                            | 0,11                      |
| Development Bank of Kazakhstan JSC<br>18,400 % éch. 16/10/2028                                 | 2 798 000                           | 6 094                            | 0,17                      |
| Total Kazakhstan                                                                               |                                     | 15 280                           | 0,44                      |
| <b>KENYA</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| République du Kenya<br>9,086 % éch. 05/04/2028                                                 | \$ 2 533                            | 2 544                            | 0,08                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République du Kenya<br>7,875 % éch. 09/10/2033 | 5 500                               | 5 553                            | 0,16                      |
| 7,875 % éch. 26/02/2034                                                                        | 1 600                               | 1 594                            | 0,04                      |
| 8,800 % éch. 09/10/2038                                                                        | 4 700                               | 4 739                            | 0,14                      |
| 9,500 % éch. 05/03/2036                                                                        | 4 600                               | 4 897                            | 0,14                      |
| 9,750 % éch. 16/02/2031                                                                        | 14 900                              | 16 234                           | 0,47                      |
|                                                                                                |                                     | 33 017                           | 0,95                      |
| Total Kenya                                                                                    |                                     | 35 561                           | 1,03                      |
| <b>KOWEÏT</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,804 % éch. 20/04/2033 (i)             | 12 100                              | 12 080                           | 0,35                      |
| <b>KIRGHIZISTAN</b>                                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| Eldik Bank OAO<br>8,500 % éch. 23/04/2031                                                      | 5 300                               | 5 319                            | 0,15                      |
| <b>LETTONIE</b>                                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| Latvenergo A/S<br>3,612 % éch. 13/11/2030                                                      | € 14 700                            | 16 727                           | 0,48                      |
| 4,162 % éch. 25/06/2033                                                                        | 12 700                              | 14 587                           | 0,42                      |
| Total Lettonie                                                                                 |                                     | 31 314                           | 0,90                      |
| <b>LITUANIE</b>                                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement lituanien<br>4,125 % éch. 22/01/2041                 | 4 700                               | 5 387                            | 0,16                      |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| Amaggi Luxembourg International SARL<br>5,250 % éch. 28/01/2028                                | \$ 6 000                            | 5 883                            | 0,17                      |
| Chile Electricity Lux MPC SARL<br>5,580 % éch. 20/10/2035                                      | 489                                 | 497                              | 0,01                      |
| 5,672 % éch. 20/10/2035                                                                        | 1 359                               | 1 390                            | 0,04                      |
| Luminis S.A.<br>9,649 % éch. 15/09/2038                                                        | 12 200                              | 14 250                           | 0,41                      |
| Nova Securitisation SARL<br>5,750 % éch. 03/02/2031                                            | 4 000                               | 3 861                            | 0,11                      |
| Virtuo2 Finance SARL<br>7,930 % éch. 12/01/2034                                                | € 6 700                             | 9 246                            | 0,27                      |
| Total Luxembourg                                                                               |                                     | 35 127                           | 1,01                      |
| <b>MACÉDOINE DU NORD</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du Nord<br>6,960 % éch. 13/03/2027      | 1 600                               | 1 861                            | 0,05                      |

| DESCRIPTION                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>MALAISIE</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
| Export-Import Bank of Malaysia Bhd.<br>4,250 % éch. 06/06/2029                | \$ 11 000                           | \$ 10 793                        | 0,31                      |
| <b>ÎLE MAURICE</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.<br>4,250 % éch. 25/03/2027          | 4 116                               | 4 066                            | 0,12                      |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % éch. 27/09/2028               | 4 925                               | 4 967                            | 0,14                      |
| Total Île Maurice                                                             |                                     | 9 033                            | 0,26                      |
| <b>MEXIQUE</b>                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC<br>6,000 % éch. 14/05/2036            | 3 600                               | 3 576                            | 0,10                      |
| BBVA Bancomer S.A.<br>7,625 % éch. 11/02/2035 (h)                             | 4 100                               | 4 237                            | 0,12                      |
| Comision Federal de Electricidad<br>6,500 % éch. 28/01/2051                   | 2 900                               | 2 835                            | 0,08                      |
| Corp. GEO S.A.B. de C.V.<br>8,875 % éch. 25/09/2014 ^                         | 500                                 | 0                                | 0,00                      |
| Trust 2401<br>6,390 % éch. 15/01/2050                                         | 798                                 | 743                              | 0,02                      |
| 7,375 % éch. 13/02/2034                                                       | 5 839                               | 6 209                            | 0,18                      |
| 7,700 % éch. 23/01/2032                                                       | 5 876                               | 6 278                            | 0,18                      |
| Trust Fibra Uno<br>6,390 % éch. 15/01/2050 (j)                                | 202                                 | 186                              | 0,01                      |
| 7,375 % éch. 13/02/2034                                                       | 2 761                               | 2 934                            | 0,08                      |
| 7,700 % éch. 23/01/2032                                                       | 2 796                               | 2 979                            | 0,09                      |
|                                                                               |                                     | 29 977                           | 0,86                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>1,350 % éch. 18/09/2027 | € 600                               | 670                              | 0,02                      |
| 2,250 % éch. 12/08/2036                                                       | 12 600                              | 11 506                           | 0,33                      |
| 4,875 % éch. 19/05/2033                                                       | \$ 48 200                           | 45 790                           | 1,32                      |
| 4,875 % éch. 16/05/2036                                                       | € 16 600                            | 19 022                           | 0,55                      |
| 5,375 % éch. 16/05/2040                                                       | 600                                 | 691                              | 0,02                      |
| 5,750 % éch. 12/10/2110 (j)                                                   | \$ 18 140                           | 14 852                           | 0,43                      |
| 6,250 % éch. 27/08/2037                                                       | 9 400                               | 9 412                            | 0,27                      |
| 6,338 % éch. 04/05/2053                                                       | 16 085                              | 15 108                           | 0,44                      |
|                                                                               |                                     | 117 051                          | 3,38                      |
| Total Mexique                                                                 |                                     | 147 028                          | 4,24                      |
| <b>MONGOLIE</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| City of Ulaanbaatar Mongolia<br>7,750 % éch. 21/08/2027                       | 10 200                              | 10 410                           | 0,30                      |
| Obligation internationale du gouvernement mongol<br>5,950 % éch. 09/03/2032   | 2 700                               | 2 712                            | 0,08                      |
| 6,625 % éch. 25/02/2030                                                       | 200                                 | 206                              | 0,01                      |
| 7,875 % éch. 05/06/2029                                                       | 800                                 | 850                              | 0,02                      |
| Total Mongolie                                                                |                                     | 14 178                           | 0,41                      |
| <b>MAROC</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement marocain<br>4,000 % éch. 15/12/2050 | 17 400                              | 12 572                           | 0,36                      |
| 5,125 % éch. 26/05/2038                                                       | € 7 800                             | 9 111                            | 0,26                      |
| 5,500 % éch. 11/12/2042                                                       | \$ 3 500                            | 3 340                            | 0,10                      |
| Total Maroc                                                                   |                                     | 25 023                           | 0,72                      |
| <b>MULTINATIONALES</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| NXP BV<br>3,400 % éch. 01/05/2030                                             | 500                                 | 476                              | 0,01                      |
| <b>ACTIONS</b>                                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>PAYS-BAS</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| Stichting Administratiekantoor<br>T.K.H. Holding (c)                          | 10 402                              | 0                                | 0,00                      |

| DESCRIPTION                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                         |                                     |                                  |                           | 6,853 % éch. 28/03/2054 (j)                          | \$ 5 200                            | \$ 5 642                         | 0,16                      | 5,500 % éch. 04/04/2053                                | \$ 11 200                           | \$ 10 624                        | 0,31                      |
| Ardshinbank CJSC Via Dilijan Finance BV                                      |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 31/01/2036 (j)                          | 1 000                               | 1 093                            | 0,03                      | 5,500 % éch. 18/03/2054                                | 16 000                              | 15 162                           | 0,44                      |
| 6,600 % éch. 22/01/2031                                                      | \$ 6 000                            | \$ 5 994                         | 0,17                      | 7,875 % éch. 01/03/2057 (j)                          | 2 600                               | 3 149                            | 0,09                      | 6,125 % éch. 14/04/2056                                | 7 200                               | 7 336                            | 0,21                      |
| ING Groep NV                                                                 |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/03/2038                              | 3 604                               | 4 240                            | 0,12                      |                                                        |                                     | 51 846                           | 1,49                      |
| 1,125 % éch. 07/12/2028                                                      | £ 3 300                             | 4 168                            | 0,12                      | 8,125 % éch. 28/04/2034                              | 300                                 | 348                              | 0,01                      | Total Pologne                                          |                                     | 52 080                           | 1,50                      |
| InterCement Financial Operations BV (6,500 % en espèces ou 6,500 % en PIK)   | \$ 80                               | 76                               | 0,00                      | Total Panama                                         |                                     | 46 321                           | 1,34                      | <b>QATAR</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/06/2031 (b)                                                  |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 55 204                           | 1,59                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| NE Property BV                                                               |                                     |                                  |                           | <b>PARAGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement qatari       |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 20/01/2030                                                      | € 5 600                             | 6 059                            | 0,18                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                                | 4 700                               | 4 725                            | 0,14                      |
| 3,375 % éch. 14/07/2027                                                      | 629                                 | 718                              | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement paraguayen |                                     |                                  |                           | <b>ROUMANIE</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Prosus NV                                                                    |                                     |                                  |                           | 2,739 % éch. 29/01/2033                              | 1 900                               | 1 689                            | 0,05                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 2,031 % éch. 03/08/2032                                                      | 400                                 | 412                              | 0,01                      | 5,400 % éch. 30/03/2050                              | 10 300                              | 9 566                            | 0,28                      | Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                     |                                  |                           |
| 4,027 % éch. 03/08/2050                                                      | \$ 800                              | 561                              | 0,02                      | 5,600 % éch. 13/03/2048                              | 1 800                               | 1 720                            | 0,05                      | 5,625 % éch. 22/02/2036 (j)                            | € 85 100                            | 98 098                           | 2,83                      |
| Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % en espèces ou 15,000 % en PIK) |                                     |                                  |                           | 6,100 % éch. 11/08/2044                              | 1 800                               | 1 853                            | 0,05                      | 5,625 % éch. 30/05/2037                                | 4 500                               | 5 077                            | 0,15                      |
| 15,000 % éch. 31/12/2044 *(b)                                                | 2 542                               | 51                               | 0,00                      | 6,650 % éch. 04/03/2055                              | 6 700                               | 7 212                            | 0,21                      | Total Roumanie                                         |                                     | 103 175                          | 2,98                      |
| Veon Midco BV                                                                |                                     |                                  |                           | 7,900 % éch. 09/02/2031                              | 32 184 000                          | 5 093                            | 0,15                      | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,950 % éch. 01/06/2031                                                      | 4 500                               | 4 496                            | 0,13                      | 8,500 % éch. 04/03/2035                              | 16 153 000                          | 2 578                            | 0,07                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                                                      | 4 500                               | 4 492                            | 0,13                      | 8,500 % éch. 04/04/2038                              | 2 008 000                           | 318                              | 0,01                      | Saudi Awwal Bank                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                              |                                     | 27 027                           | 0,78                      | Total Paraguay                                       |                                     | 30 029                           | 0,87                      | 5,947 % éch. 04/09/2035 (h)                            | \$ 16 200                           | 16 148                           | 0,47                      |
| Total Pays-Bas                                                               |                                     | 27 027                           | 0,78                      | <b>PÉROU</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>SÉNÉGAL</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>NIGERIA</b>                                                               |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sénégalais   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement nigérien                           |                                     |                                  |                           | 9,700 % éch. 05/03/2045                              | PEN 35 600                          | 11 185                           | 0,32                      | 4,750 % éch. 13/03/2028                                | € 8 467                             | 5 434                            | 0,16                      |
| 6,125 % éch. 28/09/2028                                                      | 3 700                               | 3 709                            | 0,11                      | 10,100 % éch. 15/12/2043                             | 16 816                              | 5 425                            | 0,16                      | 5,375 % éch. 08/06/2037                                | 11 100                              | 6 772                            | 0,19                      |
| 8,631 % éch. 13/01/2036                                                      | 5 900                               | 6 411                            | 0,18                      | InRetail Shopping Malls                              |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 23/05/2033 (j)                            | \$ 10 900                           | 5 828                            | 0,17                      |
| 9,130 % éch. 13/01/2046                                                      | 5 650                               | 6 268                            | 0,18                      | 5,650 % éch. 16/10/2032                              | \$ 6 700                            | 6 630                            | 0,19                      | 7,750 % éch. 10/06/2031 (j)                            | 6 600                               | 3 562                            | 0,10                      |
| Total Nigeria                                                                |                                     | 16 388                           | 0,47                      |                                                      |                                     | 23 240                           | 0,67                      | Total Sénégal                                          |                                     | 21 596                           | 0,62                      |
| <b>OMAN</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>SERBIE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                         |                                     |                                  |                           | Corp. Financiera de Desarrollo S.A.                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| AL Jawaher Assets Co. Spc                                                    |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 06/05/2030                              | 7 000                               | 7 111                            | 0,21                      | Telecommunications Co. Telekom Srbija AD Belgrade      |                                     |                                  |                           |
| 4,662 % éch. 29/10/2030                                                      | 20 000                              | 19 634                           | 0,56                      | 5,950 % éch. 30/04/2029                              | 20 400                              | 20 966                           | 0,60                      | 7,250 % éch. 18/05/2031                                | 5 500                               | 5 490                            | 0,16                      |
| Bank Muscat SAOG                                                             |                                     |                                  |                           | Fondo MIVIVIENDA S.A.                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 4,846 % éch. 01/10/2030                                                      | 12 200                              | 12 028                           | 0,35                      | 4,625 % éch. 12/04/2027                              | 2 994                               | 3 005                            | 0,09                      | Obligation internationale du gouvernement serbe        |                                     |                                  |                           |
|                                                                              |                                     | 31 662                           | 0,91                      | 5,400 % éch. 31/03/2031                              | 2 700                               | 2 724                            | 0,08                      | 1,000 % éch. 23/09/2028 (j)                            | € 15 300                            | 16 506                           | 0,47                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien   |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 06/05/2038                                | 11 700                              | 13 395                           | 0,39                      |
| Obligation internationale du gouvernement omanais                            |                                     |                                  |                           | 1,950 % éch. 17/11/2036 (j)                          | € 14 200                            | 13 499                           | 0,39                      | 6,000 % éch. 12/06/2034                                | \$ 35 100                           | 36 005                           | 1,04                      |
| 6,750 % éch. 17/01/2048                                                      | 10 500                              | 11 540                           | 0,33                      | 3,000 % éch. 15/01/2034                              | \$ 22 200                           | 19 258                           | 0,56                      |                                                        |                                     | 65 906                           | 1,90                      |
| 7,000 % éch. 25/01/2051                                                      | 4 400                               | 5 021                            | 0,15                      | 3,600 % éch. 15/01/2072                              | 14 400                              | 9 200                            | 0,27                      | Total Serbie                                           |                                     | 71 396                           | 2,06                      |
|                                                                              |                                     | 16 561                           | 0,48                      | 5,400 % éch. 12/08/2034                              | PEN 23 600                          | 6 764                            | 0,20                      | <b>SINGAPOUR</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| Total Oman                                                                   |                                     | 48 223                           | 1,39                      | 6,150 % éch. 12/08/2032                              | 19 000                              | 6 035                            | 0,17                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| <b>PAKISTAN</b>                                                              |                                     |                                  |                           | 6,850 % éch. 12/08/2035                              | 73 380                              | 22 649                           | 0,65                      | Flex Ltd.                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | 6,900 % éch. 12/08/2037                              | 5 100                               | 1 533                            | 0,04                      | 4,875 % éch. 15/06/2029                                | 200                                 | 200                              | 0,01                      |
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais                        |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 12/08/2031                              | 5 841                               | 1 949                            | 0,06                      | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 05/12/2027                                                      | 1 895                               | 1 914                            | 0,06                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                              | 14 800                              | 4 863                            | 0,14                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 6,975 % éch. 24/04/2029                                                      | 9 300                               | 9 331                            | 0,27                      | 7,600 % éch. 12/08/2039                              | 7 150                               | 2 252                            | 0,06                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 08/04/2031                                                      | 1 100                               | 1 110                            | 0,03                      | Total Pérou                                          |                                     | 121 808                          | 3,52                      | 5,375 % éch. 24/07/2044                                | 11 000                              | 9 339                            | 0,27                      |
| Total Pakistan                                                               |                                     | 12 355                           | 0,36                      |                                                      |                                     | 145 048                          | 4,19                      | 5,750 % éch. 30/09/2049                                | 21 800                              | 18 478                           | 0,53                      |
| <b>PANAMA</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>PHILIPPINES</b>                                   |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/02/2031                                | ZAR 16 200                          | 955                              | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 11/12/2055                                | \$ 13 500                           | 13 495                           | 0,39                      |
| Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement philippin  |                                     |                                  |                           | 7,950 % éch. 19/11/2054                                | 4 700                               | 5 085                            | 0,15                      |
| 5,125 % éch. 11/08/2061                                                      | 2 900                               | 2 463                            | 0,07                      | 4,200 % éch. 29/03/2047                              | \$ 16 100                           | 13 086                           | 0,38                      | 8,500 % éch. 31/01/2037                                | ZAR 421 700                         | 25 632                           | 0,74                      |
| Banco General S.A.                                                           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 17/01/2048                              | 18 200                              | 17 544                           | 0,50                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 317 900                             | 20 101                           | 0,58                      |
| 5,250 % éch. 07/05/2031 (g)(j)                                               | 5 500                               | 5 257                            | 0,15                      | 5,600 % éch. 14/05/2049                              | 15 450                              | 15 119                           | 0,44                      | 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 41 300                              | 2 549                            | 0,07                      |
| Banco Nacional de Panama                                                     |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 27/01/2051 (j)                          | 7 500                               | 7 510                            | 0,22                      | Total Afrique du Sud                                   |                                     | 95 634                           | 2,76                      |
| 2,500 % éch. 11/08/2030                                                      | 400                                 | 358                              | 0,01                      | Total Philippines                                    |                                     | 53 259                           | 1,54                      | <b>CORÉE DU SUD</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| Empresa de Transmision Electrica S.A.                                        |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 02/05/2049                                                      | 1 000                               | 805                              | 0,02                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | Hanwha Life Insurance Co. Ltd.                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                              |                                     | 8 883                            | 0,25                      | mBank S.A.                                           |                                     |                                  |                           | 3,379 % éch. 04/02/2032                                | \$ 6 700                            | 6 638                            | 0,19                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | KEB Hana Bank                                          |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen                           |                                     |                                  |                           | Bank Gospodarstwa Krajowego                          |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch.                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/05/2047                                                      | 200                                 | 166                              | 0,01                      | 4,375 % éch. 13/03/2039                              | 3 100                               | 3 623                            | 0,10                      | 19/10/2026 (g)(h)                                      | 6 500                               | 6 481                            | 0,19                      |
| 4,500 % éch. 16/04/2050                                                      | 9 800                               | 7 870                            | 0,23                      | Obligation internationale du gouvernement polonais   |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 23/04/2029                                | 7 300                               | 7 474                            | 0,22                      |
| 4,500 % éch. 19/01/2063                                                      | 18 900                              | 14 647                           | 0,42                      | 3,875 % éch. 07/07/2037                              | 13 100                              | 15 101                           | 0,43                      | Kookmin Bank                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,227 % éch. 23/02/2034                                                      | 3 400                               | 3 346                            | 0,10                      |                                                      |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 04/11/2030 (h)                            | 2 500                               | 2 267                            | 0,07                      |
| 5,662 % éch. 23/02/2038                                                      | 1 800                               | 1 798                            | 0,05                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,400 % éch. 14/02/2035                                                      | 3 800                               | 4 022                            | 0,12                      |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |

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

| DESCRIPTION                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Shinhan Bank Co. Ltd.          |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 13/04/2032 (h)(j) | \$ 9 000                            | \$ 8 747                         | 0,25                      |
| 5,750 % éch. 15/04/2034 (h)    | 6 900                               | 7 117                            | 0,21                      |
| SK Hynix, Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 19/01/2031 (j)    | 18 900                              | 17 109                           | 0,49                      |
| 6,500 % éch. 17/01/2033        | 5 600                               | 6 073                            | 0,17                      |
|                                |                                     | 61 906                           | 1,79                      |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                             |        |        |      |
|-----------------------------|--------|--------|------|
| Export-Import Bank of Korea |        |        |      |
| 2,125 % éch. 18/01/2032     | 14 700 | 13 060 | 0,37 |
| 5,125 % éch. 11/01/2033     | 14 000 | 14 503 | 0,42 |
| Korea Water Resources Corp. |        |        |      |
| 4,375 % éch. 21/05/2027     | 10 000 | 9 998  | 0,29 |
|                             |        | 37 561 | 1,08 |
| Total Corée du Sud          |        | 99 467 | 2,87 |

### SRI LANKA

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                       |        |        |      |
|-------------------------------------------------------|--------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement sri-lankais |        |        |      |
| 3,100 % éch. 15/01/2030                               | 9 112  | 9 310  | 0,27 |
| 3,350 % éch. 15/03/2033                               | 14 275 | 13 755 | 0,40 |
| 3,600 % éch. 15/06/2035                               | 3 258  | 2 726  | 0,08 |
| 3,600 % éch. 15/05/2036 (j)                           | 5 202  | 5 236  | 0,15 |
| 3,600 % éch. 15/02/2038                               | 15 509 | 15 695 | 0,45 |
| 4,000 % éch. 15/04/2028                               | 4 710  | 4 557  | 0,13 |
| Total Sri Lanka                                       |        | 51 279 | 1,48 |

### SUPRANATIONALES

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                         |          |        |      |
|-----------------------------------------|----------|--------|------|
| Africa Finance Corp.                    |          |        |      |
| 2,870 % éch. 13/08/2031                 | 400      | 360    | 0,01 |
| 2,900 % éch. 21/07/2031                 | 400      | 361    | 0,01 |
| Banque africaine de développement       |          |        |      |
| 5,875 % éch. 07/05/2035 (g)(h)          | 8 300    | 8 181  | 0,24 |
| Banque Ouest Africaine de Développement |          |        |      |
| 2,750 % éch. 22/01/2033                 | € 14 000 | 13 698 | 0,40 |
| 5,000 % éch. 27/07/2027                 | \$ 800   | 797    | 0,02 |
| 6,250 % éch. 14/10/2040                 | € 5 400  | 5 919  | 0,17 |
| Total Supranationales                   |          | 29 316 | 0,85 |

### SURINAME

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                       |          |        |      |
|-------------------------------------------------------|----------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement du Suriname |          |        |      |
| 7,700 % éch. 06/11/2030                               | \$ 4 900 | 5 114  | 0,15 |
| 8,500 % éch. 06/11/2035                               | 6 500    | 7 125  | 0,20 |
| Total Suriname                                        |          | 12 239 | 0,35 |

### TANZANIE

#### CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                                    |         |       |      |
|------------------------------------|---------|-------|------|
| Ministère des finances de Tanzanie |         |       |      |
| TBD % éch. 26/04/2028              | 1 111   | 1 119 | 0,03 |
| TBD % éch. 26/04/2031              | 1 000   | 1 022 | 0,03 |
| TBD % éch. 26/04/2028              | € 2 109 | 2 414 | 0,07 |
| Total Tanzanie                     |         | 4 555 | 0,13 |

### TRINITÉ-ET-TOBAGO

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                                |          |       |      |
|----------------------------------------------------------------|----------|-------|------|
| Obligation internationale du gouvernement de Trinité-et-Tobago |          |       |      |
| 5,950 % éch. 14/01/2031                                        | \$ 4 400 | 4 475 | 0,13 |

### TURQUIE

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                     |        |        |      |
|-------------------------------------|--------|--------|------|
| Akbank TAS                          |        |        |      |
| 7,498 % éch. 20/01/2030             | 5 500  | 5 665  | 0,16 |
| QNB Bank A/S                        |        |        |      |
| 5,875 % éch. 11/02/2031             | 6 000  | 5 839  | 0,17 |
| Türk Telekomunikasyon A/S           |        |        |      |
| 6,950 % éch. 07/10/2032             | 16 000 | 15 847 | 0,46 |
| Turkish Airlines Pass-Through Trust |        |        |      |
| 4,200 % éch. 15/09/2028             | 57     | 57     | 0,00 |
| Türkiye İls Bankası A/S             |        |        |      |
| 7,750 % éch. 12/06/2029             | 8 900  | 9 263  | 0,27 |

| DESCRIPTION                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Türkiye Vakıflar Bankası TAO |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 31/07/2030      | \$ 8 800                            | \$ 8 856                         | 0,25                      |
|                              |                                     | 45 527                           | 1,31                      |

### CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                                 |         |       |      |
|---------------------------------|---------|-------|------|
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O. |         |       |      |
| 5,401 % éch. 15/12/2028         | € 3 800 | 4 361 | 0,13 |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                |             |        |      |
|------------------------------------------------|-------------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement turc |             |        |      |
| 4,875 % éch. 16/04/2043                        | \$ 1 000    | 761    | 0,02 |
| 5,750 % éch. 11/05/2047 (j)                    | 5 300       | 4 302  | 0,13 |
| 6,375 % éch. 22/05/2031                        | 3 600       | 3 599  | 0,10 |
| 40,149 % éch. 16/06/2027                       | TRY 269 700 | 5 865  | 0,17 |
| 40,760 % éch. 19/08/2026                       | 33 600      | 723    | 0,02 |
| 40,760 % éch. 17/05/2028                       | 427 300     | 9 246  | 0,27 |
| Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S              |             |        |      |
| 6,875 % éch. 03/07/2028                        | \$ 2 500    | 2 540  | 0,07 |
|                                                |             | 27 036 | 0,78 |
| Total Turquie                                  |             | 76 924 | 2,22 |

### UKRAINE

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                     |        |        |      |
|-----------------------------------------------------|--------|--------|------|
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien |        |        |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2030                             | 3 033  | 2 184  | 0,06 |
| 0,000 % éch. 01/02/2034                             | 11 334 | 6 432  | 0,19 |
| 0,000 % éch. 01/02/2035                             | 7 933  | 4 787  | 0,14 |
| 0,000 % éch. 01/02/2036 (j)                         | 3 709  | 2 235  | 0,06 |
| 4,000 % éch. 01/02/2032                             | 15 451 | 12 813 | 0,37 |
| 4,500 % éch. 01/02/2029 (j)                         | 8 814  | 7 438  | 0,21 |
| 4,500 % éch. 01/02/2034                             | 16 653 | 11 741 | 0,34 |
| 4,500 % éch. 01/02/2035                             | 15 307 | 10 638 | 0,31 |
| 4,500 % éch. 01/02/2036                             | 9 359  | 6 420  | 0,19 |
| Total Ukraine                                       |        | 64 688 | 1,87 |

### ÉMIRATS ARABES UNIS

#### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                         |        |         |      |
|-----------------------------------------|--------|---------|------|
| Abu Dhabi Commercial Bank PJSC          |        |         |      |
| 5,500 % éch. 12/01/2029                 | 7 500  | 7 613   | 0,22 |
| Abu Dhabi Future Energy Co. PJSC Masdar |        |         |      |
| 4,875 % éch. 25/07/2029                 | 12 500 | 12 505  | 0,36 |
| 4,875 % éch. 21/05/2030                 | 3 300  | 3 298   | 0,10 |
| 4,875 % éch. 25/07/2033                 | 18 000 | 17 723  | 0,51 |
| 5,375 % éch. 21/05/2035                 | 6 000  | 6 064   | 0,17 |
| DAE Sukuk Dific Ltd.                    |        |         |      |
| 4,500 % éch. 16/10/2030                 | 1 900  | 1 832   | 0,05 |
| Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC              |        |         |      |
| 5,794 % éch. 30/06/2053                 | 13 700 | 13 583  | 0,39 |
| Emirates NBD Bank PJSC                  |        |         |      |
| 4,195 % éch. 13/01/2029                 | 10 200 | 10 059  | 0,29 |
| 5,125 % éch. 29/06/2031                 | 11 100 | 11 100  | 0,32 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC               |        |         |      |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                 | 13 100 | 13 119  | 0,38 |
| MDGH GMTN RSC Ltd.                      |        |         |      |
| 5,875 % éch. 01/05/2034                 | 9 900  | 10 415  | 0,30 |
| NBK SPC Ltd.                            |        |         |      |
| 5,500 % éch. 06/06/2030                 | 19 000 | 19 250  | 0,56 |
| Sobha Sukuk Holding Ltd.                |        |         |      |
| 7,125 % éch. 11/09/2030                 | 10 000 | 9 681   | 0,28 |
| Sweihan PV Power Co. PJSC               |        |         |      |
| 3,625 % éch. 31/01/2049                 | 4 113  | 3 373   | 0,10 |
|                                         |        | 139 615 | 4,03 |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                                   |       |         |      |
|-------------------------------------------------------------------|-------|---------|------|
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |       |         |      |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 9 000 | 8 971   | 0,26 |
| 4,750 % éch. 22/09/2036                                           | 6 100 | 6 050   | 0,18 |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                           | 9 600 | 9 764   | 0,28 |
| Département des finances du gouvernement de Sharjah               |       |         |      |
| 6,500 % éch. 23/11/2032                                           | 8 400 | 8 733   | 0,25 |
|                                                                   |       | 33 518  | 0,97 |
| Total Émirats arabes unis                                         |       | 173 133 | 5,00 |

| DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                 |                                     |                                  |                           |
| Sibanye-Stillwater UK Financing PLC           |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/11/2031                       | \$ 1 400                            | \$ 1 386                         | 0,04                      |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC          |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                       | £ 1 600                             | 2 256                            | 0,06                      |
| Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 15/07/2028 ^                     | \$ 3 825                            | 3 184                            | 0,09                      |
| 8,250 % éch. 09/07/2026 ^                     | 3 664                               | 3 105                            | 0,09                      |
|                                               |                                     | 9 931                            | 0,28                      |

### TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

|                           |         |        |      |
|---------------------------|---------|--------|------|
| Canada Square Funding PLC |         |        |      |
| 4,597 % éch. 17/01/2059   | £ 1 426 | 1 894  | 0,06 |
| Rochester Financing PLC   |         |        |      |
| 5,046 % éch. 18/12/2044   | 889     | 1 181  | 0,03 |
|                           |         | 3 075  | 0,09 |
| Total Royaume-Uni         |         | 13 006 | 0,37 |

### ÉTATS-UNIS

#### TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS

|                                                                    |        |       |      |
|--------------------------------------------------------------------|--------|-------|------|
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                  |        |       |      |
| 4,243 % éch. 25/02/2037                                            | \$ 194 | 191   | 0,01 |
| 4,888 % éch. 25/11/2035                                            | 340    | 337   | 0,01 |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                  |        |       |      |
| 3,089 % éch. 25/01/2037                                            | 2 132  | 576   | 0,02 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                     |        |       |      |
| 4,063 % éch. 25/09/2036                                            | 695    | 445   | 0,01 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                                |        |       |      |
| 4,203 % éch. 25/11/2036                                            | 765    | 447   | 0,01 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                             |        |       |      |
| 4,558 % éch. 25/03/2034                                            | 449    | 481   | 0,02 |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust               |        |       |      |
| 4,063 % éch. 25/07/2036                                            | 101    | 95    | 0,00 |
| Option One Mortgage Loan Trust                                     |        |       |      |
| 4,203 % éch. 25/05/2037                                            | 188    | 114   | 0,00 |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |        |       |      |
| 4,543 % éch. 25/09/2035                                            | 1 000  | 921   | 0,03 |
| Saxon Asset Securities Trust                                       |        |       |      |
| 4,073 % éch. 25/09/2037                                            | 23     | 22    | 0,00 |
| Soundview Home Loan Trust                                          |        |       |      |
| 4,123 % éch. 25/02/2037                                            | 181    | 48    | 0,00 |
| 4,663 % éch. 25/10/2037                                            | 99     | 79    | 0,00 |
|                                                                    |        | 3 756 | 0,11 |

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                        |           |        |      |
|----------------------------------------|-----------|--------|------|
| Alphabet, Inc.                         |           |        |      |
| 6,125 % éch. 13/02/2126                | £ 8 400   | 10 571 | 0,30 |
| Beignet Investor LLC                   |           |        |      |
| 6,581 % éch. 30/05/2049 (j)            | \$ 31 740 | 32 395 | 0,93 |
| Ford Motor Co.                         |           |        |      |
| 3,250 % éch. 12/02/2032 (j)            | 12 000    | 10 581 | 0,31 |
| Gabon Blue Bond Master Trust           |           |        |      |
| 6,097 % éch. 01/08/2038                | 4 100     | 4 093  | 0,12 |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. |           |        |      |
| 5,000 % éch. 27/07/2028 (j)            | 14 200    | 14 318 | 0,41 |
| RD Michigan Property Owner LLC         |           |        |      |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                | 5 100     | 5 086  | 0,15 |
| Rutas 2 & 7 Finance Ltd.               |           |        |      |
| 0,000 % éch. 30/09/2036 (d)            | 3 640     | 2 796  | 0,08 |
|                                        |           | 79 840 | 2,30 |

### CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                            |          |        |      |
|----------------------------|----------|--------|------|
| Stepstone Group Midco GmbH |          |        |      |
| 6,885 % éch. 26/04/2032    | € 10 200 | 9 573  | 0,28 |
| Ziraat Bank                |          |        |      |
| 6,764 % éch. 15/06/2034    | \$ 9 000 | 9 166  | 0,26 |
|                            |          | 18 739 | 0,54 |

### TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

|                                                         |       |       |      |
|---------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. |       |       |      |
| 4,407 % éch. 15/11/2061                                 | 3 300 | 3 267 | 0,10 |

| DESCRIPTION                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Benchmark Mortgage Trust<br>4,261 % éch. 10/10/2051 \$                                               | 4 400                               | \$ 4 345                         | 0,13                      | 9,450 % éch. 23/10/2030 (g) \$                                                        | 7 300                               | 12 681                           | 0,37                      | 24,351 % éch.<br>22/09/2026 (d)(e) EGP     | 123 850                             | \$ 2 395                         | 0,07                      |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust<br>4,413 % éch. 25/10/2036                                       | 57                                  | 45                               | 0,00                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                |                                     |                                  |                           | 24,451 % éch.<br>13/10/2026 (d)(e)         | 11 450                              | 219                              | 0,01                      |
| Countrywide Alternative Loan Trust<br>4,113 % éch. 25/05/2036                                        | 111                                 | 40                               | 0,00                      | Joint Stock Co. Asakabank<br>5,084 % éch. 07/12/2027 €                                | 5 000                               | 5 702                            | 0,16                      | 24,651 % éch.<br>10/11/2026 (d)(e)         | 111 750                             | 2 097                            | 0,06                      |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates<br>3,509 % éch. 30/11/2037                               | 397                                 | 368                              | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                          |                                     |                                  |                           | 26,001 % éch.<br>07/07/2026 (d)(e)         | 607 200                             | 12 297                           | 0,36                      |
| IndyMac Mortgage Loan Trust<br>3,393 % éch. 25/11/2037                                               | 143                                 | 118                              | 0,00                      | National Bank of Uzbekistan<br>8,500 % éch. 05/07/2029 \$                             | 8 670                               | 9 251                            | 0,27                      | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>             |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/02/2037                                                                              | 196                                 | 194                              | 0,01                      | Obligation internationale de la République d'Ouzbékistan<br>5,100 % éch. 25/02/2029 € | 11 100                              | 13 016                           | 0,38                      | 20,537 % éch.<br>14/01/2027 (d)(e) NGN     | 10 247 400                          | 6 704                            | 0,19                      |
| 4,403 % éch. 25/07/2045                                                                              | 39                                  | 29                               | 0,00                      | 5,375 % éch. 29/05/2027                                                               | 7 900                               | 9 163                            | 0,26                      | 20,607 % éch.<br>21/01/2027 (d)(e)         | 9 847 500                           | 6 414                            | 0,19                      |
| JPMorgan Resecuritization Trust<br>2,500 % éch. 25/03/2056                                           | 7                                   | 7                                | 0,00                      | Total Ouzbékistan                                                                     |                                     | 31 430                           | 0,91                      | 20,677 % éch.<br>28/01/2027 (d)(e)         | 9 881 200                           | 6 408                            | 0,19                      |
| Lehman XS Trust<br>4,143 % éch. 25/09/2046                                                           | 169                                 | 156                              | 0,01                      | <b>ILES VIERGES BRITANNIQUES</b>                                                      |                                     |                                  |                           | 21,612 % éch.<br>11/08/2026 (d)(e)         | 7 384 900                           | 5 247                            | 0,15                      |
| 4,263 % éch. 25/08/2037                                                                              | 497                                 | 492                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                  |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>            |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust<br>4,063 % éch. 25/02/2037                               | 299                                 | 295                              | 0,01                      | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.<br>6,750 % éch. 24/04/2033 (j) \$            | 4 639                               | 4 695                            | 0,14                      | 3,655 % éch.<br>30/07/2026 (d)(e)(k) \$    | 3 804                               | 3 793                            | 0,11                      |
| SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust<br>4,461 % éch. 25/10/2037                              | 41                                  | 37                               | 0,00                      | <b>ZAMBIE</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | 3,661 % éch.<br>30/07/2026 (d)(e)(k)       | 3 894                               | 3 883                            | 0,11                      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>4,262 % éch. 25/03/2036                             | 154                                 | 140                              | 0,00                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                          |                                     |                                  |                           | 3,688 % éch.<br>16/07/2026 (d)(e)(k)       | 719                                 | 718                              | 0,02                      |
|                                                                                                      |                                     | 9 533                            | 0,28                      | Obligation internationale du gouvernement zambien<br>5,750 % éch. 30/06/2033          | 168                                 | 166                              | 0,00                      | 3,694 % éch.<br>28/07/2026 (d)(e)(k)       | 211                                 | 210                              | 0,01                      |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                             |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                                      |                                     |                                  |                           | 3,696 % éch.<br>13/08/2026 (a)(d)(e)(k)    | 6 798                               | 6 768                            | 0,20                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,000 % éch. 01/05/2053 -<br>01/10/2053 | 73 924                              | 73 127                           | 2,11                      | <b>BILLETS À COURT TERME</b>                                                          |                                     |                                  |                           | 3,701 % éch.<br>08/09/2026 (d)(e)(m)(k)    | 900                                 | 894                              | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                               |                                     |                                  |                           | Kona Spc Ltd.<br>5,718 % éch. 15/09/2026 €                                            | 7 900                               | 9 036                            | 0,26                      | 3,702 % éch.<br>01/09/2026 (a)(d)(e)(k)    | 369                                 | 367                              | 0,01                      |
| Obligations du Trésor américain<br>2,375 % éch. 15/02/2042                                           | 7 700                               | 5 619                            | 0,16                      | <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                                                        |                                     |                                  |                           | 3,703 % éch.<br>08/09/2026 (d)(e)(k)       | 4 695                               | 4 662                            | 0,13                      |
| 3,250 % éch. 15/05/2042 (j)                                                                          | 58 600                              | 48 271                           | 1,39                      | 23,650 % éch.<br>13/10/2026 (d)(e) EGP                                                | 18 000                              | 343                              | 0,01                      | 3,707 % éch.<br>08/09/2026 (d)(e)(k)       | 200                                 | 199                              | 0,01                      |
| 3,375 % éch. 15/08/2042                                                                              | 9 500                               | 7 930                            | 0,23                      | 24,000 % éch.<br>13/10/2026 (d)(e)                                                    | 24 700                              | 471                              | 0,01                      | 3,709 % éch.<br>01/09/2026 (a)(d)(e)(k)    | 71                                  | 70                               | 0,00                      |
| 4,875 % éch. 15/08/2045 (j)                                                                          | 920                                 | 913                              | 0,03                      | 24,001 % éch.<br>13/10/2026 (d)(e)                                                    | 455 000                             | 8 683                            | 0,25                      | 3,728 % éch.<br>10/09/2026 (d)(e)          | 50 000                              | 49 641                           | 1,43                      |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035                                               | 1 510                               | 1 491                            | 0,04                      | 24,050 % éch.<br>20/10/2026 (d)(e)                                                    | 60 600                              | 1 151                            | 0,03                      | 3,816 % éch.<br>20/10/2026 (d)(e)(k)       | 1 913                               | 1 891                            | 0,05                      |
|                                                                                                      |                                     | 64 224                           | 1,85                      | 24,200 % éch.<br>22/09/2026 (d)(e)                                                    | 6 900                               | 131                              | 0,00                      | <b>Total des Instruments à court terme</b> |                                     |                                  |                           |
| Total États-Unis                                                                                     |                                     | 249 219                          | 7,19                      | 24,299 % éch.<br>15/09/2026 (d)(e)                                                    | 66 400                              | 1 284                            | 0,04                      |                                            |                                     | 73 096                           | 2,11                      |
| <b>URUGUAY</b>                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 3 300                               | 64                               | 0,00                      |                                            |                                     | 136 040                          | 3,93                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | <b>Ouzbékistan</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>Total des Valeurs mobilières</b>        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen<br>5,750 % éch. 28/10/2034                       | 27 800                              | 29 121                           | 0,84                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                  |                                     |                                  |                           |                                            |                                     | \$ 3 759 033                     | 108,49                    |
| <b>Ouzbékistan</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           | Uzbek Industrial and Construction Bank ATB<br>8,950 % éch. 24/07/2029                 | 4 700                               | 5 055                            | 0,15                      |                                            |                                     |                                  |                           |

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026              | 530                   | \$ (310)                                | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026              | 2 014                 | 542                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026              | 1 820                 | (2 719)                                 | (0,08)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 6                     | (3)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026              | 1 447                 | (149)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 1 177                 | (181)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 2 234                 | 652                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 7 203                 | 6 466                                   | 0,19                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 1 049                 | 3 098                                   | 0,09                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ 7 396                                | 0,21                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                        |       |                      |                       | \$ 7 396                                | 0,21                   |

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

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Oracle Corp.        | 1,000 %              | 20/06/2027      | \$ 15 000                        | \$ 20                             | 0,00                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date d'échéance |     | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-----|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 %   | 16/09/2056      | £   | 9 320             | \$ 104                            | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,750     | 15/12/2031      | \$  | 1 800             | (245)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,000     | 19/03/2030      |     | 69 500            | 1 208                             | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 18/06/2030      |     | 15 900            | 164                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 19/03/2035      |     | 9 900             | (187)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 19/03/2045      |     | 6 500             | (100)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 19/03/2055      |     | 3 400             | 76                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 18/06/2055      |     | 4 400             | (109)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,325     | 31/08/2030      |     | 117 250           | 2 087                             | 0,06                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 20/12/2030      |     | 29 000            | (296)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 17/06/2033      |     | 32 750            | 433                               | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 20/12/2033      |     | 9 250             | 219                               | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 18/12/2054      |     | 24 050            | (3 939)                           | (0,11)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,730     | 03/08/2033      |     | 2 300             | (26)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,735     | 07/08/2033      |     | 2 700             | (28)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2029      |     | 6 600             | (143)                             | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2029      |     | 14 200            | 340                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2029      |     | 152 085           | 1 600                             | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/12/2030      |     | 13 200            | 260                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2034      |     | 21 900            | 182                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2034      |     | 14 400            | (191)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2034      |     | 5 100             | (17)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/12/2035      |     | 16 000            | 439                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2036      |     | 5 700             | 136                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/12/2055      |     | 800               | (20)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,830     | 12/10/2053      |     | 1 700             | (96)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,870     | 17/10/2053      |     | 1 400             | (70)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,880     | 16/10/2053      |     | 1 700             | (83)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000     | 30/11/2030      |     | 39 050            | (143)                             | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,030     | 04/10/2033      |     | 1 300             | 13                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,150     | 12/10/2033      |     | 3 400             | 66                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,155     | 02/10/2033      |     | 4 500             | 88                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,165     | 27/09/2033      |     | 5 500             | 113                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,175     | 10/10/2033      |     | 4 000             | 83                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,230     | 23/10/2033      |     | 2 800             | 69                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,250     | 20/03/2034      |     | 32 800            | 736                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,255     | 23/10/2033      |     | 2 200             | 58                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,393     | 25/10/2033      |     | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,450     | 31/10/2033      |     | 2 500             | 100                               | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 9,842     | 04/01/2027      | BRL | 110 100           | (1 790)                           | (0,05)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an                | 11,253    | 04/01/2027      |     | 207 600           | 2 015                             | 0,06                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 11,550    | 04/01/2027      |     | 14 300            | (118)                             | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 11,570    | 04/01/2027      |     | 151 400           | (1 238)                           | (0,04)              |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an                | 12,716    | 02/01/2029      |     | 800               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,015    | 02/01/2029      |     | 47 200            | (165)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an                | 13,030    | 02/01/2029      |     | 64 900            | 267                               | 0,01                |
| À recevoir                        | CDI BRL à un an                | 13,055    | 04/01/2027      |     | 81 200            | 61                                | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,056    | 02/01/2029      |     | 88 500            | (424)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                | 13,255    | 02/01/2031      |     | 126 300           | (440)                             | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,265    | 02/01/2029      |     | 65 800            | (216)                             | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,310    | 02/01/2029      |     | 74 000            | (262)                             | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,320    | 02/01/2029      |     | 126 000           | (447)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                | 13,350    | 02/01/2031      |     | 13 800            | (45)                              | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,440    | 02/01/2031      |     | 16 100            | (45)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                | 13,520    | 02/01/2031      |     | 91 300            | (225)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                | 13,560    | 02/01/2031      |     | 75 700            | (170)                             | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,615    | 02/01/2029      |     | 75 600            | (218)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                | 13,670    | 02/01/2031      |     | 16 300            | (28)                              | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,681    | 02/01/2031      |     | 63 900            | (104)                             | 0,00                |
| À payer                           | CDI BRL à un an                | 13,685    | 02/01/2029      |     | 75 600            | (187)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>            | JIBAR ZAR à 3 mois             | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR | 114 700           | (62)                              | 0,00                |
| À payer                           | CHILIBOR CLP à 6 mois          | 4,855     | 18/12/2033      | CLP | 8 000 000         | (32)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | CHILIBOR CLP à 6 mois          | 5,511     | 13/11/2033      |     | 8 456 600         | (362)                             | (0,01)              |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,075     | 03/10/2029      | CZK | 174 000           | (134)                             | 0,00                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,080     | 03/10/2029      |     | 361 000           | (276)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,328     | 09/05/2030      |     | 750 000           | 977                               | 0,03                |
| À recevoir                        | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,363     | 29/05/2030      |     | 993 800           | 779                               | 0,02                |
| À payer                           | PRIBOR CZK à 6 mois            | 3,489     | 30/10/2029      |     | 458 000           | 111                               | 0,00                |



| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,530 %   | 15/07/2029      | CZK 767 200       | \$ 76                             | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,636     | 09/02/2031      | 1 710 477         | 555                               | 0,02                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,920     | 09/02/2031      | 666 500           | (632)                             | (0,02)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,930     | 22/05/2036      | 212 000           | 50                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,049     | 12/12/2030      | 879 500           | 180                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 18/04/2029      | 180 700           | (175)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,470     | 25/05/2031      | 201 966           | 162                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,480     | 11/03/2036      | 762 808           | 812                               | 0,02                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,625     | 25/05/2036      | 140 958           | 229                               | 0,01                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 20/03/2044      | € 1 800           | 142                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 176 400           | (99)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 139 800           | 17                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,818     | 26/06/2029      | 24 100            | (640)                             | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 8 490             | (234)                             | (0,01)              |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,300     | 03/10/2033      | 3 700             | 229                               | 0,01                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,370     | 09/10/2028      | 1 000             | 40                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,450     | 20/10/2028      | 4 300             | 183                               | 0,01                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,935     | 08/05/2030      | HUF 13 405 000    | 1 620                             | 0,05                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,040     | 15/04/2036      | 605 700           | (190)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,070     | 15/04/2036      | 980 700           | (315)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,190     | 18/11/2030      | 3 102 600         | (906)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,410     | 21/11/2030      | 5 225 200         | (1 533)                           | (0,04)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,430     | 14/04/2036      | 1 519 000         | (624)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,435     | 21/11/2030      | 231 900           | (69)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,439     | 24/11/2030      | 1 655 700         | (495)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,500     | 25/11/2030      | 616 500           | (189)                             | (0,01)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,910     | 19/03/2036      | 1 355 500         | 724                               | 0,02                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 7,020     | 16/03/2036      | 2 793 500         | 1 573                             | 0,05                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | BBR HUF à 6 mois        | 7,050     | 11/03/2036      | 1 203 600         | (568)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,075     | 11/04/2030      | PLN 75 300        | (127)                             | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,655     | 16/03/2036      | 16 800            | 157                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,678     | 11/03/2036      | 15 100            | 150                               | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,828     | 17/03/2036      | 8 300             | 108                               | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,855     | 10/02/2030      | 75 300            | 616                               | 0,02                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 8,193     | 04/06/2036      | MXN 38 900        | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,280     | 06/03/2036      | 38 700            | 28                                | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 04/06/2036      | 200               | 0                                 | 0,00                |
|                                  |                         |           |                 |                   | \$ 957                            | 0,03                |
|                                  |                         |           |                 |                   | \$ 977                            | 0,03                |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

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

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

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

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option de vente - EUR contre BRL hors cote | BRL 5,850       | 19/08/2026        | 22 119                           | \$ 317 | \$ 112       | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - EUR contre BRL hors cote | BRL 6,250       | 19/08/2026        | 22 119                           | \$ (356) | \$ (130)     | (0,01)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 14 540                           | (187)    | (46)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote | 375,000         | 10/11/2026        | 14 778                           | (234)    | (127)        | 0,00                |
|              |                                           |                 |                   |                                  | \$ (777) | \$ (303)     | (0,01)              |

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

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

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Primes<br>payées/reçues | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000) %              | 20/12/2030         | \$ 3 400                            | \$ (71)                 | \$ (16)                                 | \$ (87)         | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2035         | 7 250                               | 499                     | (278)                                   | 221             | 0,01                   |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement hongrois | (1,000)                | 20/12/2029         | 9 000                               | 71                      | (224)                                   | (153)           | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2029         | 8 800                               | 35                      | (153)                                   | (118)           | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2035         | 400                                 | 28                      | (16)                                    | 12              | 0,00                   |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000)                | 20/12/2030         | 12 300                              | (257)                   | (59)                                    | (316)           | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2035         | 4 000                               | 267                     | (145)                                   | 122             | 0,00                   |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2029         | 2 400                               | 9                       | (41)                                    | (32)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2035         | 1 200                               | 84                      | (47)                                    | 37              | 0,00                   |
| DUB          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000)                | 20/12/2030         | 600                                 | (13)                    | (2)                                     | (15)            | 0,00                   |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2029         | 16 100                              | 70                      | (285)                                   | (215)           | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2035         | 1 500                               | 102                     | (56)                                    | 46              | 0,00                   |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement chilien  | (1,000)                | 20/12/2030         | 11 500                              | (246)                   | (49)                                    | (295)           | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2029         | 8 500                               | 52                      | (166)                                   | (114)           | 0,00                   |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2029         | 10 200                              | 48                      | (184)                                   | (136)           | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000)                | 20/06/2035         | 4 250                               | 295                     | (165)                                   | 130             | 0,00                   |
|              |                                                    |                        |                    |                                     | \$ 973                  | \$ (1 886)                              | \$ (913)        | (0,03)                 |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                        | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/reçues | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000 %                 | 20/12/2026         | \$ 100                              | \$ 2                    | \$ 0                                    | \$ 2            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement égyptien         | 1,000                   | 20/12/2026         | 8 200                               | (92)                    | 64                                      | (28)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement omanais          | 1,000                   | 20/12/2030         | 7 000                               | 99                      | 12                                      | 111             | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement péruvien         | 1,000                   | 20/12/2031         | 10 700                              | (451)                   | 618                                     | 167             | 0,01                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                   | 20/06/2031         | 2 500                               | (26)                    | (1)                                     | (27)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                   | 20/12/2035         | 1 900                               | (221)                   | 71                                      | (150)           | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                   | 20/06/2027         | 100                                 | (20)                    | 20                                      | 0               | 0,00                   |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/12/2026         | 900                                 | 15                      | 4                                       | 19              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien        | 1,000                   | 20/12/2026         | 10 400                              | (639)                   | 669                                     | 30              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien        | 1,000                   | 20/12/2027         | 8 200                               | (589)                   | 642                                     | 53              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/06/2029         | 12 000                              | (432)                   | 471                                     | 39              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain         | 1,000                   | 20/12/2027         | 6 000                               | 12                      | 44                                      | 56              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement serbe            | 1,000                   | 20/12/2027         | 1 600                               | (142)                   | 151                                     | 9               | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                   | 20/06/2028         | 32 000                              | (2 761)                 | 3 094                                   | 333             | 0,01                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                   | 20/06/2027         | 3 800                               | (751)                   | 759                                     | 8               | 0,00                   |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/12/2026         | 4 173                               | 7                       | 81                                      | 88              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/06/2027         | 3 050                               | 36                      | 72                                      | 108             | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2026         | 4 800                               | 7                       | 7                                       | 14              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2035         | 2 700                               | (397)                   | 139                                     | (258)           | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement indonésien       | 1,000                   | 20/06/2031         | 22 900                              | 21                      | 94                                      | 115             | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian         | 1,000                   | 20/12/2026         | 1 500                               | (5)                     | 4                                       | (1)             | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian         | 1,000                   | 20/06/2027         | 6 700                               | (69)                    | 49                                      | (20)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                   | 20/06/2031         | 6 600                               | 29                      | 12                                      | 41              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement polonais         | 1,000                   | 20/06/2028         | 6 500                               | 49                      | 47                                      | 96              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                   | 20/12/2030         | 17 800                              | (1 066)                 | 333                                     | (733)           | (0,02)                 |
| BSS          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/06/2027         | 600                                 | (103)                   | 124                                     | 21              | 0,00                   |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/12/2026         | 5 019                               | 20                      | 86                                      | 106             | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/06/2027         | 1 367                               | (78)                    | 126                                     | 48              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement brésilien        | 1,000                   | 20/06/2031         | 10 500                              | (193)                   | 78                                      | (115)           | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2026         | 10 600                              | 14                      | 18                                      | 32              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/06/2029         | 12 200                              | (440)                   | 480                                     | 40              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2030         | 2 100                               | (105)                   | 78                                      | (27)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2035         | 4 800                               | (700)                   | 242                                     | (458)           | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | 1,000                   | 20/06/2030         | 1 700                               | (214)                   | 160                                     | (54)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien       | 5,000                   | 20/06/2027         | 2 500                               | 84                      | 11                                      | 95              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain         | 1,000                   | 20/12/2029         | 17 000                              | (151)                   | 363                                     | 212             | 0,01                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                   | 20/06/2034         | 5 000                               | (573)                   | 463                                     | (110)           | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement qatari           | 1,000                   | 20/12/2026         | 5 000                               | 140                     | (117)                                   | 23              | 0,00                   |
| DUB          | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2030         | 6 700                               | (337)                   | 251                                     | (86)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                   | 20/12/2026         | 10 400                              | (638)                   | 680                                     | 42              | 0,00                   |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/12/2026         | 4 361                               | 23                      | 69                                      | 92              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/06/2027         | 7 259                               | (921)                   | 1 178                                   | 257             | 0,01                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/06/2029         | 7 200                               | (259)                   | 282                                     | 23              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/06/2031         | 500                                 | (25)                    | 15                                      | (10)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement égyptien         | 1,000                   | 20/06/2027         | 8 000                               | (162)                   | 88                                      | (74)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                   | 20/06/2030         | 200                                 | (8)                     | 10                                      | 2               | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement polonais         | 1,000                   | 20/06/2028         | 8 500                               | 77                      | 48                                      | 125             | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement qatari           | 1,000                   | 20/12/2029         | 7 600                               | 211                     | (13)                                    | 198             | 0,01                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                   | 20/06/2027         | 4 300                               | (840)                   | 849                                     | 9               | 0,00                   |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                   | 20/06/2027         | 1 000                               | 14                      | 21                                      | 35              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement camerounais      | 1,000                   | 20/12/2026         | 700                                 | (17)                    | 7                                       | (10)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/12/2026         | 2 500                               | 3                       | 4                                       | 7               | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                   | 20/06/2031         | 3 200                               | (156)                   | 94                                      | (62)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | 1,000                   | 20/06/2030         | 525                                 | (65)                    | 48                                      | (17)            | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien       | 5,000                   | 20/06/2027         | 7 850                               | 259                     | 38                                      | 297             | 0,01                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement hongrois         | 1,000                   | 20/06/2027         | 5 700                               | (290)                   | 339                                     | 49              | 0,00                   |
|              | Obligation internationale du gouvernement polonais         | 1,000                   | 20/06/2028         | 900                                 | (2)                     | 15                                      | 13              | 0,00                   |



| Contrepartie | Entité de référence                                        | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000 %              | 20/12/2035      | \$ 500                           | \$ (58)                | \$ 19                             | \$ (39)      | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                | 20/12/2029      | 3 600                            | (270)                  | 189                               | (81)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/12/2026      | 5 075                            | (64)                   | 171                               | 107          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/06/2027      | 11 905                           | (691)                  | 1 111                             | 420          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                | 20/06/2029      | 13 300                           | (478)                  | 521                               | 43           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                | 20/06/2031      | 28 500                           | (1 404)                | 848                               | (556)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                | 20/12/2035      | 10 000                           | (1 477)                | 524                               | (953)        | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | 1,000                | 20/06/2030      | 325                              | (41)                   | 31                                | (10)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian         | 1,000                | 20/06/2030      | 320                              | (85)                   | 70                                | (15)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                | 20/06/2031      | 4 600                            | 24                     | 4                                 | 28           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                | 20/06/2034      | 5 000                            | (573)                  | 463                               | (110)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement péruvien         | 1,000                | 20/12/2026      | 20 000                           | 80                     | 0                                 | 80           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement qatari           | 1,000                | 20/12/2026      | 3 900                            | 57                     | (39)                              | 18           | 0,00                |
|              | SoftBank Group Corp.                                       | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 1 382 800                      | (144)                  | 88                                | (56)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 4 600                         | (206)                  | 225                               | 19           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                | 20/06/2027      | 1 800                            | (356)                  | 360                               | 4            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                | 20/06/2031      | 16 000                           | (1 287)                | 467                               | (820)        | (0,02)              |
|              |                                                            |                      |                 |                                  | \$ (19 789)            | \$ 18 643                         | \$ (1 146)   | (0,03)              |

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

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | \$ 9              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CAD 9             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | \$              | AUD 14            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DOP             | \$ 2 178          | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 2 823             | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON             | € 3 135           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 531             | 0                  | (52)                  | (52)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 45                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 426           | KRW 2 171 987     | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 76              | NOK 704           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 246             | PLN 927           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP             | \$ 652            | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 155 658 808       | 40 283             | (4 084)               | (4 084)                                 | (0,12)              |
|              | 09/2026           | KZT             | 227 779           | 453                | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             | 12 350            | 200                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | € 13 299          | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CZK             | \$ 3 068          | 60                 | 0                     | 60                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 20 999            | 0                  | (152)                 | (152)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 13 238 049        | 8 760              | 209                   | 209                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 17 539            | 0                  | (422)                 | (422)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 2 269           | € 1 955           | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 419           | INR 329 286       | 55                 | 0                     | 55                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 559           | KWD 476           | 0                  | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$ 3 793          | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | BRL 2 282         | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | \$ 40             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 15 510            | 4 513              | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | IDR 169 858       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 16              | THB 526           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | IDR             | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | \$              | KWD 320           | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD             | \$ 14 553         | 747                | 0                     | 747                                     | 0,02                |
|              | 07/2029           | 930             | 3 200             | 165                | 0                     | 165                                     | 0,00                |
|              | 05/2030           | 2 509           | 8 640             | 443                | 0                     | 443                                     | 0,01                |
|              | 08/2030           | 496             | 1 674             | 51                 | 0                     | 51                                      | 0,00                |
| BRC          | 01/2031           | 1 076           | 3 625             | 107                | 0                     | 107                                     | 0,00                |
|              | 06/2031           | 1 503           | 5 056             | 137                | 0                     | 137                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 914               | 662                | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 244             | RON 32 847         | 19                    | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 50              | \$ 58             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 6 166             | 1 825              | 19                    | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON             | 32 740            | € 6 232            | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 506 927           | \$ 10 628          | 0                     | (108)                                   | 0,00                |

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

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| BSH          | 07/2026           | \$              | 2 861             | CZK 60 000         | \$ 0                  | \$ (34)                                 | \$ (34)             | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 652               | MYR 2 647          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 28 537            | TRY 1 364 505      | 349                   | 0                                       | 349                 | 0,01   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 307 290           | \$ 18 919          | 200                   | 0                                       | 200                 | 0,01   |
|              | 09/2026           | PEN             | 823               | 242                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 62                | 43                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 3 002             | 3 500              | 68                    | 0                                       | 68                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             | 18 913            | 5 521              | 38                    | (61)                                    | (23)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 43                | AUD 62             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | COP             | 93 709 850        | \$ 24 595          | 0                     | (2 461)                                 | (2 461)             | (0,07) |
| CBK          | 07/2026           | EGP             | 19 197            | 383                | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 558               | 641                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | HUF             | 132 217           | 433                | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             | 65 611            | 18 894             | 25                    | (359)                                   | (334)               | (0,01) |
|              | 07/2026           | \$              | 220               | BRL 1 112          | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 8 162             | COP 28 640 658     | 107                   | 0                                       | 107                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 593             | EGP 87 367         | 173                   | 0                                       | 173                 | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 6 823             | € 5 851            | 0                     | (133)                                   | (133)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 8 661             | HUF 2 704 148      | 19                    | 0                                       | 19                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 235               | KZT 126 641        | 29                    | 0                                       | 29                  | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           |                 | 2 902             | PEN 9 901          | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 219               | PLN 799            | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | INR             | 2 523 924         | \$ 26 925          | 372                   | 0                                       | 372                 | 0,01   |
|              | 09/2026           | COP             | 82 863 809        | 21 761             | 0                     | (1 857)                                 | (1 857)             | (0,05) |
|              | 09/2026           | IDR             | 171 260           | 10                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | KZT             | 475 637           | 942                | 0                     | (27)                                    | (27)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 72                | 4                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 22 741            | 6 674              | 27                    | (3)                                     | 24                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 2 324             | COP 9 023 244      | 248                   | 0                                       | 248                 | 0,01   |
|              | 09/2026           |                 | 383               | EGP 19 724         | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
| FAR          | 09/2026           |                 | 40                | IDR 727 675        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 16                | PEN 56             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 10/2026           | COP             | 9 737 345         | \$ 2 732           | 0                     | (21)                                    | (21)                | 0,00   |
|              | 10/2026           | PEN             | 23 109            | 6 797              | 48                    | 0                                       | 48                  | 0,00   |
|              | 11/2026           | COP             | 19 667 385        | 5 430              | 0                     | (93)                                    | (93)                | 0,00   |
|              | 11/2026           | NGN             | 394 203           | 241                | 0                     | (30)                                    | (30)                | 0,00   |
|              | 11/2026           | PEN             | 6 633             | 1 939              | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 12/2026           | IDR             | 732 547           | 40                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 12/2026           | PEN             | 19 339            | 5 533              | 0                     | (103)                                   | (103)               | 0,00   |
|              | 07/2026           | CZK             | 68 995            | 3 314              | 63                    | 0                                       | 63                  | 0,00   |
| GLM          | 07/2026           | INR             | 235 571           | 2 495              | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | KZT             | 3 329 614         | 7 026              | 118                   | 0                                       | 118                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | RON             | 231               | 51                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 3 848             | INR 371 128        | 67                    | 0                                       | 67                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 717             | KZT 2 543 105      | 579                   | 0                                       | 579                 | 0,02   |
|              | 07/2026           |                 | 188               | NOK 1 748          | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 8 375             | PEN 28 325         | 0                     | (72)                                    | (72)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 219               | PLN 811            | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 142 891           | \$ 8 827           | 123                   | 0                                       | 123                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | KZT             | 1 651 468         | 3 419              | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
| GLM          | 08/2026           | \$              | 121               | INR 11 340         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 45 393            | \$ 13 376          | 108                   | (2)                                     | 106                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 2 495             | INR 237 167        | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 516             | KZT 769 218        | 58                    | 0                                       | 58                  | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 074             | PEN 3 654          | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 10/2026           | PEN             | 31 907            | \$ 9 223           | 0                     | (91)                                    | (91)                | 0,00   |
|              | 11/2026           | KZT             | 651 320           | 1 315              | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 12/2026           | \$              | 381               | KZT 200 406        | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 29                | \$ 20              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 14 539            | 19 551             | 254                   | 0                                       | 254                 | 0,01   |
| GLM          | 07/2026           | SGD             | 254               | 199                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 23 527            | € 20 460           | 16                    | (151)                                   | (135)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 32                | HUF 9 835          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 785               | PLN 2 888          | 0                     | (17)                                    | (17)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 203 564           | \$ 12 335          | 0                     | (65)                                    | (65)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | COP             | 6 894 357         | 1 826              | 0                     | (158)                                   | (158)               | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 5 723             | 6 536              | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 20                | AUD 29             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | INR             | 4 607             | \$ 48              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 536               | 158                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| GLM          | 07/2026           | BRL             | 18                | 3                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | DOP             | 61 994            | 1 022              | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 13 380            | BRL 78 886         | 0                     | (56)                                    | (56)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 625               | CAD 889            | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 23 443            | COP 81 586 878     | 157                   | (46)                                    | 111                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | BRL             | 78 886            | € 13 259           | 57                    | 0                                       | 57                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 888               | \$ 625             | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | DOP             | 129 023           | 2 160              | 17                    | 0                                       | 17                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | INR             | 250               | 3                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 8 239             | BRL 42 054         | 0                     | (177)                                   | (177)               | (0,01) |
| GLM          | 09/2026           | COP             | 7 209 194         | \$ 2 065           | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | DOP             | 158 945           | 2 657              | 27                    | (2)                                     | 25                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 493 607           | 27                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 09/2026           | INR 4 238       | \$ 44             | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 81          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 970          | BRL 4 994         | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 648             | CLP 579 364       | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 187           | THB 38 317        | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | DOP 16 498      | \$ 277            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 76 589 352  | 21 350            | 25                 | (163)                 | (138)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | DOP 270 652     | 4 451             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | 29 331          | 491               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | \$ 75           | HUF 22 952        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 783         | \$ 547            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 89 896      | 17 469            | 101                | 0                     | 101                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | EGP 129 218     | 2 094             | 0                  | (511)                 | (511)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | HUF 399 131     | 1 305             | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT 62 528      | 131               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 4 953       | 500               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 368          | EGP 19 504        | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 420             | PLN 1 531         | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 547             | AUD 783           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 500             | NOK 4 956         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 482         | \$ 5              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | TWD 2 583       | 82                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 308        | MXN 40 095        | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 626             | THB 20 224        | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
| MBC          | 10/2026           | 17 469          | BRL 91 875        | 0                  | (101)                 | (101)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 14          | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 925         | 1 181             | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 9 233 396   | 2 437             | 0                  | (228)                 | (228)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | € 20 132        | 23 330            | 313                | 0                     | 313                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | INR 236 502     | 2 504             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 597       | 161               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 181        | € 2 741           | 0                  | (47)                  | (47)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 147           | £ 1 599           | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 924           | INR 860 231       | 149                | 0                     | 149                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 24 662          | KRW 37 385 193    | 0                  | (515)                 | (515)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 448             | NOK 4 155         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 527           | \$ 602            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9            | AUD 14            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 161             | NOK 1 598         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP 17 106      | \$ 307            | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 1 215       | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 504        | INR 238 104       | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | CHF 6           | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 97            | 111               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 20            | 26                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 628          | AUD 900           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 567           | CHF 1 244         | 0                  | (25)                  | (25)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 047           | € 1 774           | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 435             | £ 328             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 9 025           | INR 868 223       | 139                | 0                     | 139                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 610             | TRY 28 730        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 104 560     | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | COP 7 209 194   | 1 871             | 0                  | (209)                 | (209)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | KZT 867 155     | 1 793             | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 6 923       | 2 020             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 350        | KZT 1 807 320     | 419                | 0                     | 419                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | INR 620         | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP 70 874      | 1 380             | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 268 923     | 15                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 74 570      | 148               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 793        | KZT 888 544       | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 430             | THB 13 888        | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 3 109         | RON 16 402        | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 485 541         | \$ 566 403        | 11 285             | 0                     | 11 285                                  | 0,33                |
|              | 07/2026           | \$ 560 333      | € 492 600         | 2 858              | 0                     | 2 858                                   | 0,08                |
|              | 07/2026           | 197             | SGD 254           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 492 600       | \$ 561 093        | 0                  | (2 853)               | (2 853)                                 | (0,08)              |
|              | 08/2026           | SGD 254         | 197               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF 600         | 752               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6            | CAD 8             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19 897          | £ 15 052          | 81                 | 0                     | 81                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 8           | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 15 052        | 19 897            | 0                  | (81)                  | (81)                                    | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | \$ 222          | PLN 813           | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 8 064 450   | \$ 2 135          | 0                  | (186)                 | (186)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 19 312 202      | 5 278             | 0                  | (226)                 | (226)                                   | (0,01)              |
|              | 10/2026           | HUF 999 808     | € 2 690           | 0                  | (110)                 | (110)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | 1 225 182       | 3 399             | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$ 347          | CHF 280           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 279         | \$ 347            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 21 055          | \$ (16 704)           | \$ 4 351                                | 0,13                |

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

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et Institutions H en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 317          | CHF 256           | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CHF 201         | \$ 255            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 189          | CHF 150           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 230 398         | 179 876           | 0                  | (7 407)               | (7 407)                                 | (0,21)              |
|              | 08/2026           | 243 090         | 195 765           | 475                | 0                     | 475                                     | 0,01                |
| MBC          | 07/2026           | CHF 263         | \$ 327            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 278 634      | CHF 218 251       | 1                  | (8 071)               | (8 070)                                 | (0,23)              |
| MYI          | 08/2026           | 259             | 208               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | 238 876         | 192 699           | 875                | 0                     | 875                                     | 0,02                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 203 486     | \$ 251 523        | 0                  | (738)                 | (738)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 251 523      | CHF 202 756       | 740                | 0                     | 740                                     | 0,02                |
| SSB          | 07/2026           | 248 723         | 195 520           | 0                  | (6 338)               | (6 338)                                 | (0,18)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 099           | \$ (22 556)           | \$ (20 457)                             | (0,59)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et Institutions H en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 11 619       | € 9 983           | \$ 0               | \$ (206)              | \$ (206)                                | (0,01)              |
| BPS          | 07/2026           | € 2 324         | \$ 2 645          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 441 696      | € 379 138         | 1                  | (8 230)               | (8 229)                                 | (0,24)              |
| BSH          | 07/2026           | € 2 613         | \$ 3 039          | 52                 | 0                     | 52                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 419 795      | € 360 050         | 0                  | (8 151)               | (8 151)                                 | (0,23)              |
| CBK          | 07/2026           | 10 056          | 8 621             | 0                  | (199)                 | (199)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | € 361 870       | \$ 412 712        | 0                  | (1 014)               | (1 014)                                 | (0,03)              |
|              | 08/2026           | \$ 413 268      | € 361 870         | 1 013              | 0                     | 1 013                                   | 0,03                |
| MBC          | 07/2026           | € 394 690       | \$ 448 437        | 98                 | (2 910)               | (2 812)                                 | (0,08)              |
|              | 07/2026           | \$ 14 709       | € 12 691          | 0                  | (199)                 | (199)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 111           | \$ 127            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 441 240      | € 387 960         | 2 910              | 0                     | 2 910                                   | 0,08                |
| SOG          | 07/2026           | € 387 960       | \$ 441 304        | 0                  | (2 251)               | (2 251)                                 | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$ 442 086      | € 378 972         | 0                  | (8 806)               | (8 806)                                 | (0,25)              |
|              | 08/2026           | 441 903         | 387 960           | 2 247              | 0                     | 2 247                                   | 0,07                |
|              |                   |                 |                   | \$ 6 321           | \$ (31 978)           | \$ (25 657)                             | (0,74)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 7 918        | £ 5 898           | \$ 0               | \$ (90)               | \$ (90)                                 | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | 3               | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 5 270         | \$ 6 950          | 0                  | (44)                  | (44)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 624        | £ 6 436           | 0                  | (82)                  | (82)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 6 884           | 5 220             | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 55            | \$ 74             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 177          | £ 132             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 4             | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 412        | £ 6 256           | 0                  | (109)                 | (109)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 6               | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 40              | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £ 40            | \$ 54             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 1 201           | £ 1 581           | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 581        | £ 1 201           | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 6 091         | \$ 8 062          | 0                  | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 46           | £ 34              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 8 044           | 6 077             | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 6 054         | \$ 7 997          | 0                  | (38)                  | (38)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 997        | £ 6 054           | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 50            | \$ 67             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 67           | £ 50              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 119             | \$ (400)              | \$ (281)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | NOK 13          | \$ 1              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 209          | NOK 1 937         | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | NOK 30          | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 6               | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 12              | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 124          | NOK 1 147         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 150             | 1 389             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | NOK 18          | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 1 448           | 146               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 146          | NOK 1 449         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NOK 1 876       | \$ 189            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 132          | NOK 1 227         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 6           | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 187          | NOK 1 859         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | NOK 38          | \$ 4              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | NOK 16            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 3               | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (40)               | \$ (39)                                 | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Investisseurs en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 439          | SEK 4 057         | \$ 0               | \$ (19)               | \$ (19)                                 | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | SEK 43          | \$ 5              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 489          | SEK 4 521         | 0                  | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SEK 2 603       | \$ 268            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 268          | SEK 2 598         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 3 931       | \$ 404            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 469          | SEK 4 360         | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 404             | 3 924             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | SEK 113         | \$ 12             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3               | \$ (63)               | \$ (60)                                 | 0,00                |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (44 393) (1,28)

| DESCRIPTION                                                                       | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                                   |                               |                            |                     |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>5,950 % éch. 15/04/2030 <sup>(h)</sup> | \$ 3 900                      | \$ 234                     | 0,01                |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                                        | 2 100                         | 740                        | 0,02                |
| MMK International Capital DAC<br>4,375 % éch. 13/06/2024 <sup>^</sup>             | 2 800                         | 168                        | 0,01                |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC<br>3,400 % éch. 26/01/2025 <sup>^</sup>         | 5 400                         | 146                        | 0,00                |
| Total des Autres actifs financiers                                                |                               | \$ 1 288                   | 0,04                |
| Total des Investissements                                                         |                               | \$ 3 724 301               | 107,49              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                            |                               | \$ (259 489)               | (7,49)              |
| Actif net                                                                         |                               | \$ 3 464 812               | 100,00              |

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

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

<sup>^</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

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

(h) Titre convertible conditionnel.

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

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804 % | 20/04/2033      | 13/04/2026   | \$ 12 100 | \$ 12 080    | 0,35                |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 368 611 \$ (31 décembre 2025 : 380 985 \$) et un montant en numéraire de 2 874 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 23 407 \$ (31 décembre 2025 : 1 228 \$) et un montant en numéraire de 29 074 \$ (31 décembre 2025 : 4 460 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 16 \$ (31 décembre 2025 : 580 \$) et un montant en numéraire de 2 034 \$ (31 décembre 2025 : 2 497 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 66 488 \$ (31 décembre 2025 : 42 977 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 50                                                                              | \$ 3 661 922                                         | \$ 97 061                                         | \$ 3 759 033        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (2 640)                                                                            | (33 380)                                             | 0                                                 | (36 020)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                  | 1 288                                                | 0                                                 | 1 288               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (2 590)</b>                                                                  | <b>\$ 3 629 830</b>                                  | <b>\$ 97 061</b>                                  | <b>\$ 3 724 301</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1                                                                               | \$ 3 619 487                                         | \$ 103 701                                        | \$ 3 723 189        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 2 280                                                                              | 14 230                                               | 0                                                 | 16 510              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                  | 620                                                  | 548                                               | 1 168               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 2 281</b>                                                                    | <b>\$ 3 634 337</b>                                  | <b>\$ 104 249</b>                                 | <b>\$ 3 740 867</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|--------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 3,950 %        | 21/01/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (9 706)       | \$ (9 878)                               | (0,28)              |
| BRC          | 1,950          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (6 903)        | (7 898)                                  | (0,23)              |
|              | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (26 553)         | (30 381)                                 | (0,88)              |
|              | 2,330          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (29 622)         | (33 897)                                 | (0,98)              |
|              | 2,750          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (2 231)       | (2 265)                                  | (0,07)              |
|              | 3,400          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (307)            | (313)                                    | (0,01)              |
|              | 3,500          | 20/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (442)            | (447)                                    | (0,01)              |
|              | 3,950          | 26/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 982)          | (5 035)                                  | (0,14)              |
|              | 3,950          | 22/06/2026        | 31/07/2026         | (10 122)         | (10 132)                                 | (0,29)              |
| DEU          | 3,750          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (2 944)          | (2 944)                                  | (0,08)              |
| MBC          | 2,370          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (42 813)       | (48 993)                                 | (1,41)              |
| MEI          | 3,000          | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (2 544)       | (2 546)                                  | (0,07)              |
| MYI          | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (18 665)       | (21 355)                                 | (0,62)              |
|              | 2,280          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (970)            | (1 110)                                  | (0,03)              |
|              | 2,300          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (6 754)          | (7 729)                                  | (0,22)              |
|              | 2,350          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 194)          | (1 367)                                  | (0,04)              |
|              | 2,750          | 11/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (393)         | (395)                                    | (0,01)              |
|              | 3,250          | 10/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 737)          | (2 757)                                  | (0,08)              |
|              | 3,350          | 17/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 008)          | (2 028)                                  | (0,06)              |
|              | 3,490          | 10/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 573)          | (1 585)                                  | (0,05)              |
|              | 3,500          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 916)          | (2 973)                                  | (0,09)              |
|              | 3,700          | 11/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 242)          | (1 244)                                  | (0,04)              |
| NOM          | 3,400          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 195)          | (2 236)                                  | (0,06)              |
|              | 3,500          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 160)          | (1 182)                                  | (0,03)              |
|              | 3,500          | 06/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 829)          | (4 897)                                  | (0,14)              |
|              | 3,550          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 918)          | (2 976)                                  | (0,09)              |
|              | 3,750          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (15 906)         | (16 239)                                 | (0,47)              |
|              | 3,850          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (7 363)          | (7 521)                                  | (0,22)              |

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance           | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|---------------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| RDR                                    | 4,000 %        | 18/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup>        | \$ (19 201)      | \$ (19 617)                              | (0,57)              |
| SCX                                    | 3,250          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup>        | (183)            | (186)                                    | (0,01)              |
|                                        | 3,250          | 21/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (7 330)          | (7 377)                                  | (0,21)              |
|                                        | 3,350          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (824)            | (828)                                    | (0,02)              |
|                                        | 3,400          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (1 049)          | (1 055)                                  | (0,03)              |
|                                        | 3,500          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup>        | (6 675)          | (6 806)                                  | (0,20)              |
|                                        | 3,500          | 18/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (3 020)          | (3 059)                                  | (0,09)              |
|                                        | 3,650          | 06/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (3 634)          | (3 687)                                  | (0,11)              |
|                                        | 3,650          | 15/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (6 691)          | (6 723)                                  | (0,19)              |
|                                        | 3,800          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup>        | (9 568)          | (9 771)                                  | (0,28)              |
|                                        | 3,900          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup>        | (3 910)          | (3 995)                                  | (0,11)              |
| STR                                    | 3,790          | 30/06/2026        | 01/07/2026 <sup>(1)</sup> | (4 004)          | (4 004)                                  | (0,12)              |
| TDM                                    | 3,770          | 16/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (31 980)         | (32 030)                                 | (0,92)              |
|                                        | 3,850          | 16/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (12 398)         | (12 418)                                 | (0,36)              |
|                                        | 3,900          | 16/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup>        | (10 357)         | (10 374)                                 | (0,30)              |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                           |                  | \$ (354 253)                             | (10,22)             |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (90)                                                    | \$ 0                    | \$ (90)                           | \$ 163                                                     | \$ 0                    | \$ 163                            |
| BOA          | (4 168)                                                    | 4 230                   | 62                                | (120)                                                      | 84                      | (36)                              |
| BPS          | (6 765)                                                    | 7 750                   | 985                               | 4 095                                                      | (4 610)                 | (515)                             |
| BRC          | (296)                                                      | 232                     | (64)                              | 5 081                                                      | (5 720)                 | (639)                             |
| BSH          | (8 054)                                                    | 8 450                   | 396                               | (147)                                                      | 270                     | 123                               |
| BSS          | 21                                                         | 0                       | 21                                | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| CBK          | (4 469)                                                    | 4 598                   | 129                               | (332)                                                      | 298                     | (34)                              |
| DUB          | 902                                                        | (1 170)                 | (268)                             | 192                                                        | 0                       | 192                               |
| FAR          | (7 175)                                                    | 7 880                   | 705                               | 2 857                                                      | (3 160)                 | (303)                             |
| GLM          | (242)                                                      | 223                     | (19)                              | 2 840                                                      | (3 120)                 | (280)                             |
| GST          | 453                                                        | (460)                   | (7)                               | 417                                                        | (410)                   | 7                                 |
| IND          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| JPM          | (730)                                                      | 850                     | 120                               | (1 551)                                                    | 1 510                   | (41)                              |
| MBC          | (8 574)                                                    | 8 986                   | 412                               | 4 986                                                      | (5 430)                 | (444)                             |
| MYC          | (1 807)                                                    | 1 830                   | 23                                | (358)                                                      | 170                     | (188)                             |
| MYI          | (46)                                                       | 6                       | (40)                              | 4                                                          | 164                     | 168                               |
| NSL          | 142                                                        | 0                       | 142                               | 99                                                         | 0                       | 99                                |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (21)                                                       | 0                       | (21)                              |
| SCX          | 1 045                                                      | 0                       | 1 045                             | 410                                                        | (300)                   | 110                               |
| SOG          | 2 505                                                      | (2 630)                 | (125)                             | (2 128)                                                    | 2 420                   | 292                               |
| SSB          | (6 330)                                                    | 6 592                   | 262                               | 17                                                         | 0                       | 17                                |
| UAG          | (714)                                                      | 854                     | 140                               | (691)                                                      | 772                     | 81                                |

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

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 81,21            | 85,15                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 10,39            | 8,59                 |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,86             | 1,02                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,27             | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,51             | 0,41                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,85             | 0,89                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,03             | 0,03                 |
| Autres actifs                                                    | 4,88             | 3,85                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Argentine                         | 3,44             | 3,10                 |
| Autriche                          | S/O              | 0,30                 |
| Bahrein                           | 1,92             | 1,30                 |
| Bénin                             | 0,73             | 0,56                 |
| Bermudes                          | 0,10             | 0,11                 |
| Bolivie                           | 0,26             | S/O                  |
| Bosnie-Herzégovine                | 0,29             | S/O                  |



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

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Brésil                                                                                                   | 3,36             | 3,90                 |
| Bulgarie                                                                                                 | 0,41             | 0,83                 |
| Cameroun                                                                                                 | 0,25             | S/O                  |
| Îles Caïmans                                                                                             | 3,82             | 3,44                 |
| Chili                                                                                                    | 3,75             | 4,13                 |
| Chine                                                                                                    | 0,00             | 0,31                 |
| Colombie                                                                                                 | 3,68             | 4,82                 |
| Costa Rica                                                                                               | 1,70             | 1,26                 |
| Chypre                                                                                                   | 0,25             | 0,26                 |
| République tchèque                                                                                       | 0,25             | 0,26                 |
| République dominicaine                                                                                   | 3,01             | 3,55                 |
| Equateur                                                                                                 | 1,49             | 2,22                 |
| Égypte                                                                                                   | 3,14             | 2,94                 |
| Salvador                                                                                                 | 1,04             | 1,43                 |
| Estonie                                                                                                  | 0,35             | 0,35                 |
| France                                                                                                   | 0,18             | 0,06                 |
| Gabon                                                                                                    | 0,34             | 0,30                 |
| Géorgie                                                                                                  | 0,30             | 0,29                 |
| Ghana                                                                                                    | 1,20             | 1,17                 |
| Guatemala                                                                                                | 0,51             | S/O                  |
| Guernesey, Îles Anglo-Normandes                                                                          | 0,05             | 0,05                 |
| Hong Kong                                                                                                | 1,18             | 1,05                 |
| Hongrie                                                                                                  | 2,92             | 2,83                 |
| Inde                                                                                                     | 1,84             | 1,61                 |
| Indonésie                                                                                                | 2,25             | 1,78                 |
| Internationales                                                                                          | 0,08             | 0,11                 |
| Irlande                                                                                                  | 1,26             | 1,27                 |
| Côte d'Ivoire                                                                                            | 2,25             | 2,51                 |
| Jamaïque                                                                                                 | 0,09             | 0,09                 |
| Japon                                                                                                    | S/O              | 0,10                 |
| Jordanie                                                                                                 | 0,22             | 0,22                 |
| Kazakhstan                                                                                               | 0,44             | 0,59                 |
| Kenya                                                                                                    | 1,03             | 1,18                 |
| Koweït                                                                                                   | 0,35             | S/O                  |
| Kirghizistan                                                                                             | 0,15             | S/O                  |
| Lettonie                                                                                                 | 0,90             | 0,49                 |
| Lituanie                                                                                                 | 0,16             | S/O                  |
| Luxembourg                                                                                               | 1,01             | 0,96                 |
| Macédoine du Nord                                                                                        | 0,05             | 0,06                 |
| Malaisie                                                                                                 | 0,31             | 0,31                 |
| Île Maurice                                                                                              | 0,26             | 0,27                 |
| Mexique                                                                                                  | 4,24             | 3,89                 |
| Mongolie                                                                                                 | 0,41             | 0,33                 |
| Maroc                                                                                                    | 0,72             | 0,46                 |
| Multinationales                                                                                          | 0,01             | 0,01                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 0,78             | 0,36                 |
| Nigeria                                                                                                  | 0,47             | 0,47                 |
| Oman                                                                                                     | 1,39             | 1,51                 |
| Pakistan                                                                                                 | 0,36             | 0,20                 |
| Panama                                                                                                   | 1,59             | 1,95                 |
| Paraguay                                                                                                 | 0,87             | 0,90                 |
| Pérou                                                                                                    | 4,19             | 3,55                 |
| Philippines                                                                                              | 1,54             | 1,58                 |
| Pologne                                                                                                  | 1,50             | 1,38                 |
| Qatar                                                                                                    | 0,14             | 1,24                 |
| Roumanie                                                                                                 | 2,98             | 3,77                 |
| Arabie saoudite                                                                                          | 0,47             | 0,47                 |
| Sénégal                                                                                                  | 0,62             | 0,80                 |
| Serbie                                                                                                   | 2,06             | 2,16                 |
| Singapour                                                                                                | 0,01             | 0,01                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 2,76             | 2,65                 |
| Corée du Sud                                                                                             | 2,87             | 3,65                 |
| Sri Lanka                                                                                                | 1,48             | 0,99                 |
| Supranationales                                                                                          | 0,85             | 1,06                 |
| Suriname                                                                                                 | 0,35             | 0,15                 |
| Tanzanie                                                                                                 | 0,13             | 0,35                 |
| Thaïlande                                                                                                | S/O              | 0,20                 |
| Trinité-et-Tobago                                                                                        | 0,13             | 0,13                 |
| Turquie                                                                                                  | 2,22             | 2,81                 |
| Ukraine                                                                                                  | 1,87             | 1,70                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 5,00             | 3,10                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 0,37             | 0,28                 |
| États-Unis                                                                                               | 7,19             | 7,00                 |
| Uruguay                                                                                                  | 0,84             | 1,00                 |
| Ouzbékistan                                                                                              | 1,44             | 1,33                 |
| Îles Vierges britanniques                                                                                | 0,14             | 0,15                 |
| Zambie                                                                                                   | 0,00             | 0,12                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 3,93             | 3,10                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,21             | (0,05)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,03             | 0,07                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | S/O                  |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,03)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,03)           | (0,03)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,13             | (0,25)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,34)           | 0,76                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,04             | 0,03                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (7,49)           | (7,69)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIIONS                                       |                                     |                                  |                           | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.<br>9,700 % éch. 05/03/2045<br>10,100 % éch. 15/12/2043                  | PEN<br>1 400<br>1 082               | \$<br>440<br>349                 | 0,27<br>0,22              | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature)<br>7,721 % éch. 28/12/2028 (b) | \$<br>65                            | \$<br>1                          | 0,00                      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           | DAE Sukuk Diftc Ltd.<br>4,500 % éch. 16/10/2030                                                                      | \$<br>800                           | 771                              | 0,48                      | KFH Sukuk Co.<br>5,376 % éch. 14/01/2030                                                                             | 300                                 | 304                              | 0,19                      |
| République de Côte d'Ivoire<br>5,185 % éch. 05/03/2027                 | €<br>800                            | \$<br>918                        | 0,57                      | Danantara Investment Management PT<br>5,350 % éch. 18/06/2031<br>5,950 % éch. 18/06/2036                             | 300<br>300                          | 300<br>299                       | 0,19<br>0,19              | Kookmin Bank<br>2,500 % éch. 04/11/2030 (h)                                                                          | 1 100                               | 997                              | 0,62                      |
| SOCAR Turkey Enerji A/S<br>5,558 % éch. 11/08/2026                     | 1 000                               | 1 142                            | 0,71                      | Emaar Sukuk Ltd.<br>3,635 % éch. 15/09/2026                                                                          | 950                                 | 948                              | 0,59                      | Longfor Group Holdings Ltd.<br>4,500 % éch. 16/01/2028                                                               | 200                                 | 177                              | 0,11                      |
| State Oil, Inc.<br>TBD % éch. 24/03/2031                               | \$<br>1 000                         | 989                              | 0,62                      | Emirates NBD Bank PJSC<br>4,195 % éch. 13/01/2029                                                                    | 400                                 | 394                              | 0,25                      | Luminis S.A.<br>9,649 % éch. 15/09/2038                                                                              | 500                                 | 584                              | 0,36                      |
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.<br>5,401 % éch. 15/12/2028             | €<br>1 000                          | 1 148                            | 0,71                      | 5,125 % éch. 29/06/2031                                                                                              | 800                                 | 800                              | 0,50                      | mBank S.A.<br>4,778 % éch. 25/09/2035                                                                                | €<br>100                            | 117                              | 0,07                      |
| Veon Amsterdam<br>7,924 % éch. 25/03/2027                              | \$<br>500                           | 499                              | 0,31                      | Emlak Konut Varlık Kiralama A/S<br>7,750 % éch. 01/06/2031                                                           | 400                                 | 400                              | 0,25                      | Mizrahi Tefahot Bank Ltd.<br>5,049 % éch. 28/01/2031                                                                 | \$<br>400                           | 397                              | 0,25                      |
|                                                                        |                                     | 5 154                            | 3,21                      | Esic Sukuk Ltd.<br>5,831 % éch. 14/02/2029                                                                           | 400                                 | 405                              | 0,25                      | Muthoot Finance Ltd.<br>5,750 % éch. 04/08/2030                                                                      | 400                                 | 392                              | 0,24                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                          |                                     |                                  |                           | Fab Sukuk Co. Ltd.<br>5,153 % éch. 16/01/2030                                                                        | 900                                 | 909                              | 0,57                      | 6,375 % éch. 23/04/2029                                                                                              | 300                                 | 301                              | 0,19                      |
| BANQUE ET FINANCE                                                      |                                     |                                  |                           | Far East Horizon Ltd.<br>5,250 % éch. 13/01/2029<br>5,875 % éch. 05/03/2028                                          | 500<br>500                          | 495<br>504                       | 0,31<br>0,31              | Nan Fung Treasury Ltd.<br>5,750 % éch. 21/05/2036                                                                    | 800                                 | 800                              | 0,50                      |
| Akbank TAS<br>7,498 % éch. 20/01/2030                                  | 1 153                               | 1 187                            | 0,74                      | FIBRA Prologis<br>5,500 % éch. 26/11/2035                                                                            | 650                                 | 632                              | 0,39                      | NBK SPC Ltd.<br>1,625 % éch. 15/09/2027                                                                              | 1 000                               | 993                              | 0,62                      |
| Alpha Star Holding Ltd.<br>7,000 % éch. 26/08/2028                     | 1 100                               | 1 091                            | 0,68                      | First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,789 % éch. 03/06/2031                                                                 | 600                                 | 601                              | 0,37                      | Omniyat Sukuk Ltd.<br>7,250 % éch. 04/03/2031                                                                        | 500                                 | 468                              | 0,29                      |
| Ardshinbank CJSC Via Dilijan Finance BV<br>6,600 % éch. 22/01/2031     | 800                                 | 799                              | 0,50                      | Fubon Life Singapore Pte. Ltd.<br>5,450 % éch. 10/12/2035                                                            | 300                                 | 297                              | 0,18                      | OTP Bank Nyrt<br>8,750 % éch. 15/05/2033                                                                             | 200                                 | 210                              | 0,13                      |
| Avilease Capital Ltd.<br>4,750 % éch. 12/11/2030                       | 800                                 | 783                              | 0,49                      | FWD Group Holdings Ltd.<br>5,836 % éch. 22/09/2035                                                                   | 300                                 | 301                              | 0,19                      | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC<br>0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                                        | 200                                 | 163                              | 0,10                      |
| Azule Energy Finance PLC<br>8,125 % éch. 23/01/2030                    | 800                                 | 805                              | 0,50                      | Gaci First Investment Co.<br>6,250 % éch. 14/05/2056                                                                 | 1 400                               | 1 402                            | 0,87                      | Piramal Finance Ltd.<br>7,800 % éch. 29/01/2028                                                                      | 400                                 | 408                              | 0,25                      |
| 8,250 % éch. 22/01/2031                                                | 750                                 | 751                              | 0,47                      | GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % éch. 20/05/2028                                                                             | 500                                 | 424                              | 0,26                      | QNB Bank A/S<br>5,875 % éch. 11/02/2031                                                                              | 800                                 | 779                              | 0,48                      |
| 8,625 % éch. 22/01/2033                                                | 400                                 | 401                              | 0,25                      | Gohl Capital Holdings Ltd.<br>7,625 % éch. 29/10/2031 (f)                                                            | 200                                 | 194                              | 0,12                      | QNB Finance Ltd.<br>4,500 % éch. 24/07/2030                                                                          | 1 000                               | 990                              | 0,62                      |
| Banco Davivienda S.A.<br>8,125 % éch. 02/07/2035 (h)                   | 800                                 | 830                              | 0,52                      | 8,300 % éch. 29/04/2036 (f)                                                                                          | 200                                 | 193                              | 0,12                      | 4,538 % éch. 19/09/2027                                                                                              | 400                                 | 400                              | 0,25                      |
| Banco de Chile<br>2,990 % éch. 09/12/2031                              | 600                                 | 546                              | 0,34                      | Golomt Bank<br>7,950 % éch. 14/05/2029                                                                               | 600                                 | 604                              | 0,38                      | 4,679 % éch. 27/04/2029                                                                                              | 600                                 | 603                              | 0,38                      |
| Banco de Credito del Peru S.A.<br>5,800 % éch. 10/03/2035              | 800                                 | 808                              | 0,50                      | Greentown China Holdings Ltd.<br>7,000 % éch. 19/05/2029                                                             | 600                                 | 584                              | 0,36                      | REC Ltd.<br>5,625 % éch. 11/04/2028                                                                                  | 900                                 | 909                              | 0,57                      |
| Banco do Brasil S.A.<br>5,625 % éch. 23/10/2031                        | 400                                 | 397                              | 0,25                      | 8,450 % éch. 24/02/2028                                                                                              | 700                                 | 705                              | 0,44                      | Sammaan Capital Ltd.<br>9,700 % éch. 03/07/2027                                                                      | 400                                 | 412                              | 0,26                      |
| 8,500 % éch. 29/07/2026                                                | MXN<br>13 000                       | 746                              | 0,46                      | GSG Bidco Ltd.<br>4,700 % éch. 15/06/2031                                                                            | €<br>100                            | 113                              | 0,07                      | Shinhan Bank Co. Ltd.<br>4,500 % éch. 26/03/2028 (h)                                                                 | 300                                 | 299                              | 0,19                      |
| Banco Internacional del Peru SAA Interbank<br>4,800 % éch. 15/07/2031  | \$<br>1 100                         | 1 081                            | 0,67                      | HDFC Bank Ltd.<br>5,067 % éch. 24/06/2031                                                                            | \$<br>800                           | 800                              | 0,50                      | Shinhan Financial Group Co. Ltd.<br>5,000 % éch. 24/07/2028                                                          | 200                                 | 201                              | 0,13                      |
| Banco Mercantil del Norte S.A.<br>7,625 % éch. 10/01/2028 (f)(h)       | 200                                 | 201                              | 0,13                      | ICBC Bank Ltd.                                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 24/01/2033 (f)(h)                                         | 500                                 | 501                              | 0,31                      | 5,067 % éch. 24/06/2031                                                                                              | \$<br>800                           | 800                              | 0,50                      | Sobha Sukuk Holding Ltd.<br>7,996 % éch. 19/02/2029                                                                  | 800                                 | 801                              | 0,50                      |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC<br>6,000 % éch. 14/05/2036     | 300                                 | 298                              | 0,19                      | Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.<br>9,620 % éch. 28/06/2018                                                        | MXN<br>34 709                       | 0                                | 0,00                      | SRC Sukuk Ltd.<br>5,000 % éch. 27/02/2028                                                                            | 700                                 | 702                              | 0,44                      |
| Banco Nacional de Mexico S.A.<br>6,697 % éch. 07/08/2036 (h)(i)        | 800                                 | 789                              | 0,49                      | ICBC Standard Bank PLC<br>20,000 % éch. 18/09/2029                                                                   | UZS<br>11 876 000                   | 988                              | 0,61                      | Standard Chartered PLC<br>7,767 % éch. 16/11/2028                                                                    | 700                                 | 729                              | 0,45                      |
| Banco Santander Chile<br>4,550 % éch. 20/11/2030                       | 800                                 | 789                              | 0,49                      | IFIL Finance Ltd.<br>7,600 % éch. 10/09/2029                                                                         | \$<br>400                           | 402                              | 0,25                      | TT Varlık Kiralama A/S<br>6,500 % éch. 30/10/2030                                                                    | 1 200                               | 1 190                            | 0,74                      |
| Bank Hapoalim B.M.<br>3,255 % éch. 21/01/2032 (h)                      | 400                                 | 397                              | 0,25                      | 8,750 % éch. 24/07/2028                                                                                              | 400                                 | 412                              | 0,26                      | Türkiye İş Bankası A/S<br>7,750 % éch. 12/06/2029                                                                    | 400                                 | 416                              | 0,26                      |
| 3,252 % éch. 14/01/2033                                                | 800                                 | 792                              | 0,49                      | Industrial Subordinated Trust 2.0<br>6,550 % éch. 15/04/2036                                                         | 400                                 | 406                              | 0,25                      | UBS Group AG<br>6,875 % éch. 05/06/2032 (f)(h)                                                                       | 800                                 | 803                              | 0,50                      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>5,343 % éch. 29/06/2029                   | 400                                 | 402                              | 0,25                      | InRetail Shopping Malls<br>5,650 % éch. 16/10/2032                                                                   | 700                                 | 693                              | 0,43                      | Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % en espèces ou 15,000 % en PIK)<br>15,000 % éch. 31/12/2044 ^ (b)       | 673                                 | 13                               | 0,01                      |
| 5,642 % éch. 29/06/2033                                                | 400                                 | 402                              | 0,25                      | Iridium Capital PLC<br>9,250 % éch. 18/06/2029                                                                       | €<br>500                            | 621                              | 0,39                      | Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.<br>3,500 % éch. 12/11/2029                                                      | 200                                 | 86                               | 0,05                      |
| 7,129 % éch. 18/07/2033 (h)                                            | 400                                 | 411                              | 0,26                      | Kaisa Group Holdings Ltd.<br>5,000 % éch. 30/11/2027                                                                 | \$<br>12                            | 1                                | 0,00                      | VD DPR Finance Co.<br>6,833 % éch. 15/03/2035                                                                        | 600                                 | 614                              | 0,38                      |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT<br>5,250 % éch. 10/04/2031                 | 400                                 | 399                              | 0,25                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature)<br>6,250 % éch. 28/12/2028 (b) | 95                                  | 2                                | 0,00                      | WE Soda Investments Holding PLC<br>9,375 % éch. 14/02/2031 (j)                                                       | 500                                 | 489                              | 0,30                      |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT<br>7,150 % éch. 22/10/2031 (f)(h) | 200                                 | 200                              | 0,12                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature)<br>6,500 % éch. 28/12/2029 (b) | 159                                 | 4                                | 0,00                      | Yango Justice International Ltd.<br>7,500 % éch. 17/02/2025 ^                                                        | 400                                 | 0                                | 0,00                      |
| Bank of East Asia Ltd.<br>5,375 % éch. 13/05/2032                      | 800                                 | 802                              | 0,50                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature)<br>6,750 % éch. 28/12/2030 (b) | 192                                 | 3                                | 0,00                      | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^                                                                                            | 200                                 | 0                                | 0,00                      |
| Banque Ouest Africaine de Développement<br>6,250 % éch. 14/10/2040     | €<br>100                            | 442                              | 0,28                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature)<br>7,000 % éch. 28/12/2031 (b) | 289                                 | 5                                | 0,00                      | Yapi ve Kredi Bankası A/S<br>7,125 % éch. 10/10/2029                                                                 | 300                                 | 305                              | 0,19                      |
| BBVA Bancomer S.A.<br>5,125 % éch. 18/01/2033 (h)                      | \$<br>450                           | 304                              | 0,19                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature)<br>7,250 % éch. 28/12/2032 (b) | 272                                 | 5                                | 0,00                      | 9,250 % éch. 16/10/2028                                                                                              | 300                                 | 320                              | 0,20                      |
| Blue Owl Capital Corp.<br>6,450 % éch. 15/09/2028                      | 300                                 |                                  |                           |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                                                      |                                     | 52 614                           | 32,76                     |
| CFAMC Co. Ltd.<br>3,375 % éch. 24/02/2030                              | 200                                 | 190                              | 0,12                      |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           | INDUSTRIE                                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| CIMA Finance DAC<br>2,950 % éch. 05/09/2029                            | 190                                 | 181                              | 0,11                      |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Abu Dhabi Future Energy Co. PJSC Masdar<br>4,875 % éch. 21/05/2030                                                   | 400                                 | 400                              | 0,25                      |
|                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 25/07/2033                                                                                              | 700                                 | 689                              | 0,43                      |

| DESCRIPTION                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Adani Electricity Mumbai Ltd.<br>3,949 % éch. 12/02/2030                            | \$ 749                              | \$ 704                           | 0,44                      | 5,250 % éch. 24/05/2049                                                   | \$ 300                              | \$ 205                           | 0,13                      | Rede D'or Finance SARL<br>6,550 % éch. 28/04/2036                                | \$ 600                              | \$ 582                           | 0,36                      |
| Aegea Finance SARL<br>7,625 % éch. 20/01/2036                                       | 500                                 | 414                              | 0,26                      | GSG Bidco Ltd.<br>5,375 % éch. 15/06/2036                                 | € 100                               | 113                              | 0,07                      | ReNew Pvt Ltd.<br>5,875 % éch. 05/03/2027                                        | 700                                 | 699                              | 0,44                      |
| Alpek S.A.B. de C.V.<br>3,250 % éch. 25/02/2031                                     | 500                                 | 438                              | 0,27                      | Health & Happiness International Holdings Ltd.<br>9,125 % éch. 24/07/2028 | \$ 400                              | 420                              | 0,26                      | San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,750 % éch. 12/06/2029 (f)            | 700                                 | 710                              | 0,44                      |
| Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S<br>3,375 % éch. 29/06/2028               | 200                                 | 187                              | 0,12                      | ICL Group Ltd.<br>6,036 % éch. 16/06/2036                                 | 600                                 | 600                              | 0,37                      | Sasol Financing USA LLC<br>5,500 % éch. 18/03/2031                               | 300                                 | 280                              | 0,17                      |
| Avianca Midco PLC<br>9,000 % éch. 01/12/2028                                        | 338                                 | 347                              | 0,22                      | Indika Energy Tbk PT<br>8,750 % éch. 07/05/2029                           | 400                                 | 405                              | 0,25                      | 8,750 % éch. 10/04/2033                                                          | 800                                 | 829                              | 0,52                      |
| 9,500 % éch. 28/01/2031                                                             | 300                                 | 296                              | 0,18                      | Invepar Holdings LLC<br>1,000 % éch. 31/12/2049 (i)                       | 210                                 | 0                                | 0,00                      | Saudi Arabian Oil Co.<br>4,750 % éch. 02/06/2030                                 | 800                                 | 797                              | 0,50                      |
| 10,250 % éch. 07/01/2032 (a)                                                        | 700                                 | 700                              | 0,44                      | Ivanhoe Mines Ltd.<br>7,875 % éch. 23/01/2030                             | 500                                 | 506                              | 0,31                      | Sibanye-Stillwater UK Financing PLC<br>6,250 % éch. 15/11/2031                   | 800                                 | 792                              | 0,49                      |
| Azul Secured Finance LLP<br>9,875 % éch. 15/02/2031                                 | 400                                 | 384                              | 0,24                      | Kaspi.KZ JSC<br>6,250 % éch. 26/03/2030                                   | 800                                 | 810                              | 0,50                      | Sigma Foods S.A.B. de C.V.<br>6,875 % éch. 25/03/2044                            | 400                                 | 425                              | 0,26                      |
| Bidvest Group UK PLC<br>6,200 % éch. 17/09/2032                                     | 600                                 | 607                              | 0,38                      | KazMunayGas National Co. JSC<br>6,375 % éch. 24/10/2048                   | 415                                 | 418                              | 0,26                      | SK Hynix, Inc.<br>2,375 % éch. 19/01/2031                                        | 800                                 | 724                              | 0,45                      |
| Braskem Netherlands Finance BV<br>4,500 % éch. 10/01/2028                           | 300                                 | 185                              | 0,12                      | Kosmos Energy Ltd.<br>8,750 % éch. 01/10/2031                             | 200                                 | 164                              | 0,10                      | 6,375 % éch. 17/01/2028                                                          | 400                                 | 410                              | 0,26                      |
| 8,000 % éch. 15/10/2034                                                             | 200                                 | 120                              | 0,07                      | Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % éch. 08/08/2029                          | 800                                 | 773                              | 0,48                      | Sociedad Transmisora Metropolitana SpA<br>6,385 % éch. 15/12/2055                | 800                                 | 817                              | 0,51                      |
| Burjeel Sukuk Ltd.<br>7,000 % éch. 01/07/2031 (a)                                   | 400                                 | 402                              | 0,25                      | 6,000 % éch. 15/08/2029                                                   | 900                                 | 925                              | 0,58                      | Suzano Austria GmbH<br>3,750 % éch. 15/01/2031                                   | 1 500                               | 1 410                            | 0,88                      |
| Caja de Compensacion de Asignacion Familiar de Los Andes<br>7,000 % éch. 30/07/2029 | 400                                 | 420                              | 0,26                      | Latam Airlines Group S.A.<br>7,625 % éch. 07/01/2031                      | 800                                 | 831                              | 0,52                      | Telecommunications Co. Telekom Srbija AD Belgrade<br>6,750 % éch. 18/05/2033     | € 500                               | 588                              | 0,37                      |
| Cas Capital Ltd.<br>6,250 % éch. 13/01/2031 (f)                                     | 800                                 | 805                              | 0,50                      | Latvenergo A/S<br>3,612 % éch. 13/11/2030                                 | € 100                               | 114                              | 0,07                      | 7,250 % éch. 18/05/2031                                                          | \$ 600                              | 599                              | 0,37                      |
| Cemex S.A.B. de C.V.<br>5,750 % éch. 05/06/2036                                     | 800                                 | 798                              | 0,50                      | Leviathan Bond Ltd.<br>6,500 % éch. 30/06/2027                            | \$ 400                              | 402                              | 0,25                      | Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.<br>3,250 % éch. 15/08/2030         | 900                                 | 836                              | 0,52                      |
| China Modern Dairy Holdings Ltd.<br>2,125 % éch. 14/07/2026                         | 600                                 | 589                              | 0,37                      | Li & Fung Ltd.<br>8,375 % éch. 05/02/2029                                 | 400                                 | 410                              | 0,26                      | 4,100 % éch. 01/10/2046                                                          | 600                                 | 463                              | 0,29                      |
| Consolidated Energy Finance S.A.<br>12,000 % éch. 15/02/2031                        | 600                                 | 622                              | 0,39                      | Medco Cypress Tree Pte. Ltd.<br>8,625 % éch. 19/05/2030                   | 700                                 | 730                              | 0,45                      | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,100 % éch. 01/10/2046            | 600                                 | 463                              | 0,29                      |
| Corp. GEO S.A.B. de C.V.<br>8,875 % éch. 25/09/2014 ^                               | 850                                 | 0                                | 0,00                      | Melco Resorts Finance Ltd.<br>5,750 % éch. 21/07/2028                     | 800                                 | 796                              | 0,50                      | Turkish Airlines Pass-Through Trust<br>4,200 % éch. 15/09/2028                   | 493                                 | 488                              | 0,30                      |
| Corp. Quiport S.A.<br>9,000 % éch. 15/12/2037                                       | 600                                 | 660                              | 0,41                      | MGM China Holdings Ltd.<br>6,250 % éch. 15/05/2033                        | 400                                 | 391                              | 0,24                      | Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % en espèces ou 12,000 % en PIK)<br>11,000 % éch. | 750                                 | 23                               | 0,01                      |
| CSN Inova Ventures<br>6,750 % éch. 28/01/2028                                       | 200                                 | 166                              | 0,10                      | Minerva Luxembourg S.A.<br>7,500 % éch. 22/04/2036                        | 400                                 | 382                              | 0,24                      | Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % en espèces ou 15,000 % en PIK)<br>13,500 % éch. | 335                                 | 20                               | 0,01                      |
| CSN Resources S.A.<br>4,625 % éch. 10/06/2031                                       | 200                                 | 124                              | 0,08                      | Momentive Performance Materials, Inc.<br>4,125 % éch. 22/10/2028          | 200                                 | 198                              | 0,12                      | 31/12/2027 ^ (b)                                                                 | 335                                 | 20                               | 0,01                      |
| Dangote Fertiliser Ltd.<br>7,750 % éch. 05/05/2031                                  | 800                                 | 805                              | 0,50                      | Nakilat, Inc.<br>6,067 % éch. 31/12/2033                                  | 267                                 | 273                              | 0,17                      | Univision Communications, Inc.<br>8,500 % éch. 31/07/2031                        | 400                                 | 402                              | 0,25                      |
| Digicel International Finance Ltd.<br>8,625 % éch. 01/08/2032                       | 550                                 | 567                              | 0,35                      | NAVER Corp.<br>4,375 % éch. 21/04/2031                                    | 400                                 | 396                              | 0,25                      | Uzauto Motors AJ<br>7,375 % éch. 19/11/2030                                      | 400                                 | 406                              | 0,25                      |
| Ecopetrol S.A.<br>4,625 % éch. 02/11/2031                                           | 500                                 | 459                              | 0,29                      | NTT Finance Corp.<br>5,012 % éch. 01/11/2031 (a)                          | 200                                 | 200                              | 0,12                      | Vale S.A.<br>0,000 %                                                             | BRL 6 700                           | 519                              | 0,32                      |
| 5,875 % éch. 28/05/2045                                                             | 400                                 | 331                              | 0,21                      | OAS Restructuring BVI Ltd.<br>5,000 % éch. 31/03/2035                     | BRL 475                             | 5                                | 0,00                      | Vedanta Resources Finance PLC<br>7,000 % éch. 13/07/2032 (a)                     | \$ 400                              | 398                              | 0,25                      |
| 7,750 % éch. 01/02/2032                                                             | 700                                 | 733                              | 0,46                      | 5,125 % éch. 23/06/2051                                                   | \$ 500                              | 405                              | 0,25                      | 7,750 % éch. 13/07/2037 (a)                                                      | 400                                 | 398                              | 0,25                      |
| 8,875 % éch. 13/01/2033                                                             | 300                                 | 329                              | 0,20                      | 6,700 % éch. 01/03/2036                                                   | 500                                 | 523                              | 0,33                      | 10,875 % éch. 17/09/2029                                                         | 500                                 | 532                              | 0,33                      |
| Endeavour Mining PLC<br>7,000 % éch. 28/05/2030                                     | 250                                 | 255                              | 0,16                      | 6,750 % éch. 02/05/2034                                                   | 200                                 | 210                              | 0,13                      | 11,250 % éch. 03/12/2031                                                         | 400                                 | 439                              | 0,27                      |
| Energean Israel Finance Ltd.<br>5,375 % éch. 30/03/2028                             | 500                                 | 495                              | 0,31                      | 6,875 % éch. 25/04/2044                                                   | 500                                 | 510                              | 0,32                      | Volcan Cia Minera SAA<br>8,500 % éch. 28/10/2032                                 | 400                                 | 415                              | 0,26                      |
| First Quantum Minerals Ltd.<br>6,375 % éch. 15/02/2036                              | 400                                 | 393                              | 0,24                      | Orbia Advance Corp. S.A.B. de C.V.<br>2,875 % éch. 11/05/2031             | 400                                 | 333                              | 0,21                      | West China Cement Ltd.<br>9,900 % éch. 04/12/2028                                | 300                                 | 266                              | 0,17                      |
| Ford Otomotiv Sanayi A/S<br>7,125 % éch. 25/04/2029                                 | 200                                 | 203                              | 0,13                      | ORLEN S.A.<br>3,625 % éch. 02/07/2032                                     | € 400                               | 456                              | 0,28                      | YPF S.A.<br>9,500 % éch. 17/01/2031                                              | 400                                 | 425                              | 0,26                      |
| Fortune Star BVI Ltd.<br>8,500 % éch. 19/05/2028                                    | 300                                 | 308                              | 0,19                      | 6,000 % éch. 30/01/2035                                                   | \$ 1 000                            | 1 036                            | 0,64                      | Zhongsheng Group Holdings Ltd.<br>5,980 % éch. 30/01/2028                        | 200                                 | 191                              | 0,12                      |
| Foxconn Far East Ltd.<br>1,875 % éch. 25/08/2028                                    | 300                                 | 283                              | 0,18                      | Parex Resources, Inc.<br>8,500 % éch. 11/05/2031                          | 800                                 | 813                              | 0,51                      |                                                                                  |                                     | 54 073                           | 33,67                     |
| Freeport Indonesia PT<br>6,200 % éch. 14/04/2052                                    | 600                                 | 587                              | 0,37                      | Petroleos del Peru S.A.<br>5,625 % éch. 19/06/2047                        | 400                                 | 286                              | 0,18                      | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS                                                       |                                     |                                  |                           |
| GC Treasury Center Co. Ltd.<br>7,125 % éch. 10/03/2035 (f)                          | 600                                 | 594                              | 0,37                      | Playtika Holding Corp.<br>4,250 % éch. 15/03/2029                         | 154                                 | 138                              | 0,09                      | AES Andes S.A.<br>6,300 % éch. 15/03/2029                                        | 300                                 | 307                              | 0,19                      |
| Gol Finance, Inc.<br>14,375 % éch. 06/06/2030                                       | 400                                 | 393                              | 0,24                      | Promigas S.A. ESP<br>7,750 % éch. 24/06/2056                              | 800                                 | 814                              | 0,51                      | Banco Activer S.A. Institucion de Banca Multiple<br>7,250 % éch. 31/01/2041      | 792                                 | 805                              | 0,50                      |
| Golar LNG Ltd.<br>7,500 % éch. 02/10/2030                                           | 400                                 | 407                              | 0,25                      | Prosus NV<br>4,987 % éch. 19/01/2052                                      | 700                                 | 558                              | 0,35                      | Chile Electricity PEC SpA<br>0,000 % éch. 25/01/2028 (d)                         | 1 384                               | 1 278                            | 0,80                      |
| Green Palm Bidco SARL<br>5,957 % éch. 30/06/2041                                    | 400                                 | 404                              | 0,25                      | QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                                    | 400                                 | 397                              | 0,25                      | COX Asset Mexico S.A. de C.V.<br>7,125 % éch. 08/01/2032                         | 400                                 | 406                              | 0,25                      |
| 6,462 % éch. 30/06/2046                                                             | 400                                 | 405                              | 0,25                      | QatarEnergy LNG<br>5,838 % éch. 30/09/2027                                | 193                                 | 194                              | 0,12                      | 7,750 % éch. 08/05/2036                                                          | 800                                 | 819                              | 0,51                      |
| Grupo Nutresa S.A.<br>8,000 % éch. 12/05/2030                                       | 1 500                               | 1 591                            | 0,99                      | 6,332 % éch. 30/09/2027                                                   | 163                                 | 164                              | 0,10                      | Dhafa Pv2 Energy Co. LLC<br>5,794 % éch. 30/06/2053                              | 800                                 | 793                              | 0,49                      |
| Grupo Televisa S.A.B.<br>5,000 % éch. 13/05/2045                                    | 700                                 | 479                              | 0,30                      | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                 | 800                                 | 798                              | 0,50                      | Energuate Trust 2.0<br>6,350 % éch. 15/09/2035                                   | 800                                 | 797                              | 0,50                      |
|                                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | EnfraGen Energia Sur S.A.<br>5,375 % éch. 30/12/2030                             | 1 089                               | 1 032                            | 0,64                      |
|                                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           | Engie Energia Chile S.A.<br>6,375 % éch. 17/04/2034                              | 300                                 | 314                              | 0,20                      |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| EPH Financing International A/S                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 02/07/2032                                                                       | € 300                               | \$ 350                           | 0,22                      |
| 6,651 % éch. 13/11/2028                                                                       | 300                                 | 365                              | 0,23                      |
| Esentia Energy Development S.A.B. de C.V.                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 30/07/2033                                                                       | \$ 800                              | 799                              | 0,50                      |
| Generadora de Gatun S.A.                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,874 % éch. 30/09/2044                                                                       | 800                                 | 827                              | 0,51                      |
| IHS Holding Ltd.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 29/11/2031                                                                       | 700                                 | 732                              | 0,46                      |
| India Cleantech Energy                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 10/08/2026                                                                       | 82                                  | 82                               | 0,05                      |
| Israel Electric Corp. Ltd.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 14/08/2028                                                                       | 300                                 | 295                              | 0,18                      |
| Millicom International Cellular S.A.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 27/04/2031 (j)                                                                   | 1 300                               | 1 214                            | 0,76                      |
| MM Mirage Bluewater Ltd.                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 29/06/2029                                                                       | 375                                 | 372                              | 0,23                      |
| Niagara Energy SAC                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,746 % éch. 03/10/2034                                                                       | 400                                 | 401                              | 0,25                      |
| Nova Securitisation SARL                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 03/02/2031                                                                       | 400                                 | 386                              | 0,24                      |
| 6,500 % éch. 03/02/2036                                                                       | 200                                 | 188                              | 0,12                      |
| PacifiCorp                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 15/08/2056                                                                       | 600                                 | 596                              | 0,37                      |
| Pampa Energia S.A.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 14/11/2037                                                                       | 800                                 | 820                              | 0,51                      |
| 7,875 % éch. 16/12/2034                                                                       | 500                                 | 518                              | 0,32                      |
| Peru LNG SRL                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 22/03/2030                                                                       | 400                                 | 389                              | 0,24                      |
| Petrobras Global Finance BV                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 10/09/2030                                                                       | 400                                 | 394                              | 0,24                      |
| 6,250 % éch. 10/01/2036                                                                       | 400                                 | 399                              | 0,25                      |
| Rio Oil Finance Trust                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 8,200 % éch. 06/04/2028                                                                       | 433                                 | 445                              | 0,28                      |
| SAEL Ltd.                                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,800 % éch. 31/07/2031                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Telecom Argentina S.A.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 20/01/2036                                                                       | 350                                 | 367                              | 0,23                      |
| Veon Midco BV                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,950 % éch. 01/06/2031                                                                       | 400                                 | 400                              | 0,25                      |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                                                                       | 400                                 | 399                              | 0,25                      |
| Yinson Production Financial Services Pte. Ltd.                                                |                                     |                                  |                           |
| 9,625 % éch. 03/05/2029                                                                       | 900                                 | 954                              | 0,59                      |
|                                                                                               |                                     | <b>18 427</b>                    | <b>11,47</b>              |
| Total des Obligations et billets privés                                                       |                                     | 125 114                          | 77,90                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Alibaba Group Holding Ltd.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 15/09/2032 (d)                                                                   | 450                                 | 400                              | 0,25                      |
| Baidu, Inc.                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 12/03/2032 (d)                                                                   | 400                                 | 355                              | 0,22                      |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.                                                              |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                                                   | 70                                  | 5                                | 0,01                      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2026 (d)                                                                   | 57                                  | 0                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (d)                                                                   | 71                                  | 1                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (d)                                                                   | 113                                 | 1                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (d)                                                                   | 113                                 | 1                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (d)                                                                   | 141                                 | 1                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d)                                                                   | 141                                 | 1                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (d)                                                                   | 246                                 | 1                                | 0,00                      |
|                                                                                               |                                     | <b>766</b>                       | <b>0,48</b>               |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligations du Trésor américain                                                               |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/05/2045                                                                       | 5 400                               | 4 107                            | 2,56                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| Canada Square Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,597 % éch. 17/01/2059                                                                       | £ 65                                | 86                               | 0,05                      |
| Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,993 % éch. 25/10/2035                                                                       | \$ 267                              | 259                              | 0,16                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,583 % éch. 25/08/2036                                                                       | 178                                 | 164                              | 0,10                      |

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Countrywide Alternative Loan Trust                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,394 % éch. 20/12/2035                                             | \$ 36                               | \$ 35                            | 0,02                      |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                   |                                     |                                  |                           |
| 4,309 % éch. 25/11/2037                                             | 24                                  | 23                               | 0,02                      |
|                                                                     |                                     | <b>567</b>                       | <b>0,35</b>               |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| 4,203 % éch. 25/09/2037                                             | 21                                  | 23                               | 0,02                      |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 3,953 % éch. 25/04/2037                                             | 114                                 | 77                               | 0,05                      |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,963 % éch. 25/09/2037                                             | 54                                  | 53                               | 0,03                      |
|                                                                     |                                     | <b>153</b>                       | <b>0,10</b>               |
| <b>PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE</b>                      |                                     |                                  |                           |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 25/05/2036                                             | 296                                 | 143                              | 0,09                      |
|                                                                     |                                     | <b>296</b>                       | <b>0,19</b>               |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement angolais                  |                                     |                                  |                           |
| 9,375 % éch. 31/03/2033                                             | 400                                 | 410                              | 0,25                      |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                  |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                                             | 18                                  | 11                               | 0,01                      |
| Baiterek National Investment Holding JSC                            |                                     |                                  |                           |
| 16,950 % éch. 02/04/2029 KZT                                        | 101 000                             | 215                              | 0,13                      |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                                            | 101 000                             | 217                              | 0,13                      |
| Benin Sukuk S.A.                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 29/01/2033                                             | \$ 300                              | 291                              | 0,18                      |
| TES colombien                                                       |                                     |                                  |                           |
| 11,000 % éch. 22/08/2029 COP                                        | 473 000                             | 133                              | 0,08                      |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                            | 4 219 300                           | 1 202                            | 0,75                      |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain               |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 27/04/2033                                             | € 300                               | 366                              | 0,23                      |
| 6,001 % éch. 16/01/2036                                             | 250                                 | 303                              | 0,19                      |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                                  |                                     |                                  |                           |
| 18,400 % éch. 16/10/2028 KZT                                        | 108 000                             | 235                              | 0,15                      |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 28/10/2035                                             | \$ 400                              | 396                              | 0,25                      |
| 10,500 % éch. 15/03/2037 DOP                                        | 8 000                               | 143                              | 0,09                      |
| 10,750 % éch. 01/06/2036                                            | 8 000                               | 145                              | 0,09                      |
| 11,250 % éch. 15/09/2035                                            | 11 000                              | 205                              | 0,13                      |
| Eagle Funding Luxco SARL                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                                             | \$ 500                              | 503                              | 0,31                      |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien                  |                                     |                                  |                           |
| 19,698 % éch. 14/10/2030 EGP                                        | 18 400                              | 357                              | 0,22                      |
| 21,954 % éch. 04/03/2028                                            | 72 700                              | 1 434                            | 0,89                      |
| Fondo MIVIVIENDA S.A.                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 31/03/2031                                             | \$ 400                              | 403                              | 0,25                      |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït                 |                                     |                                  |                           |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (i)                                         | 400                                 | 399                              | 0,25                      |
| Magyar Export-Import Bank                                           |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 16/05/2029                                             | € 100                               | 122                              | 0,08                      |
| Magyar Fejlesztési Bank Zrt                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 29/06/2028                                             | \$ 200                              | 206                              | 0,13                      |
| National Bank of Uzbekistan                                         |                                     |                                  |                           |
| 19,875 % éch. 05/07/2027 UZS                                        | 2 500 000                           | 220                              | 0,14                      |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                  |                                     |                                  |                           |
| 7,300 % éch. 12/08/2033 PEN                                         | 800                                 | 263                              | 0,16                      |
| Obligation internationale du gouvernement polonais                  |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 11/01/2034                                             | € 40                                | 47                               | 0,03                      |
| 4,125 % éch. 11/01/2044                                             | 40                                  | 46                               | 0,03                      |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                    |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                             | \$ 600                              | 603                              | 0,38                      |
| Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC                    |                                     |                                  |                           |
| 10,750 % éch. 05/02/2029                                            | 181                                 | 186                              | 0,12                      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain              |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 31/01/2037 ZAR                                         | 700                                 | 43                               | 0,03                      |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                             | 19 500                              | 1 233                            | 0,77                      |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                             | 1 500                               | 93                               | 0,06                      |
| Obligation internationale du gouvernement turc                      |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 15/01/2031                                             | \$ 200                              | 197                              | 0,12                      |

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien   |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 01/02/2030                               | \$ 72                               | \$ 52                            | 0,03                      |
| 0,000 % éch. 01/02/2034                               | 268                                 | 152                              | 0,09                      |
| 4,500 % éch. 01/02/2035                               | 377                                 | 262                              | 0,16                      |
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 31/03/2038 ^                             | 70                                  | 31                               | 0,02                      |
| 7,650 % éch. 21/04/2025 ^                             | 70                                  | 31                               | 0,02                      |
| 8,250 % éch. 13/10/2024 ^                             | 120                                 | 55                               | 0,03                      |
| 9,250 % éch. 15/09/2027 ^                             | 60                                  | 30                               | 0,02                      |
| 9,250 % éch. 07/05/2028 ^                             | 185                                 | 89                               | 0,05                      |
| 11,950 % éch. 05/08/2031 ^                            | 50                                  | 27                               | 0,02                      |
|                                                       |                                     | <b>11 356</b>                    | <b>7,07</b>               |
| <b>ACTIONS</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                             |                                     |                                  |                           |
| <b>SERVICES FINANCIERS</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Hipotecaria Su Casita                                 |                                     |                                  |                           |
| S.A. de C.V. (c)                                      | 332 624                             | 0                                | 0,00                      |
| Stichting                                             |                                     |                                  |                           |
| Administratiekantoor T.K.H. Holding (c)               | 2 752                               | 0                                | 0,00                      |
|                                                       |                                     | 0                                | 0,00                      |
| <b>IMMOBILIER</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| Country Garden Holdings                               |                                     |                                  |                           |
| Co. Ltd. (c)                                          | 48 138                              | 1                                | 0,00                      |
| Kaisa Group Holdings                                  |                                     |                                  |                           |
| Ltd. (c)                                              | 929 719                             | 6                                | 0,00                      |
|                                                       |                                     | <b>7</b>                         | <b>0,00</b>               |
| <b>BONS DE SOUSCRIPTION</b>                           |                                     |                                  |                           |
| OAS S.A. - Exp.                                       |                                     |                                  |                           |
| 16/05/2039 (i)                                        | 175 616                             | 0                                | 0,00                      |
| <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                      |                                     |                                  |                           |
| <b>BILLETS À COURT TERME</b>                          |                                     |                                  |                           |
| CS Treasury Management Services Ltd.                  |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 05/12/2026 (f)                           | \$ 454                              | 468                              | 0,29                      |
| Kona Spc Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,718 % éch. 15/09/2026                               | € 1 000                             | 1 144                            | 0,71                      |
|                                                       |                                     | <b>1 612</b>                     | <b>1,00</b>               |
| <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 23,650 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (d)(e)                                     | EGP 800                             | 15                               | 0,01                      |
| 24,000 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (d)(e)                                     | 1 200                               | 23                               | 0,01                      |
| 24,050 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 20/10/2026 (d)(e)                                     | 2 300                               | 44                               | 0,03                      |
| 24,060 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 20/10/2026 (d)(e)                                     | 375                                 | 7                                | 0,01                      |
| 24,200 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 22/09/2026 (d)(e)                                     | 2 500                               | 48                               | 0,03                      |
| 24,351 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 22/09/2026 (d)(e)                                     | 5 100                               | 99                               | 0,06                      |
| 24,651 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 10/11/2026 (d)(e)                                     | 16 500                              | 310                              | 0,19                      |
|                                                       |                                     | <b>546</b>                       | <b>0,34</b>               |
| <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIEN</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 18,779 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 21/07/2026 (d)(e)                                     | NGN 90 654                          | 65                               | 0,04                      |
| 20,537 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 14/01/2027 (d)(e)                                     | 483 800                             | 317                              | 0,20                      |
| 20,607 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 21/01/2027 (d)(e)                                     | 464 900                             | 303                              | 0,19                      |
| 20,677 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 28/01/2027 (d)(e)                                     | 466 500                             | 302                              | 0,19                      |
| 21,064 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 13/10/2026 (d)(e)                                     | 185 600                             | 127                              | 0,08                      |
| 21,150 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 20/10/2026 (d)(e)                                     | 185 700                             | 127                              | 0,08                      |
| 21,186 % éch.                                         |                                     |                                  |                           |
| 07/07/2026 (d)(e)                                     | 305 722                             | 222                              | 0,14                      |

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| 21,265 % éch.                       |                                     |                                  |                           | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |         |                                  |                           |
| 20/10/2026 (d)(e)                   | NGN 185 600                         | \$ 127                           | 0,08                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |         |                                  |                           |
| 21,270 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                  |                           |
| 01/09/2026 (d)(e)                   | 104 000                             | 73                               | 0,04                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds           |         |                                  |                           |
| 21,310 % éch.                       |                                     |                                  |                           | PIMCO US Dollar Short-                   |         |                                  |                           |
| 20/10/2026 (d)(e)                   | 26 417                              | 18                               | 0,01                      | Term Floating NAV                        | 689 670 | \$ 6 877                         | 4,28                      |
| 21,323 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Fund (g)                                 |         |                                  |                           |
| 20/10/2026 (d)(e)                   | 37 100                              | 25                               | 0,02                      | PIMCO Specialty Funds Ireland            |         |                                  |                           |
| 21,333 % éch.                       |                                     |                                  |                           | p.l.c. - Fonds PIMCO China               |         |                                  |                           |
| 15/09/2026 (d)(e)                   | 90 000                              | 63                               | 0,04                      | Bond Fund (g)                            | 25 272  | 396                              | 0,25                      |
| 21,380 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                          |         | <b>7 273</b>                     | <b>4,53</b>               |
| 03/11/2026 (d)(e)                   | 149 800                             | 102                              | 0,06                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |         |                                  |                           |
| 21,445 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                  |                           |
| 27/10/2026 (d)(e)                   | 71 900                              | 49                               | 0,03                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO             |         |                                  |                           |
| 21,488 % éch.                       |                                     |                                  |                           | US Dollar Short Maturity                 |         |                                  |                           |
| 03/11/2026 (d)(e)                   | 71 900                              | 49                               | 0,03                      | UCITS ETF (g)                            | 1 000   | 101                              | 0,06                      |
| 21,702 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement         |         | <b>\$ 7 374</b>                  | <b>4,59</b>               |
| 18/08/2026 (d)(e)                   | 548 200                             | 388                              | 0,24                      |                                          |         |                                  |                           |
|                                     |                                     | <b>2 357</b>                     | <b>1,47</b>               |                                          |         |                                  |                           |
| Total des Instruments à court terme |                                     | 4 515                            | 2,81                      |                                          |         |                                  |                           |
| Total des Valeurs mobilières        |                                     | <b>\$ 151 882</b>                | <b>94,57</b>              |                                          |         |                                  |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Long  | 09/2026              | 5                     | \$ 7                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 60                    | (18)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 158                   | 28                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 55                    | 33                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 33                    | 24                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026              | 15                    | (37)                                    | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 1                     | 3                                       | 0,00                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | <b>\$ 40</b>                            | <b>0,02</b>            |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                      |                       | <b>\$ 40</b>                            | <b>0,02</b>            |

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/12/2030         | \$ 500                              | \$ 5                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 600                                 | 15                                      | 0,01                   |
|                                |                         |                    |                                     | <b>\$ 20</b>                            | <b>0,01</b>            |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------|-------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 %   | 21/06/2047         | \$ 1 700             | \$ 348                                  | 0,23                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 17/06/2028         | 4 400                | (46)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2029         | 9 000                | 15                                      | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2030         | 1 900                | 15                                      | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 17/06/2031         | 9 200                | 10                                      | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2034         | 2 900                | 51                                      | 0,03                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2035         | 1 700                | 20                                      | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2055         | 700                  | 34                                      | 0,02                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031         | 4 700                | 103                                     | 0,06                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/12/2054         | 300                  | 53                                      | 0,03                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029         | 5 500                | (174)                                   | (0,11)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030         | 500                  | 13                                      | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034         | 1 300                | (54)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035         | 300                  | 8                                       | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035         | 2 200                | (66)                                    | (0,04)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/06/2036         | 2 400                | (12)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2055         | 1 100                | (39)                                    | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>               | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 31/05/2033         | 3 000                | (10)                                    | (0,01)                 |



## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 %   | 18/03/2056      | \$ 800            | \$ (29)                           | (0,02)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,131    | 04/01/2027      | BRL 6 500         | (91)                              | (0,06)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,867    | 02/01/2031      | 15 800            | (77)                              | (0,05)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,905    | 02/01/2029      | 1 200             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | CNREPOFIX CNY à 3 mois        | 1,500     | 16/09/2031      | CNY 2 740         | (4)                               | 0,00                |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,130     | 01/10/2035      | CZK 18 600        | 3                                 | 0,00                |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,611     | 06/06/2028      | 12 800            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,500     | 16/09/2031      | € 1 800           | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,750     | 16/09/2036      | 1 500             | (31)                              | (0,02)              |
| À payer                                            | BBR HUF à 6 mois              | 5,890     | 09/05/2030      | HUF 462 500       | 62                                | 0,04                |
| À recevoir                                         | BBR HUF à 6 mois              | 6,190     | 18/11/2030      | 452 300           | (130)                             | (0,08)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours           | 8,207     | 19/06/2028      | MXN 6 900         | 6                                 | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ (28)                           | (0,01)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ (8)                            | 0,00                |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

| Contrepartie | Description                                          | Achat/vente de protection | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| GST          | Option de vente – Indice hors cote CDX.IG-46 à 5 ans | Achat                     | 0,625 %         | 15/07/2026        | 35 100                           | \$ 48 | \$ 2         | 0,00                |

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 2 019                            | \$ 20 | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 1 281                            | 9     | 0            | 0,00                |
| BPS          | Option d'achat - USD contre HKD hors cote  | HKD 7,800       | 24/08/2026        | 15 580                           | 15    | 59           | 0,04                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 44 | \$ 59        | 0,04                |

#### OPTIONS VENDUES

##### SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

| Contrepartie | Description                                          | Achat/vente de protection | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GST          | Option de vente – Indice hors cote CDX.IG-46 à 5 ans | Vente                     | 0,775 %         | 15/07/2026        | 52 700                           | \$ (32) | \$ (1)       | 0,00                |

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 2 019                            | \$ (7)  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 1 281                            | (3)     | 0            | 0,00                |
| BPS          | Option d'achat - USD contre HKD hors cote  | HKD 7,850       | 24/08/2026        | 15 580                           | (9)     | (2)          | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (19) | \$ (2)       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Obligation internationale du gouvernement mexicain   | (1,000) %           | 20/06/2031      | \$ 4 300                         | \$ (18)                | \$ (11)                           | \$ (29)      | (0,02)              |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)             | 20/12/2034      | 600                              | (29)                   | 1                                 | (28)         | (0,02)              |
|              |                                                      |                     |                 |                                  | \$ (47)                | \$ (10)                           | \$ (57)      | (0,04)              |



SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement mexicain   | 1,000 %              | 20/12/2027      | \$ 300                           | \$ 1                   | \$ 2                             | \$ 3         | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 400                              | 9                      | 0                                | 9            | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian   | 1,000                | 20/12/2030      | 100                              | (9)                    | 3                                | (6)          | (0,01)              |
| DBL          | Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.            | 1,000                | 20/06/2028      | 800                              | (2)                    | 3                                | 1            | 0,00                |
| JPM          | Alibaba Group Holding Ltd.                           | 1,000                | 20/06/2029      | 1 500                            | 8                      | 10                               | 18           | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien | 5,000                | 20/06/2027      | 300                              | 10                     | 1                                | 11           | 0,01                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 300                              | 6                      | 0                                | 6            | 0,00                |
|              | SoftBank Group Corp.                                 | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 65 200                         | (7)                    | 5                                | (2)          | 0,00                |
|              |                                                      |                      |                 |                                  | \$ 16                  | \$ 24                            | \$ 40        | 0,02                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 1 750                          | \$ 351                 | \$ 21                            | \$ 372       | 0,23                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 1 000                            | 204                    | 9                                | 213          | 0,13                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 1 640                            | 327                    | 22                               | 349          | 0,22                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 882                 | \$ 52                            | \$ 934       | 0,58                |

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

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 14                | \$ 10              | \$ 0                  | \$ 0                                   | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | DOP             | 5 177             | 88                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | COP                | 451                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 39                | KRW                | 60 040                | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP             | 1 897             | \$ 32              | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 33                | HKD                | 254                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 11 450            | \$ 23              | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             | 779               | 13                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 462               | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CNH             | 2 958             | 437                | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 786               | 38                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 125 102           | 1 320              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 386               | CNY                | 2 633                 | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 609               | €                  | 536                   | 3                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 122               | INR                | 11 746                | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 824               | ¥                  | 133 200               | (4)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 1 878             | \$ 114             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 331             | INR                | 126 788               | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 7                 | THB                | 218                   | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | €               | 307               | RON                | 1 614                 | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 534               | \$ 11              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 812               | MYR                | 3 298                 | (5)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 922               | TRY                | 43 907                | 3                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 9 276             | \$ 571             | 6                     | 6                                      | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$              | 312               | €                  | 268                   | (5)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | BRL             | 590               | \$ 115             | 3                     | 3                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | COP             | 513 792           | 146                | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 1 772             | 6                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | COP                | 804                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 83                | EGP                | 4 464                 | 7                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 1 191             | €                  | 1 021                 | (23)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 634             | INR                | 154 903               | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 26                | KZT                | 14 085                | 3                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 15                | PLN                | 54                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 159 452           | \$ 1 701           | 24                    | 24                                     | 0,02                |
|              | 09/2026           | KZT             | 23 909            | 47                 | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2                 | PEN                | 9                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 824               | \$ 0               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 49                | COP                | 174 681               | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 393 000           | \$ 30              | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 11/2026           | NGN             | \$                | 16 340             | 10                    | \$                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$              | COP               | 352 818            | 2                     | \$                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | \$                | 854                | 0                     | (16)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CZK             |                   | 41                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 208                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             |                   | 17                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | EGP               | 1 369              | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 13 374             | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | KZT               | 166 693            | 38                    | 38                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 55                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 266                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT             |                   | 87                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | EGP               | 1 438              | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP             | \$                | 50                 | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PKR             |                   | 111                | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 19 753             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | \$                | 570                | 0                     | (27)                                    | (0,02)              |
|              | 11/2026           | KZT             |                   | 40                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN             |                   | 255                | 0                     | (29)                                    | (0,02)              |
|              | 11/2026           | UZS             |                   | 332                | 0                     | (22)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 12/2026           | \$              | KZT               | 7 417              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | UZS             | \$                | 60                 | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             |                   | 435                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               |                   | 1 825              | 24                    | 24                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 823                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             |                   | 26                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             |                   | 97                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CNH               | 10 705             | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 460                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | HUF               | 225 458            | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 156                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 372                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             |                   | 1 574              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               |                   | 525                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN             |                   | 253                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | ¥                 | 132 835            | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 6 489              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | \$                | 383                | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | DOP             |                   | 66                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 314                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | \$              | BRL               | 739                | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | CAD               | 104                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | \$                | 73                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP             |                   | 202                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | DOP               | 32 138             | 13                    | 13                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           |                 | INR               | 845                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | DOP             | \$                | 391                | 3                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 37 642             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | THB               | 745                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | DOP             | \$                | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           |                 |                   | 116                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$              | COP               | 1 373 967          | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | DOP             | \$                | 27                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             |                   | 44                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             |                   | 144                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | EGP             |                   | 105                | 0                     | (26)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | HUF             |                   | 33                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             |                   | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             |                   | 67                 | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | HKD               | 945                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 09/2026           | MXN             | \$                | 726                | 9                     | 9                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 1 630              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | THB               | 501                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | BRL               | 757                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | \$                | 196                | 0                     | (9)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD             |                   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             |                   | 209                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 43                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | COP               | 1 846 735          | 47                    | 47                                      | 0,03                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 714                | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 30 999             | 5                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | KRW               | 1 033 413          | 0                     | (14)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | AUD             | \$                | 29                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP             |                   | 82                 | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 23 946             | 1                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | AZN               | 376                | 9                     | 9                                       | 0,01                |
|              | 10/2027           |                 |                   | 773                | 20                    | 20                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 31 287             | 5                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | TRY               | 10 700             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | EGP             | \$                | 288                | 0                     | (28)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | KZT             |                   | 95                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CNY               | 6 167              | 2                     | 2                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | \$              | 49 EGP            | 2 639              | \$ 4                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 428 INR           | 41 026             | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 53 KZT            | 28 869             | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 114 HKD           | 892                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 22 INR            | 2 099              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP             | 2 338 \$          | 46                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 3 748             | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 95 KZT            | 47 028             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 11 THB            | 344                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 4 805 \$          | 710                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 153 RON           | 806                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 116 \$         | 11 801             | 236                   | 0                                       | 0,15                |
|              | 07/2026           | RON             | 2 409 €           | 459                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 24 AUD            | 34                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 619 €           | 7 577              | 45                    | 0                                       | 0,03                |
| SSB          | 07/2026           |                 | 96 SGD            | 124                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 34 \$             | 24                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 7 577             | 8 631              | 0                     | (45)                                    | (0,03)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 124               | 96                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 71 EGP            | 3 866              | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP             | 15 807 \$         | 284                | 0                     | (27)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | CAD             | 107               | 77                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 460               | 523                | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 794 £           | 1 357              | 7                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | COP             | 5 241 856 \$      | 1 374              | 0                     | (131)                                   | (0,08)              |
|              | 08/2026           | £               | 1 357             | 1 794              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 2 237 574         | 577                | 0                     | (62)                                    | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$              | 15 PLN            | 55                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 230 COP           | 899 221            | 20                    | 0                                       | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 613             | \$ (554)              | \$ 59                                   | 0,04                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF             | 26 \$             | 32                 | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 2 348 CHF         | 1 835              | 0                     | (73)                                    | (0,04)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 103 \$            | 131                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$              | 2 536 CHF         | 1 986              | 0                     | (74)                                    | (0,05)              |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 939 \$          | 2 397              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | \$              | 2 397 CHF         | 1 933              | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 509             | 1 972              | 0                     | (64)                                    | (0,04)              |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 1 932 \$          | 2 393              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 393 CHF         | 1 925              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 13              | \$ (220)              | \$ (207)                                | (0,13)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS                                                | 07/2026           | \$              | 47 602 €          | 40 859             | \$ 0                  | \$ (887)                                | (0,55)              |
| BSH                                                | 07/2026           |                 | 45 136            | 38 712             | 0                     | (876)                                   | (0,54)              |
| CBK                                                | 07/2026           | €               | 20 \$             | 23                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | \$              | 436 €             | 374                | 0                     | (9)                                     | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | €               | 38 486 \$         | 43 894             | 0                     | (108)                                   | (0,07)              |
| MBC                                                | 08/2026           | \$              | 43 953 €          | 38 486             | 108                   | 0                                       | 0,07                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 41 173 \$         | 46 765             | 1                     | (309)                                   | (0,19)              |
| SOG                                                | 07/2026           | \$              | 26 €              | 23                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           |                 | 46 799            | 41 148             | 308                   | 0                                       | 0,19                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 41 148 \$         | 46 806             | 0                     | (239)                                   | (0,15)              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 47 664 €          | 40 859             | 0                     | (949)                                   | (0,59)              |
|                                                    |                   |                 |                   | 08/2026            | 41 148                | 238                                     | 0,15                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 655             | \$ (3 377)            | \$ (2 722)                              | (1,69)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (1 895)                              | (1,18)              |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                                    |                                     |                                  |                          |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>5,950 % éch. 15/04/2030 <sup>^(h)</sup> | \$ 1 300                            | \$ 78                            | 0,05                     |
| ALROSA Finance S.A.<br>3,100 % éch. 25/06/2027 <sup>^</sup>                        | 1 100                               | 66                               | 0,04                     |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,250 % éch. 23/05/2023 <sup>^(h)</sup>  | 1 700                               | 102                              | 0,06                     |
| Severstal OAO Via Steel Capital S.A.<br>3,150 % éch. 16/09/2024 <sup>^</sup>       | 800                                 | 37                               | 0,02                     |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC<br>3,400 % éch. 26/01/2025 <sup>^</sup>          | 1 100                               | 30                               | 0,02                     |
| <b>Total des Autres actifs financiers</b>                                          |                                     | <b>\$ 313</b>                    | <b>0,19</b>              |
| <b>Total des Investissements</b>                                                   |                                     | <b>\$ 157 706</b>                | <b>98,19</b>             |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b>                                      |                                     | <b>\$ 2 900</b>                  | <b>1,81</b>              |
| <b>Actif net</b>                                                                   |                                     | <b>\$ 160 606</b>                | <b>100,00</b>            |

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

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

<sup>^</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,00 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût            | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|--------------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------------|
| Banco Nacional de Mexico S.A.                       | 6,697 % | 07/08/2036         | 30/04/2026      | \$ 800          | \$ 789          | 0,49                   |
| Invepar Holdings LLC                                | 1,000   | 31/12/2049         | 16/11/2018      | 0               | 0               | 0,00                   |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804   | 20/04/2033         | 13/04/2026      | 400             | 399             | 0,25                   |
| OAS S.A.                                            | 0,000   | 16/05/2039         | 16/11/2018      | 5               | 0               | 0,00                   |
|                                                     |         |                    |                 | <b>\$ 1 205</b> | <b>\$ 1 188</b> | <b>0,74</b>            |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 1 703 \$ (31 décembre 2025 : 1 570 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 065 \$ (31 décembre 2025 : 1 224 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 2 720 \$ (31 décembre 2025 : 170 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 7                                                                                       | \$ 143 386                                                 | \$ 8 489                                                   | \$ 151 882        |
| Fonds d'investissement                        | 7 374                                                                                      | 0                                                          | 0                                                          | 7 374             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 10                                                                                         | (1 873)                                                    | 0                                                          | (1 863)           |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 313                                                        | 0                                                          | 313               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 7 391</b>                                                                            | <b>\$ 141 826</b>                                          | <b>\$ 8 489</b>                                            | <b>\$ 157 706</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 144 528                                                 | \$ 7 115                                                   | \$ 151 643        |
| Fonds d'investissement                        | 13 272                                                                                     | 0                                                          | 0                                                          | 13 272            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (10)                                                                                       | 1 955                                                      | 4                                                          | 1 949             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 0                                                          | 313                                                        | 313               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 13 262</b>                                                                           | <b>\$ 146 483</b>                                          | <b>\$ 7 432</b>                                            | <b>\$ 167 177</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

## Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 2,200 %        | 09/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (501)         | \$ (502)                                 | (0,31)              |
| SCX                                           | 3,500          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 036)          | (1 041)                                  | (0,65)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (1 543)</b>                        | <b>(0,96)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 0                                                       | \$ 0                    | \$ 0                              | \$ S/O                                                     | \$ S/O                  | \$ S/O                            |
| BOA          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| BPS          | (452)                                                      | 660                     | 208                               | 21                                                         | 0                       | 21                                |
| BRC          | 8                                                          | 0                       | 8                                 | 576                                                        | (670)                   | (94)                              |
| BSH          | (878)                                                      | 1 050                   | 172                               | 12                                                         | 170                     | 182                               |
| CBK          | (18)                                                       | 0                       | (18)                              | (39)                                                       | 0                       | (39)                              |
| DBL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| DUB          | (42)                                                       | 0                       | (42)                              | (8)                                                        | 0                       | (8)                               |
| FAR          | 21                                                         | 0                       | 21                                | 6                                                          | 0                       | 6                                 |
| GLM          | 13                                                         | 0                       | 13                                | 19                                                         | 0                       | 19                                |
| GST          | 185                                                        | 0                       | 185                               | 43                                                         | 0                       | 43                                |
| JPM          | 283                                                        | (360)                   | (77)                              | (10)                                                       | 0                       | (10)                              |
| MBC          | (46)                                                       | 0                       | (46)                              | 577                                                        | (640)                   | (63)                              |
| MYC          | (24)                                                       | 0                       | (24)                              | (32)                                                       | 0                       | (32)                              |
| MYI          | 29                                                         | 0                       | 29                                | (13)                                                       | 0                       | (13)                              |
| NSL          | 6                                                          | 0                       | 6                                 | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| SCX          | (11)                                                       | 0                       | (11)                              | (11)                                                       | 0                       | (11)                              |
| SOG          | (732)                                                      | 740                     | 8                                 | 569                                                        | (660)                   | (91)                              |
| SSB          | (258)                                                      | 270                     | 12                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | 20                                                         | 0                       | 20                                | (21)                                                       | 0                       | (21)                              |
| WST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 55,77            | 60,50                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé      | 30,07            | 21,44                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 2,26             | 1,98                 |
| Fonds d'investissement                                           | 4,28             | 7,34                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,05             | 0,04                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,44             | 0,39                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,35             | 1,21                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,18             | 0,17                 |
| Autres actifs                                                    | 5,60             | 6,93                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                       | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                         | 3,21             | 2,94                 |
| Obligations et billets privés                                                           | 77,90            | 76,10                |
| Obligations et billets convertibles                                                     | 0,48             | 1,00                 |
| Obligations du Trésor américain                                                         | 2,56             | 2,48                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 0,35             | 0,37                 |
| Titres adossés à des actifs                                                             | 0,19             | 0,19                 |
| Émissions souveraines                                                                   | 7,07             | 5,05                 |
| Actions ordinaires                                                                      | 0,00             | 0,01                 |
| Bons de souscription                                                                    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments à court terme                                                               | 2,81             | 2,39                 |
| Fonds d'investissement                                                                  | 4,59             | 7,92                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                        |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                           | 0,02             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                        | S/O              | (0,03)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                        | 0,01             | 0,08                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                 | (0,01)           | 0,07                 |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | 0,00             | 0,03                 |
| Options de change                                                                                        | 0,04             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | 0,00             | (0,01)               |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,04)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02             | 0,02                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,58             | S/O                  |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | S/O              | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,04             | (0,17)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,82)           | 1,15                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,19             | 0,19                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 1,81             | 0,20                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>0,000 % éch. 31/12/2032 (d) \$ 626 \$ 2 0,00</b>            |                                     |                                  |                           | <b>COLOMBIE</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ARGENTINE</b>                                                 |                                     |                                  |                           | <b>12 0,00</b>                                                 |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                            |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                           |                                     |                                  |                           | <b>Ecopetrol S.A.</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin               |                                     |                                  |                           | Burjeel Sukuk Ltd.                                             |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 28/05/2045 \$ 6 300 \$ 5 209 0,29                  |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                                          | \$ 814                              | \$ 722                           | 0,04                      | 7,000 % éch. 01/07/2031 (a) 2 300 2 310 0,13                   |                                     |                                  |                           | <b>Promigas S.A. ESP</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 09/07/2029                                          | 700                                 | 639                              | 0,03                      | Gaci First Investment Co.                                      |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 24/06/2056 2 000 2 035 0,12                        |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 09/07/2041                                          | 4 700                               | 3 525                            | 0,20                      | 6,250 % éch. 14/05/2056 8 600 8 614 0,48                       |                                     |                                  |                           | <b>7 244 0,41</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                          | 15 300                              | 12 278                           | 0,69                      | <b>Kaisa Group Holdings Ltd.</b>                               |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 09/01/2038                                          | 1 900                               | 1 590                            | 0,09                      | 5,000 % éch. 30/11/2027 31 2 0,00                              |                                     |                                  |                           | <b>Bogota Distrito Capital</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| Provincia de Buenos Aires                                        |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de  |                                     |                                  |                           | 13,140 % éch. 05/11/2035 COP 11 609 000 3 371 0,19              |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 01/09/2037                                          | 2 312                               | 1 917                            | 0,11                      | rémunération en nature) 242 5 0,00                             |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement colombien</b>      |                                     |                                  |                           |
| <b>Total Argentine</b>                                           | <b>20 671</b>                       | <b>1,16</b>                      |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de  |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 21/01/2031 \$ 2 800 2 831 0,16                     |                                     |                                  |                           |
| <b>AUSTRALIE</b>                                                 |                                     |                                  |                           | rémunération en nature) 405 9 0,00                             |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 21/01/2033 2 800 2 848 0,16                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de  |                                     |                                  |                           | <b>TES colombien</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd.                           |                                     |                                  |                           | rémunération en nature) 488 8 0,00                             |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch.                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 22/10/2031                                          | 2 900                               | 2 952                            | 0,17                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de  |                                     |                                  |                           | 18/04/2029 (f) COP 10 948 978 2 862 0,16                        |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 22/04/2034                                          | 3 100                               | 3 199                            | 0,18                      | rémunération en nature) 735 12 0,00                            |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch.                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>Total Australie</b>                                           | <b>6 151</b>                        | <b>0,35</b>                      |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de  |                                     |                                  |                           | 22/01/2031 (f) 16 083 385 4 624 0,26                            |                                     |                                  |                           |
| <b>AZERBAÏDJAN</b>                                               |                                     |                                  |                           | rémunération en nature) 692 14 0,00                            |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 26/03/2031 64 083 400 15 326 0,86                  |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                           |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de  |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 22/08/2029 222 696 900 62 692 3,52                |                                     |                                  |                           |
| State Oil, Inc.                                                  |                                     |                                  |                           | rémunération en nature) 7250 % éch. 28/12/2032 (b) 692 14 0,00 |                                     |                                  |                           | 11,750 % éch. 24/01/2035 195 509 200 55 697 3,12                |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 24/03/2031                                            | 11 400                              | 11 275                           | 0,63                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,21 % en numéraire ou 6,721 % de   |                                     |                                  |                           | 12,000 % éch. 13/03/2058 26 518 900 7 604 0,43                  |                                     |                                  |                           |
| <b>BÉNIN</b>                                                     |                                     |                                  |                           | rémunération en nature) 165 3 0,00                             |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 28/11/2040 30 933 100 9 360 0,52                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | 7,721 % éch. 28/12/2028 (b) 767 690 0,04                       |                                     |                                  |                           | 13,250 % éch. 09/02/2033 26 776 800 8 195 0,46                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement béninois               |                                     |                                  |                           | Peru Payroll Deduction Finance Ltd.                            |                                     |                                  |                           | <b>175 410 9,84</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 22/01/2035 (k) € 3 300 3 571 0,20                   |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 01/11/2029 (d) 767 690 0,04                       |                                     |                                  |                           | <b>Total Colombie</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>BOLIVIE</b>                                                   |                                     |                                  |                           | QNB Finance Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | <b>182 654 10,25</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | 4,538 % éch. 19/09/2027 5 400 5 399 0,30                       |                                     |                                  |                           | <b>CONGO</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement bolivien               |                                     |                                  |                           | 4,679 % éch. 27/04/2029 9 000 9 045 0,51                       |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| 9,450 % éch. 14/05/2031 \$ 6 700 6 873 0,39                      |                                     |                                  |                           | Red Dorsal Finance Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | Obligation internationale congolaise                            |                                     |                                  |                           |
| <b>BOSNIE-HERZÉGOVINE</b>                                        |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 12/10/2031 252 248 0,02                           |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 17/02/2035 \$ 2 800 2 726 0,15                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | TIB Diversified Payment Rights Finance Co.                     |                                     |                                  |                           | <b>CONGO, RÉPUBLIQUE DÉMOCRATIQUE DU</b>                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République serbe |                                     |                                  |                           | 6,551 % éch. 15/11/2034 1 100 1 118 0,06                       |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| de Bosnie                                                        |                                     |                                  |                           | VD DPR Finance Co.                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale de la RDC                             |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 02/04/2031 € 2 200 2 553 0,14                       |                                     |                                  |                           | 6,833 % éch. 15/03/2035 2 500 2 558 0,15                       |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 16/04/2037 3 100 3 250 0,18                        |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 08/05/2033 2 600 2 981 0,17                         |                                     |                                  |                           | <b>30 035 1,69</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>COSTA RICA</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>Total Bosnie-Herzégovine</b>                                  | <b>5 534</b>                        | <b>0,31</b>                      |                           | <b>30 047 1,69</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>BRÉSIL</b>                                                    |                                     |                                  |                           | <b>CHILI</b>                                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain           |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                             |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch.                                                    |                                     |                                  |                           |
| Vale S.A.                                                        |                                     |                                  |                           | Corp. Nacional del Cobre de Chile                              |                                     |                                  |                           | 21/11/2030 (k) € 1 500 1 804 0,10                               |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % BRL 46 580 3 612 0,21                                    |                                     |                                  |                           | 6,780 % éch. 13/01/2055 1 300 1 403 0,08                       |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 27/04/2033 1 800 2 196 0,12                        |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                           |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                   |                                     |                                  |                           | 6,001 % éch.                                                    |                                     |                                  |                           |
| Oi S.A.                                                          |                                     |                                  |                           | Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos                 |                                     |                                  |                           | 16/01/2036 (k) 2 750 3 329 0,19                                 |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 30/12/2050 \$ 895 0 0,00                              |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 01/09/2030 CLP 9 205 000 9 858 0,55               |                                     |                                  |                           | <b>Total Costa Rica</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/10/2028 2 010 000 2 197 0,12                   |                                     |                                  |                           | <b>7 329 0,41</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien              |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 01/10/2029 20 015 000 22 338 1,26                 |                                     |                                  |                           | <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 23/04/2030 € 4 700 5 393 0,30                       |                                     |                                  |                           | <b>34 393 1,93</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>Total Brésil</b>                                              | <b>9 005</b>                        | <b>0,51</b>                      |                           | <b>35 796 2,01</b>                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République tchèque |                                     |                                  |                           |
| <b>CAMEROUN</b>                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/09/2030 CZK 199 100 9 734 0,55                  |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>CHINE</b>                                                   |                                     |                                  |                           | <b>DANEMARK</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République du    |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Cameroun                                                         |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings                                           |                                     |                                  |                           | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                            |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 07/07/2032 800 818 0,04                             |                                     |                                  |                           | Ltd. (c) 2 352 901 14 0,00                                     |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050 DKK 0 0 0,00                            |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 30/01/2033 \$ 4 100 4 046 0,23                      |                                     |                                  |                           | <b>VALEUR NOMINALE (en milliers)</b>                           |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                |                                     |                                  |                           |
| <b>Total Cameroun</b>                                            | <b>4 864</b>                        | <b>0,27</b>                      |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                           |                                     |                                  |                           | Nykredit Realkredit A/S                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÎLES CAIMANS</b>                                              |                                     |                                  |                           | Yango Justice International Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                       |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 17/02/2025 ^ \$ 1 100 1 0,00                      |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                |                                     |                                  |                           |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                   |                                     |                                  |                           | Realkredit Danmark A/S                                          |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2026 (d) 144 1 0,00                           |                                     |                                  |                           | Banque de développement chinoise                               |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (d) 180 2 0,00                           |                                     |                                  |                           | 1,870 % éch. 05/09/2035 CNY 138 350 20 533 1,15                |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (d) 288 2 0,00                           |                                     |                                  |                           | 2,630 % éch. 08/01/2034 70 310 11 043 0,62                     |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (d) 288 2 0,00                           |                                     |                                  |                           | <b>31 576 1,77</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>Total Danemark</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (d) 359 2 0,00                           |                                     |                                  |                           | <b>Total Chine</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>0 0,00</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (d) 359 1 0,00                           |                                     |                                  |                           | <b>31 591 1,77</b>                                             |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                     |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>RÉPUBLIQUE DOMINICAINE</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 28/10/2035                                             | \$ 2 400                            | \$ 2 377                         | 0,13                      |
| 10,500 % éch. 15/03/2037                                            | DOP 1 659 750                       | 29 759                           | 1,67                      |
| 10,750 % éch. 01/06/2036                                            | 171 200                             | 3 114                            | 0,18                      |
| 11,250 % éch. 15/09/2035                                            | 22 800                              | 425                              | 0,02                      |
| 13,625 % éch. 03/02/2033                                            | 10 450                              | 212                              | 0,01                      |
| 13,625 % éch. 10/02/2034                                            | 49 700                              | 1 016                            | 0,06                      |
| Total République dominicaine                                        |                                     | 36 903                           | 2,07                      |
| <b>ÉGYPTE</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien                  |                                     |                                  |                           |
| 19,698 % éch. 14/10/2030                                            | EGP 361 000                         | 6 995                            | 0,39                      |
| 21,954 % éch. 04/03/2028                                            | 322 900                             | 6 372                            | 0,36                      |
| Total Égypte                                                        |                                     | 13 367                           | 0,75                      |
| <b>GABON</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement gabonais                  |                                     |                                  |                           |
| 9,500 % éch. 18/02/2029                                             | \$ 1 100                            | 1 052                            | 0,06                      |
| <b>GHANA</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement ghanéen                   |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 03/07/2026 (d)                                         | \$ 13                               | 13                               | 0,00                      |
| 8,650 % éch. 13/02/2029                                             | GHS 7 556                           | 605                              | 0,04                      |
| 8,800 % éch. 12/02/2030                                             | 10 000                              | 764                              | 0,04                      |
| 8,950 % éch. 11/02/2031                                             | 7 249                               | 534                              | 0,03                      |
| 9,100 % éch. 10/02/2032                                             | 16 993                              | 1 212                            | 0,07                      |
| Total Ghana                                                         |                                     | 3 128                            | 0,18                      |
| <b>GUATEMALA</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement guatémaltèque             |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/08/2036                                             | \$ 700                              | 732                              | 0,04                      |
| <b>HONG KONG</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Fortune Star BVI Ltd.                                               |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 19/05/2028                                             | 1 600                               | 1 644                            | 0,09                      |
| <b>HONGRIE</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois                  |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 24/11/2032                                             | HUF 596 400                         | 1 890                            | 0,11                      |
| 7,000 % éch. 24/10/2035                                             | 1 990 700                           | 7 306                            | 0,41                      |
| Total Hongrie                                                       |                                     | 9 196                            | 0,52                      |
| <b>INDE</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Adani Renewable Energy RJ Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/10/2039                                             | \$ 1 615                            | 1 374                            | 0,08                      |
| IIFL Finance Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 24/07/2028                                             | 1 000                               | 1 030                            | 0,06                      |
| Total Inde                                                          |                                     | 2 404                            | 0,14                      |
| <b>INDONÉSIE</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT                                |                                     |                                  |                           |
| 7,150 % éch. 22/10/2031 (g)(i)                                      | 6 000                               | 5 996                            | 0,34                      |
| Danantara Investment Management PT                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 18/06/2031                                             | 7 700                               | 7 692                            | 0,43                      |
| 5,950 % éch. 18/06/2036                                             | 7 600                               | 7 585                            | 0,43                      |
| LLPL Capital Pte. Ltd.                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 04/02/2039                                             | 2 695                               | 2 740                            | 0,15                      |
| Pertamina Hulu Energi PT                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 21/05/2030                                             | 1 200                               | 1 198                            | 0,07                      |
|                                                                     |                                     | 25 211                           | 1,42                      |

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 29/05/2038                              | € 3 200                             | \$ 3 762                         | 0,21                      |
| 5,690 % éch. 29/05/2036                              | \$ 5 600                            | 5 722                            | 0,32                      |
|                                                      |                                     | 9 484                            | 0,53                      |
| Total Indonésie                                      |                                     | 34 695                           | 1,95                      |
| <b>INTERNATIONALES</b>                               |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>               |                                     |                                  |                           |
| State Oil, Inc.                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,232 % éch. 22/07/2030                              | 1 300                               | 1 296                            | 0,07                      |
| <b>IRLANDE</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| CIMA Finance DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| 2,950 % éch. 05/09/2029                              | 886                                 | 843                              | 0,05                      |
| Iridium Capital PLC                                  |                                     |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 18/06/2029                              | € 3 200                             | 3 976                            | 0,22                      |
|                                                      |                                     | 4 819                            | 0,27                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>               |                                     |                                  |                           |
| République du Panama                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                              | 3 200                               | 3 664                            | 0,21                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC     |                                     |                                  |                           |
| 10,750 % éch. 15/09/2028                             | \$ 159                              | 163                              | 0,01                      |
| 10,750 % éch. 05/02/2029                             | 1 987                               | 2 042                            | 0,11                      |
|                                                      |                                     | 2 205                            | 0,12                      |
| Total Irlande                                        |                                     | 10 688                           | 0,60                      |
| <b>ÎLE DE MAN</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Gohl Capital Holdings Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| 7,625 % éch. 29/10/2031 (g)                          | 5 200                               | 5 041                            | 0,28                      |
| 8,300 % éch. 29/04/2036 (g)                          | 3 500                               | 3 373                            | 0,19                      |
| Total Île de Man                                     |                                     | 8 414                            | 0,47                      |
| <b>ISRAËL</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.                            |                                     |                                  |                           |
| 5,642 % éch. 29/06/2033                              | 4 000                               | 4 022                            | 0,23                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement israélien  |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 30/10/2026                              | € 1 300                             | 1 496                            | 0,08                      |
| Total Israël                                         |                                     | 5 518                            | 0,31                      |
| <b>CÔTE D'IVOIRE</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>               |                                     |                                  |                           |
| République de Côte d'Ivoire                          |                                     |                                  |                           |
| 4,912 % éch. 09/03/2027                              | 5 000                               | 5 738                            | 0,32                      |
| 5,185 % éch. 05/03/2027                              | 3 400                               | 3 903                            | 0,22                      |
| 7,047 % éch. 10/09/2032                              | 5 000                               | 5 716                            | 0,32                      |
|                                                      |                                     | 15 357                           | 0,86                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement ivoirien   |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 17/10/2031 (k)                          | 3 200                               | 3 773                            | 0,21                      |
| 6,625 % éch. 22/03/2048                              | 7 500                               | 8 297                            | 0,47                      |
| 8,075 % éch. 01/04/2036                              | \$ 500                              | 548                              | 0,03                      |
|                                                      |                                     | 12 618                           | 0,71                      |
| Total Côte d'Ivoire                                  |                                     | 27 975                           | 1,57                      |
| <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| GSG Bidco Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 15/06/2031                              | € 1 000                             | 1 134                            | 0,06                      |
| 5,375 % éch. 15/06/2036                              | 1 100                               | 1 248                            | 0,07                      |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                   |                                     | 2 382                            | 0,13                      |

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>JORDANIE</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement jordanien                 |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 10/10/2047                                             | \$ 1 200                            | \$ 1 196                         | 0,07                      |
| <b>KAZAKHSTAN</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Kaspi.KZ JSC                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,900 % éch. 28/04/2031                                             | 1 700                               | 1 699                            | 0,09                      |
| KazMunayGas National Co. JSC                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 24/10/2048                                             | 305                                 | 307                              | 0,02                      |
|                                                                     |                                     | 2 006                            | 0,11                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Baiterek National Investment Holding JSC                            |                                     |                                  |                           |
| 16,950 % éch. 02/04/2029                                            | KZT 3 124 500                       | 6 639                            | 0,37                      |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                                            | 2 084 000                           | 4 487                            | 0,25                      |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                                  |                                     |                                  |                           |
| 13,489 % éch. 23/05/2028                                            | 420 500                             | 841                              | 0,05                      |
| 18,400 % éch. 16/10/2028                                            | 2 914 500                           | 6 348                            | 0,36                      |
|                                                                     |                                     | 18 315                           | 1,03                      |
| Total Kazakhstan                                                    |                                     | 20 321                           | 1,14                      |
| <b>KENYA</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| République du Kenya                                                 |                                     |                                  |                           |
| 9,086 % éch. 05/04/2028                                             | \$ 600                              | 603                              | 0,04                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de la République du Kenya |                                     |                                  |                           |
| 9,500 % éch. 05/03/2036                                             | 700                                 | 745                              | 0,04                      |
| Total Kenya                                                         |                                     | 1 348                            | 0,08                      |
| <b>KOWEÏT</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït                 |                                     |                                  |                           |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (j)                                         | 7 500                               | 7 487                            | 0,42                      |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Chile Electricity Lux MPC SARL                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,672 % éch. 20/10/2035                                             | 3 204                               | 3 277                            | 0,18                      |
| Green Palm Bidco SARL                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,957 % éch. 30/06/2041                                             | 3 600                               | 3 640                            | 0,21                      |
| 6,462 % éch. 30/06/2046                                             | 3 600                               | 3 649                            | 0,21                      |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,103 % éch. 23/08/2042                                             | 1 100                               | 1 123                            | 0,06                      |
| Luminis S.A.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 9,649 % éch. 15/09/2038                                             | 13 900                              | 16 235                           | 0,91                      |
| Poinsettia Finance Ltd.                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 17/06/2031                                             | 619                                 | 610                              | 0,03                      |
| Virtuo2 Finance SARL                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,930 % éch. 12/01/2034                                             | € 1 900                             | 2 622                            | 0,15                      |
|                                                                     |                                     | 31 156                           | 1,75                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Eagle Funding Luxco SARL                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                                             | \$ 7 100                            | 7 138                            | 0,40                      |
| Total Luxembourg                                                    |                                     | 38 294                           | 2,15                      |
| <b>MALAISIE</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien                 |                                     |                                  |                           |
| 4,642 % éch. 07/11/2033                                             | MYR 75 200                          | 19 745                           | 1,11                      |
| <b>MEXIQUE</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC                             |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 14/05/2036                                             | \$ 2 300                            | 2 285                            | 0,13                      |
| COX Asset Mexico S.A. de C.V.                                       |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 08/01/2032                                             | 4 100                               | 4 164                            | 0,24                      |
| 7,750 % éch. 08/05/2036                                             | 5 100                               | 5 222                            | 0,29                      |

| DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ESSENTIA ENERGY DEVELOPMENT S.A.B. DE C.V.</b>           |                                     |                                  |                           | <b>PÉROU</b>                                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 30/07/2033                                     | \$                                  | 600                              | 0,03                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement serbe</b>              |                                     |                                  |                           |
| Petroleos Mexicanos                                         |                                     |                                  |                           | Credicorp Capital Sociedad Tituladora S.A.                  |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 06/05/2038                                             | €                                   | 5 200                            | 0,34                      |
| 6,350 % éch. 12/02/2048                                     | 3 300                               | 2 722                            | 0,15                      | 9,700 % éch. 05/03/2045                                     | PEN                                 | 1 400                            | 0,03                      | Total Serbie                                                        |                                     | 9 946                            | 0,56                      |
| 6,375 % éch. 23/01/2045                                     | 5 300                               | 4 522                            | 0,26                      | 10,100 % éch. 15/12/2043                                    | 22 618                              | 7 297                            | 0,41                      | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,690 % éch. 23/01/2050                                     | 11 500                              | 10 734                           | 0,60                      | Petroleos del Peru S.A.                                     |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
|                                                             | 30 248                              | 1,70                             |                           | 4,750 % éch. 19/06/2032                                     | \$                                  | 4 700                            | 0,22                      | <b>Sasol Financing USA LLC</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                             |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 19/06/2047                                     | 3 700                               | 2 648                            | 0,15                      | 8,750 % éch. 10/04/2033                                             | \$                                  | 900                              | 0,05                      |
|                                                             |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     | 14 387                           | 0,81                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>Transnet SOC Ltd.</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>Obligation internationale du gouvernement mexicain</b>   |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement péruvien</b>   |                                     |                                  |                           | 10,658 % éch. 02/03/2028                                            | ZAR                                 | 17 886                           | 0,06                      |
| 5,125 % éch. 19/03/2038 (k)                                 | €                                   | 1 400                            | 0,09                      | 5,400 % éch. 12/08/2034                                     | PEN                                 | 57 600                           | 0,93                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 09/02/2034                                     | \$                                  | 2 200                            | 0,12                      | 6,150 % éch. 12/08/2032                                     | 33 800                              | 10 736                           | 0,60                      | <b>Obligation internationale du gouvernement sud-africain</b>       |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 09/02/2038                                     |                                     | 2 200                            | 0,12                      | 6,850 % éch. 12/08/2035                                     | 153 620                             | 47 415                           | 2,66                      | 5,750 % éch. 30/09/2049                                             | \$                                  | 1 400                            | 0,07                      |
| 6,250 % éch. 27/08/2037                                     |                                     | 7 900                            | 0,44                      | 6,900 % éch. 12/08/2037                                     | 4 400                               | 1 322                            | 0,07                      | 6,250 % éch. 31/03/2036                                             | ZAR                                 | 78 900                           | 0,23                      |
| 6,750 % éch. 09/02/2056                                     |                                     | 2 200                            | 0,12                      | 6,950 % éch. 12/08/2031                                     | 22 241                              | 7 420                            | 0,42                      | 7,000 % éch. 28/02/2031                                             |                                     | 232 700                          | 13 714                    |
| 8,000 % éch. 15/04/2032                                     | MXN                                 | 227 513                          | 12 634                    | 7,300 % éch. 12/08/2033                                     | 30 800                              | 10 120                           | 0,57                      | 8,000 % éch. 31/01/2030                                             |                                     | 264 100                          | 16 249                    |
| 8,500 % éch. 01/03/2029                                     |                                     | 717 500                          | 41 681                    |                                                             |                                     | 93 521                           | 5,25                      | 8,250 % éch. 31/03/2032                                             |                                     | 66 400                           | 4 096                     |
| 8,500 % éch. 31/05/2029                                     |                                     | 433 300                          | 25 143                    |                                                             |                                     | 107 908                          | 6,06                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                             |                                     | 319 500                          | 20 202                    |
| 8,500 % éch. 28/02/2030                                     |                                     | 382 500                          | 22 061                    |                                                             |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 31/01/2040                                             |                                     | 144 700                          | 8 931                     |
|                                                             |                                     | 117 511                          | 6,59                      | <b>PHILIPPINES</b>                                          |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     | 68 506                           | 3,85                      |
| Total Mexique                                               |                                     | 147 759                          | 8,29                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | Total Afrique du Sud                                                |                                     | 70 528                           | 3,96                      |
| <b>MAROC</b>                                                |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement philippin</b>  |                                     |                                  |                           | <b>SRI LANKA</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 5,325 % éch. 24/06/2036                                     | \$                                  | 8 400                            | 0,47                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OCP S.A.</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                              |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement sri-lankais</b>        |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 23/06/2051                                     | \$                                  | 2 200                            | 1 784                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | 3,100 % éch. 15/01/2030                                             | \$                                  | 3 700                            | 3 780                     |
| <b>PAYS-BAS</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement polonais</b>   |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/06/2035                                             |                                     | 4 870                            | 4 075                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 25/08/2036 (f)                                 | PLN                                 | 8 615                            | 0,12                      | 3,600 % éch. 15/05/2036                                             |                                     | 257                              | 259                       |
| Ardshinbank CJSC Via Dilijan Finance BV                     |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 25/07/2030 (k)                                 | 58 100                              | 15 470                           | 0,87                      | 3,600 % éch. 15/02/2038                                             |                                     | 514                              | 521                       |
| 6,000 % éch. 22/01/2031                                     |                                     | 4 000                            | 3 996                     | 4,750 % éch. 25/07/2029 (k)                                 | 30 200                              | 8 148                            | 0,46                      | Total Sri Lanka                                                     |                                     | 8 635                            | 0,48                      |
| Douro Finance BV                                            |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 25/01/2030 (k)                                 | 23 300                              | 6 326                            | 0,35                      | <b>SUPRANATIONALES</b>                                              |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 04/06/2031                                     | €                                   | 2 400                            | 2 424                     | 5,000 % éch. 25/10/2035                                     | 9 900                               | 2 595                            | 0,14                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| JAB Holdings BV                                             |                                     |                                  |                           | Total Pologne                                               |                                     | 34 641                           | 1,94                      | <b>Banque Ouest Africaine de Développement</b>                      |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 28/05/2051 (k)                                 | \$                                  | 2 500                            | 1 736                     | <b>QATAR</b>                                                |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 14/10/2040                                             | €                                   | 2 000                            | 2 192                     |
|                                                             |                                     | 8 156                            | 0,46                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>Banque européenne pour la reconstruction et le développement</b> |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                      |                                     |                                  |                           | <b>QatarEnergy</b>                                          |                                     |                                  |                           | 6,050 % éch. 08/05/2029                                             | AZN                                 | 6 700                            | 3 941                     |
| <b>Veon Amsterdam</b>                                       |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 23/06/2029                                     | \$                                  | 5 400                            | 0,30                      | 6,060 % éch. 02/12/2029                                             |                                     | 13 250                           | 7 794                     |
| 7,924 % éch. 25/03/2027                                     |                                     | 1 700                            | 1 698                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/05/2031                                             |                                     | 5 500                            | 3 235                     |
| Total Pays-Bas                                              |                                     | 9 854                            | 0,55                      | <b>Obligation internationale du gouvernement qatari</b>     |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 05/03/2029                                             |                                     | 6 800                            | 4 068                     |
| <b>NIGERIA</b>                                              |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                                     |                                     | 9 700                            | 0,55                      | <b>Société financière internationale</b>                            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | Total Qatar                                                 |                                     | 15 119                           | 0,85                      | 6,250 % éch. 15/06/2030                                             |                                     | 7 648                            | 4 499                     |
| <b>Dangote Fertiliser Ltd.</b>                              |                                     |                                  |                           | <b>ROUMANIE</b>                                             |                                     |                                  |                           | Total Supranationales                                               |                                     | 25 729                           | 1,44                      |
| 7,750 % éch. 05/05/2031                                     |                                     | 2 700                            | 2 718                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>TURQUIE</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                      |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement roumain</b>    |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| <b>Bank of Industry Ltd.</b>                                |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 28/01/2032 (k)                                 | €                                   | 1 100                            | 0,06                      | <b>QNB Bank A/S</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,895 % éch. 23/08/2027                                     | €                                   | 1 875                            | 2 139                     | 2,000 % éch. 14/04/2033 (k)                                 |                                     | 1 100                            | 0,06                      | 5,875 % éch. 11/02/2031                                             | \$                                  | 6 000                            | 5 839                     |
| Total Nigeria                                               |                                     | 4 857                            | 0,27                      | 5,125 % éch. 24/09/2031                                     |                                     | 400                              | 0,03                      | <b>Turkish Airlines Pass-Through Trust</b>                          |                                     |                                  |                           |
| <b>PAKISTAN</b>                                             |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 30/05/2032 (k)                                 |                                     | 1 100                            | 0,07                      | 4,200 % éch. 15/09/2028                                             |                                     | 157                              | 156                       |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/05/2037 (k)                                 |                                     | 1 500                            | 0,09                      |                                                                     |                                     | 5 995                            | 0,34                      |
| <b>Pakistan Water &amp; Power Development Authority</b>     |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 18/09/2033 (k)                                 |                                     | 1 500                            | 0,10                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 04/06/2031                                     | \$                                  | 3 800                            | 3 724                     | 6,500 % éch. 07/10/2045 (k)                                 |                                     | 1 800                            | 0,12                      | <b>SOCAR Turkey Enerji A/S</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                             |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 11/07/2039                                     |                                     | 1 000                            | 0,07                      | 5,558 % éch. 11/08/2026                                             | €                                   | 2 800                            | 3 198                     |
| <b>PANAMA</b>                                               |                                     |                                  |                           | Total Roumanie                                              |                                     | 10 692                           | 0,60                      | <b>Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.</b>                              |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                      |                                     |                                  |                           | 5,401 % éch. 15/12/2028                                             |                                     | 1 000                            | 1 148                     |
| <b>Generadora de Gatun S.A.</b>                             |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     | 4 346                            | 0,24                      |
| 6,874 % éch. 30/09/2044                                     |                                     | 6 100                            | 6 305                     | <b>SÉNÉGAL</b>                                              |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>PARAGUAY</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement turc</b>               |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement sénégalais</b> |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 19/08/2026                                            | TRY                                 | 7 400                            | 159                       |
| <b>Obligation internationale du gouvernement paraguayen</b> |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 13/03/2028                                     | €                                   | 2 267                            | 1 455                     | 40,760 % éch. 17/05/2028                                            |                                     | 106 400                          | 2 302                     |
| 7,900 % éch. 09/02/2031                                     | PYG                                 | 1 395 000                        | 221                       |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     | 2 461                            | 0,14                      |
| 8,500 % éch. 04/03/2035                                     |                                     | 35 916 000                       | 5 733                     | <b>SERBIE</b>                                               |                                     |                                  |                           | Total Turquie                                                       |                                     | 12 802                           | 0,72                      |
| 8,500 % éch. 04/04/2038                                     |                                     | 10 154 000                       | 1 608                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>UKRAINE</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| Total Paraguay                                              |                                     | 7 562                            | 0,42                      | <b>Telecommunications Co. Telekom Srbija AD Belgrade</b>    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                             |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 18/05/2031                                     | \$                                  | 4 000                            | 3 993                     | <b>Obligation internationale du gouvernement ukrainien</b>          |                                     |                                  |                           |
|                                                             |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 01/02/2030                                             | \$                                  | 3 100                            | 2 232                     |
|                                                             |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  | 0,13                      |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                   |                          |      |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|--------------------------|------|--|
| 0,000 % éch. 01/02/2034                                                                 | \$ 4 726                            | \$ 2 682                         | 0,15                      | Ziraat Bank                                                                             |                                     |                                  |                           | 24,050 % éch.     |                                     |                                  |                           |                                   |                          |      |  |
| 0,000 % éch. 01/02/2035                                                                 | 3 000                               | 1 810                            | 0,10                      | 6,764 % éch. 15/06/2034                                                                 | \$ 1 900                            | \$ 1 935                         | 0,11                      | 20/10/2026 (d)(e) | EGP                                 | 44 700                           | \$ 849                    | 0,05                              |                          |      |  |
| 0,000 % éch. 01/02/2036 (k)                                                             | 3 000                               | 1 808                            | 0,10                      |                                                                                         |                                     | 5 685                            | 0,32                      | 24,060 % éch.     |                                     | 6 000                            | 114                       | 0,01                              |                          |      |  |
| Total Ukraine                                                                           |                                     | 8 532                            | 0,48                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           | 24,200 % éch.     |                                     |                                  |                           |                                   |                          |      |  |
| ÉMIRATS ARABES UNIS                                                                     |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 22/09/2026 (d)(e) |                                     | 49 000                           | 947                       | 0,05                              |                          |      |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | IndyMac Mortgage Loan Trust                                                             |                                     |                                  |                           | 22/09/2026 (d)(e) |                                     | 99 750                           | 1 929                     | 0,11                              |                          |      |  |
| Emirates NBD Bank PJSC                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/11/2036                                                                 | 516                                 | 535                              | 0,03                      | 24,550 % éch.     |                                     | 114 150                          | 2 142                     | 0,12                              |                          |      |  |
| 5,125 % éch. 29/06/2031                                                                 | 9 900                               | 9 900                            | 0,56                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                         |                                     |                                  |                           | 10/11/2026 (d)(e) |                                     | 592 025                          | 11 108                    | 0,62                              |                          |      |  |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                                               |                                     |                                  |                           | Obligations du Trésor américain                                                         |                                     |                                  |                           | 10/11/2026 (d)(e) |                                     |                                  | 21 968                    | 1,23                              |                          |      |  |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                                                                 | 15 000                              | 15 022                           | 0,84                      | 1,750 % éch. 15/08/2041                                                                 |                                     |                                  |                           | 36 700            | 24 611                              | 1,38                             |                           |                                   |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     | 24 922                           | 1,40                      | 2,375 % éch. 15/02/2042                                                                 |                                     |                                  |                           | 10 500            | 7 662                               | 0,43                             |                           |                                   |                          |      |  |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/08/2044                                                                 |                                     |                                  |                           | 5 400             | 4 885                               | 0,27                             | BONS DU TRÉSOR HONGROIS   |                                   |                          |      |  |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi                       |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/08/2045                                                                 |                                     |                                  |                           | 280               | 278                                 | 0,02                             | 6,082 % éch.              |                                   |                          |      |  |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                                                 | 5 100                               | 5 083                            | 0,28                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f)                              |                                     |                                  |                           |                   |                                     | 02/07/2026 (d)(e)                | HUF                       | 10 484 000                        | 33 677                   | 1,89 |  |
| 4,750 % éch. 22/09/2036                                                                 | 4 500                               | 4 463                            | 0,25                      | 0,625 % éch. 15/07/2032                                                                 |                                     |                                  |                           | 16 844            | 15 605                              | 0,88                             | BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN   |                                   |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     | 9 546                            | 0,53                      | Billets du Trésor américain                                                             |                                     |                                  |                           |                   |                                     | (d)(e)                           | NGN                       | 4 872 883                         | 3 184                    | 0,18 |  |
| Total Émirats arabes unis                                                               |                                     | 34 468                           | 1,93                      | 4,250 % éch. 15/08/2035                                                                 |                                     |                                  |                           | 450               | 444                                 | 0,02                             | 18,745 % éch. 19/01/2027  |                                   |                          |      |  |
| ROYAUME-UNI                                                                             |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                                                        |                                     |                                  |                           |                   | 53 485                              | 3,00                             | 18,779 % éch. 21/07/2026  |                                   |                          |      |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | Ouzbékistan                                                                             |                                     |                                  |                           | 72 175            |                                     |                                  |                           | 4,05                              | 20,537 % éch. 14/01/2027 |      |  |
| Azule Energy Finance PLC                                                                |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | (d)(e)                            |                          |      |  |
| 8,250 % éch. 22/01/2031                                                                 | 2 000                               | 2 003                            | 0,11                      | National Bank of Uzbekistan                                                             |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 20,607 % éch. 21/01/2027          |                          |      |  |
| ICBC Standard Bank PLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 05/07/2029                                                                 |                                     |                                  |                           | 1 600             | 1 707                               | 0,10                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| 20,000 % éch. 18/09/2029                                                                | UZS 41 733 000                      | 3 473                            | 0,20                      | 19,875 % éch. 05/07/2027                                                                |                                     |                                  |                           | UZS 22 910 000    | 2 019                               | 0,11                             | 20,677 % éch. 28/01/2027  |                                   |                          |      |  |
| 20,000 % éch. 13/12/2029                                                                | 31 862 000                          | 2 651                            | 0,15                      | Obligation internationale de la République d'Ouzbékistan                                |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                                          |                                     |                                  |                           | 16,625 % éch. 29/05/2027                                                                |                                     |                                  |                           | 3 150 000         | 277                                 | 0,01                             | 21,064 % éch. 13/10/2026  |                                   |                          |      |  |
| 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                                                             | \$ 5 500                            | 4 480                            | 0,25                      | Total Ouzbékistan                                                                       |                                     |                                  |                           |                   | 4 003                               | 0,22                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| Sibanye-Stillwater UK Financing PLC                                                     |                                     |                                  |                           | VENEZUELA                                                                               |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 21,150 % éch. 20/10/2026          |                          |      |  |
| 6,250 % éch. 15/11/2031                                                                 | 1 000                               | 990                              | 0,06                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | (d)(e)                            |                          |      |  |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                                                    |                                     |                                  |                           | Petroleos de Venezuela S.A.                                                             |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  | 21,186 % éch. 07/07/2026  |                                   |                          |      |  |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                                                                 | £ 160                               | 226                              | 0,01                      | 5,375 % éch. 12/04/2027 ^                                                               |                                     |                                  |                           | \$ 600            | 221                                 | 0,01                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     | 13 823                           | 0,78                      | 6,000 % éch. 16/05/2024 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 7 440             | 2 805                               | 0,16                             | 21,265 % éch. 20/10/2026  |                                   |                          |      |  |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/11/2026 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 7 340             | 2 771                               | 0,16                             | 21,270 % éch. 01/09/2026  |                                   |                          |      |  |
| Canada Square Funding PLC                                                               |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 17/05/2035 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 12 845            | 5 746                               | 0,32                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| 4,597 % éch. 17/01/2059                                                                 | 195                                 | 258                              | 0,01                      | 12,750 % éch. 17/02/2022 ^                                                              |                                     |                                  |                           | 2 200             | 1 102                               | 0,06                             | 21,310 % éch. 20/10/2026  |                                   |                          |      |  |
| Rochester Financing PLC                                                                 |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | (d)(e)                            |                          |      |  |
| 5,046 % éch. 18/12/2044                                                                 | 115                                 | 152                              | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement vénézuélien                                   |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  | 21,333 % éch. 15/09/2026  |                                   |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     | 410                              | 0,02                      | 7,000 % éch. 31/03/2038 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 70                | 31                                  | 0,00                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| Total Royaume-Uni                                                                       |                                     | 14 233                           | 0,80                      | 7,650 % éch. 21/04/2025 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 100               | 45                                  | 0,00                             | 21,380 % éch. 03/11/2026  |                                   |                          |      |  |
| ÉTATS-UNIS                                                                              |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 13/10/2024 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 1 030             | 468                                 | 0,03                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 15/09/2027 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 6 270             | 3 096                               | 0,17                             | 21,445 % éch. 27/10/2026  |                                   |                          |      |  |
| Aames Mortgage Investment Trust                                                         |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 07/05/2028 ^                                                               |                                     |                                  |                           | 2 050             | 989                                 | 0,06                             | 21,488 % éch. 03/11/2026  |                                   |                          |      |  |
| 5,068 % éch. 25/06/2035                                                                 | \$ 504                              | 462                              | 0,03                      | 11,950 % éch. 05/08/2031 ^                                                              |                                     |                                  |                           | 600               | 327                                 | 0,02                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                     |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 23/08/2022 ^                                                              |                                     |                                  |                           | 4 900             | 2 744                               | 0,15                             | 21,702 % éch. 18/08/2026  |                                   |                          |      |  |
| 4,363 % éch. 25/10/2036                                                                 | 549                                 | 325                              | 0,02                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                   | 7 700                               | 0,43                             | 21,702 % éch. 18/08/2026  |                                   |                          |      |  |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                                     |                                     |                                  |                           | Total Venezuela                                                                         |                                     |                                  |                           |                   | 20 345                              | 1,14                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| 4,033 % éch. 25/07/2036                                                                 | 201                                 | 183                              | 0,01                      | ILES VIERGES BRITANNIQUES                                                               |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 21,380 % éch. 03/11/2026          |                          |      |  |
| 4,183 % éch. 25/10/2036                                                                 | 20                                  | 20                               | 0,00                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | (d)(e)                            |                          |      |  |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                                  |                                     |                                  |                           | Champion Path Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  | 21,445 % éch. 27/10/2026  |                                   |                          |      |  |
| 4,738 % éch. 25/07/2034                                                                 | 15                                  | 16                               | 0,00                      | 4,850 % éch. 27/01/2028                                                                 |                                     |                                  |                           | 3 200             | 3 104                               | 0,18                             | 21,488 % éch. 03/11/2026  |                                   |                          |      |  |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust                                   |                                     |                                  |                           | Studio City Finance Ltd.                                                                |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| 4,243 % éch. 25/07/2036                                                                 | 900                                 | 883                              | 0,05                      | 6,500 % éch. 15/01/2028                                                                 |                                     |                                  |                           | 3 100             | 3 100                               | 0,17                             | 21,702 % éch. 18/08/2026  |                                   |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     | 1 889                            | 0,11                      | Total Iles Vierges britanniques                                                         |                                     |                                  |                           |                   | 6 204                               | 0,35                             | (d)(e)                    |                                   |                          |      |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           | INSTRUMENTS À COURT TERME                                                               |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 7,692 % éch.                      |                          |      |  |
| RD Michigan Property Owner LLC                                                          |                                     |                                  |                           | BILLETS À COURT TERME                                                                   |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 31/03/2027 (d)(e)                 |                          |      |  |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                                                 | 3 500                               | 3 490                            | 0,19                      | Kona Spc Ltd.                                                                           |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  | 1 496 000                 |                                   |                          |      |  |
| Venture Global LNG, Inc.                                                                |                                     |                                  |                           | 5,718 % éch. 15/09/2026                                                                 |                                     |                                  |                           | € 3 200           | 3 660                               | 0,21                             |                           |                                   |                          |      |  |
| 6,375 % éch. 15/12/2034                                                                 | 3 600                               | 3 540                            | 0,20                      | BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN                                                                 |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 107 160                           |                          |      |  |
| 6,625 % éch. 15/06/2036                                                                 | 3 600                               | 3 551                            | 0,20                      | 23,650 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 203 240                           |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     | 10 581                           | 0,59                      | 13/10/2026 (d)(e)                                                                       |                                     |                                  |                           | EGP               | 16 800                              | 320                              | 0,02                      | Total des Valeurs mobilières      |                          |      |  |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                         |                                     |                                  |                           | 24,000 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | \$ 1 470 779                      |                          |      |  |
| Ministère des finances de l'Angola                                                      |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (d)(e)                                                                       |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | 82,53                             |                          |      |  |
| 9,388 % éch. 16/02/2027                                                                 | 1 400                               | 1 403                            | 0,08                      | 24,001 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | ACTIONS                           |                          |      |  |
| Stepstone Group Midco GmbH                                                              |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (d)(e)                                                                       |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | FONDS D'INVESTISSEMENT            |                          |      |  |
| 6,885 % éch. 26/04/2032                                                                 | € 2 500                             | 2 347                            | 0,13                      | 13/10/2026 (d)(e)                                                                       |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (d)(e)                                                                       |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | PIMCO Select Funds plc -          |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | Fonds PIMCO US Dollar             |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | Short-Term Floating               |                          |      |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           | NAV Fund (h)                      |                          |      |  |

| DESCRIPTION                             | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>         |         |                                  |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds                  |         |                                  |                           |
| PIMCO US Dollar                         |         |                                  |                           |
| Short Maturity                          |         |                                  |                           |
| UCITS ETF (h)                           | 300     | \$ 30                            | 0,00                      |
| <b>Total des Fonds d'investissement</b> |         | <b>\$ 172 674</b>                | <b>9,69</b>               |

**CONTRATS DE MISE EN PENSION**

| Contrepartie                                 | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                 | Garantie<br>(reçue) | Contrats de<br>mise en<br>pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOS                                          | 3,720 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 137 200              | Billets du Trésor américain 3,500 % échéance 30/09/2029     | \$ (139 831)        | \$ 137 200                                        | \$ 137 214                                                                     | 7,70                   |
| BPS                                          | 3,690           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 23 900                  | Obligations du Trésor américain 3,000 % échéance 15/08/2048 | (24 199)            | 23 900                                            | 23 902                                                                         | 1,34                   |
| <b>Total des Contrats de mise en pension</b> |                 |                      |                    |                         |                                                             | <b>\$ (164 030)</b> | <b>\$ 161 100</b>                                 | <b>\$ 161 116</b>                                                              | <b>9,04</b>            |

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

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

**CONTRATS À TERME STANDARDISÉS**

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 3                     | \$ (1)                                  | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 46                    | (71)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 1 376                 | 294                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 1 940                 | 427                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 820                   | 1 055                                   | 0,06                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026              | 5                     | (14)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026              | 256                   | (850)                                   | (0,05)                 |
|                                                                                               |       |                      |                       | <b>\$ 840</b>                           | <b>0,05</b>            |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>             |       |                      |                       | <b>\$ 840</b>                           | <b>0,05</b>            |

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)**

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

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>**

| Indice/Tranches                              | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans               | 1,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 334 900                          | \$ 1 773                                | 0,10                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans               | 1,000                   | 20/06/2031         | 25 000                              | 102                                     | 0,01                   |
| Indice iTraxx Asia Ex-Japan 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 215 200                             | 628                                     | 0,03                   |
|                                              |                         |                    |                                     | <b>\$ 2 503</b>                         | <b>0,14</b>            |

**SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT**

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %      | 18/03/2031         | £ 10 720             | \$ (49)                                 | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 18/03/2036         | 6 740                | 202                                     | 0,01                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                     | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,250        | 16/09/2031         | INR 2 369 890        | 350                                     | 0,02                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 17/06/2028         | ¥ 35 630 000         | (410)                                   | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 16/09/2028         | 23 575 000           | (252)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | SGD 138 700          | (1 552)                                 | (0,09)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,250        | 16/09/2028         | THB 756 100          | (31)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,500        | 16/09/2031         | 211 190              | (45)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750        | 16/09/2031         | 996 900              | (572)                                   | (0,03)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>                     | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000        | 16/09/2036         | 167 500              | 32                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250        | 16/12/2050         | \$ 1 500             | 757                                     | 0,04                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250        | 16/06/2051         | 4 500                | 1 419                                   | 0,08                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500        | 18/12/2029         | 4 100                | 261                                     | 0,02                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 17/06/2028         | 246 300              | (19)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                  | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 16/09/2028         | 25 800               | 34                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 19/03/2029         | 48 400               | (655)                                   | (0,04)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 19/03/2030         | 49 700               | 879                                     | 0,05                   |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 %   | 18/06/2029      | \$ 800            | \$ (2)                            | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2030      | 15 525            | (439)                             | (0,02)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2034      | 5 300             | 115                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2034      | 1 400             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2035      | 8 600             | (76)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 20/12/2053      | 8 900             | 218                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2055      | 12 600            | (311)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2055      | 13 250            | 758                               | 0,04                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      | 53 400            | (954)                             | (0,05)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 22 300            | 293                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      | 1 300             | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/12/2054      | 600               | 44                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/09/2055      | 43 100            | (1 600)                           | (0,09)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 17/01/2034      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,648     | 08/01/2034      | 200               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684     | 03/01/2034      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 23/01/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,738     | 23/01/2034      | 200               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2027      | 66 800            | (711)                             | (0,04)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 6 400             | 89                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 44 000            | 1 102                             | 0,06                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 31 600            | (1 197)                           | (0,07)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      | 124 800           | 2 653                             | 0,15                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 13 100            | (314)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 4 700             | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 100 000           | 2 354                             | 0,13                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 02/01/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 4 100             | (64)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 11 500            | (562)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 3 600             | 181                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/06/2036      | 57 040            | (460)                             | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 16/09/2036      | 37 500            | (106)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2036      | 1 100             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2055      | 2 900             | 106                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830     | 12/10/2053      | 100               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854     | 29/12/2033      | 400               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 21/02/2034      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 10/07/2034      | 900               | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 30/09/2026      | 90 900            | 201                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 22/02/2029      | 900               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 19/12/2033      | 300               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,994     | 02/07/2034      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 15 900            | (538)                             | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/06/2046      | 50 100            | 664                               | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2056      | 13 100            | 62                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 04/10/2033      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 15/12/2033      | 300               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060     | 02/07/2034      | 1 500             | (6)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,078     | 29/04/2034      | 500               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 05/06/2034      | 500               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,086     | 13/01/2055      | 23 700            | (613)                             | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 30/04/2034      | 900               | 11                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,100     | 31/03/2027      | 92 300            | (791)                             | (0,04)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,100     | 31/08/2029      | 1 600             | (26)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,130     | 03/05/2034      | 600               | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,132     | 13/01/2030      | 18 200            | 198                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 12/10/2033      | 300               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155     | 02/10/2033      | 400               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170     | 03/10/2033      | 1 200             | 25                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175     | 10/10/2033      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220     | 20/10/2033      | 200               | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230     | 23/10/2033      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 22/11/2033      | 300               | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393     | 25/10/2033      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435     | 01/11/2033      | 200               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 01/11/2033      | 400               | 16                                | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 6,962     | 04/01/2027      | BRL 8 300         | (342)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 8,589     | 04/01/2027      | 11 900            | 432                               | 0,02                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,795     | 04/01/2027      | 37 100            | (624)                             | (0,03)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,145    | 04/01/2027      | 2 500             | (62)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,231    | 04/01/2027      | 9 400             | (224)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,472    | 04/01/2027      | 28 200            | (608)                             | (0,03)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,602    | 04/01/2027      | 45 800            | (729)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 10,985    | 02/01/2029      | 2 500             | 36                                | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,083    | 04/01/2027      | 22 200            | (373)                             | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,439    | 04/01/2027      | 15 500            | (157)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,449    | 04/01/2027      | 15 500            | (156)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,523    | 02/01/2029      | 38 700            | (523)                             | (0,03)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,132    | 04/01/2027      | 21 700            | (132)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,569    | 02/01/2029      | 88 300            | (342)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an               | 12,716    | 02/01/2029      | 27 000            | 127                               | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,750    | 02/01/2029      | 49 500            | (276)                             | (0,02)              |



| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 12,780 %  | 02/01/2029      | BRL 85 100        | \$ 449                            | 0,03                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 12,910    | 02/01/2031      | 117 700           | (716)                             | (0,04)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 12,981    | 04/01/2027      | 27 000            | (31)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,030    | 02/01/2029      | 125 600           | (638)                             | (0,04)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,041    | 02/01/2031      | 15 900            | (80)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,056    | 02/01/2029      | 156 000           | (747)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 13,156    | 02/01/2031      | 28 400            | 122                               | 0,01                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,235    | 02/01/2035      | 124 100           | (506)                             | (0,03)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,245    | 02/01/2031      | 15 200            | (58)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,250    | 02/01/2031      | 11 500            | (37)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,255    | 02/01/2031      | 15 400            | (58)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 13,285    | 02/01/2029      | 22 100            | 86                                | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,291    | 02/01/2029      | 75 600            | (311)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 13,296    | 02/01/2031      | 188 700           | 676                               | 0,04                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CDI BRL à un an                   | 13,300    | 02/01/2031      | 384 900           | 607                               | 0,03                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,315    | 02/01/2031      | 211 900           | (545)                             | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CDI BRL à un an                   | 13,340    | 02/01/2029      | 137 700           | 352                               | 0,02                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CDI BRL à un an                   | 13,435    | 02/01/2029      | 58 700            | 129                               | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,435    | 02/01/2031      | 13 900            | (39)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,440    | 02/01/2031      | 13 900            | (39)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,560    | 02/01/2031      | 59 400            | (128)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,564    | 02/01/2031      | 101 000           | (225)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,605    | 02/01/2031      | 43 300            | (87)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,610    | 02/01/2031      | 215 000           | (413)                             | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,681    | 02/01/2031      | 75 600            | (82)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,698    | 02/01/2031      | 33 100            | (50)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,790    | 02/01/2031      | 156 000           | (146)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 13,844    | 02/01/2029      | 154 600           | 228                               | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,882    | 02/01/2031      | 73 300            | (37)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,979    | 02/01/2031      | 237 900           | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,140    | 02/01/2029      | 79 900            | (35)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,140    | 02/01/2031      | 56 100            | 38                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,153    | 04/01/2027      | 127 300           | 54                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,247    | 02/01/2031      | 58 800            | (68)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,370    | 02/01/2029      | 83 600            | 97                                | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,498    | 02/01/2031      | 134 100           | 304                               | 0,02                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,505    | 02/01/2031      | 150 200           | (346)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,514    | 02/01/2031      | 128 600           | (301)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,524    | 02/01/2029      | 6 600             | (10)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,620    | 02/01/2029      | 212 300           | 413                               | 0,02                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,695    | 02/01/2029      | 182 800           | 399                               | 0,02                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 17/06/2028      | CAD 102 900       | (250)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 17/06/2036      | 23 300            | 211                               | 0,01                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 16/09/2031      | CNY 93 970        | (122)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,060     | 16/08/2029      | COP 26 523 700    | 139                               | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,080     | 02/02/2027      | 1 622 900         | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,090     | 28/04/2028      | 1 750 200         | 37                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,130     | 28/04/2028      | 618 500           | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,140     | 28/04/2028      | 1 855 800         | 39                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,340     | 10/09/2029      | 34 644 500        | (880)                             | (0,05)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,620     | 26/02/2034      | 3 210 600         | (117)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,020     | 03/11/2027      | 35 000 000        | 471                               | 0,03                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,260     | 02/05/2030      | 21 682 500        | (436)                             | (0,02)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,560     | 30/03/2027      | 4 424 200         | (28)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,560     | 18/06/2030      | 34 000 000        | 567                               | 0,03                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,570     | 20/03/2030      | 18 678 700        | 303                               | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,830     | 31/03/2028      | 4 898 000         | 54                                | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,933     | 22/08/2029      | 26 362 800        | 344                               | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,100     | 09/02/2033      | 22 600 000        | 296                               | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,140     | 28/04/2028      | 3 977 000         | (42)                              | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,800     | 17/01/2028      | 9 809 000         | (68)                              | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,700    | 17/06/2031      | 3 436 800         | 20                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,710    | 17/06/2031      | 3 347 400         | 20                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,730    | 17/06/2031      | 3 421 900         | 21                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,740    | 17/06/2031      | 104 555 100       | 34                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,745    | 17/06/2031      | 6 843 900         | 44                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,770    | 17/06/2031      | 6 843 900         | 46                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,200    | 17/06/2029      | 5 132 900         | 21                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,210    | 17/06/2029      | 5 281 700         | 22                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,250    | 17/06/2028      | 30 482 700        | 39                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,425    | 17/06/2028      | 7 290 200         | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,450    | 17/06/2028      | 22 688 800        | 42                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,550    | 17/06/2028      | 21 796 200        | 52                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,634    | 17/06/2028      | 46 370 300        | 131                               | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 12,000    | 17/06/2027      | 166 197 400       | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 12,220    | 17/06/2027      | 14 506 000        | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 12,230    | 17/06/2027      | 14 506 000        | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 12,250    | 17/06/2027      | 29 012 000        | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 12,340    | 17/06/2027      | 27 093 800        | 18                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | KORIBOR KRW à 3 mois              | 3,500     | 16/09/2036      | KRW 35 900 800    | (204)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | KORIBOR KRW à 3 mois              | 3,750     | 16/09/2028      | 151 759 000       | 301                               | 0,02                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | KLIBOR MYR à 3 mois               | 3,500     | 16/09/2031      | MYR 86 320        | (55)                              | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | STIBOR SEK à 3 mois     | 2,021 %   | 07/10/2029      | SEK 150 700       | \$ 25                             | 0,00                |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois     | 2,298     | 07/10/2029      | 149 400           | 145                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,510     | 26/05/2031      | ZAR 503 400       | 57                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,522     | 29/01/2031      | 24 600            | (49)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,610     | 28/04/2031      | 54 900            | (87)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,640     | 02/04/2031      | 53 400            | (78)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,673     | 14/04/2031      | 52 000            | (72)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,715     | 26/02/2031      | 402 500           | (21)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,770     | 10/03/2028      | 883 800           | 34                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,770     | 12/11/2030      | 80 700            | (104)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,860     | 15/10/2030      | 23 900            | (25)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,885     | 04/02/2031      | 400 200           | 178                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,920     | 06/03/2031      | 50 700            | 54                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,040     | 22/09/2030      | 92 286            | 60                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,040     | 23/12/2030      | 4 750             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,070     | 04/12/2030      | 114 500           | 107                               | 0,01                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,080     | 31/12/2030      | 31 900            | 33                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,091     | 17/02/2036      | 87 300            | 124                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,155     | 26/11/2030      | 22 400            | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,160     | 26/11/2030      | 155 400           | 130                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,180     | 04/12/2030      | 53 820            | (20)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,220     | 02/09/2030      | 122 500           | 60                                | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,270     | 26/08/2030      | 92 700            | 31                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,310     | 02/09/2030      | 79 200            | (30)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,310     | 02/10/2030      | 107 500           | 27                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,330     | 10/07/2030      | 213 400           | 32                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,360     | 09/03/2031      | 118 800           | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,370     | 26/08/2030      | 41 700            | 5                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,381     | 12/01/2036      | 14 600            | (21)                              | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,410     | 02/10/2030      | 46 810            | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,560     | 22/09/2030      | 65 900            | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,570     | 27/05/2030      | 31 500            | 18                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,650     | 20/06/2030      | 69 888            | (156)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,700     | 08/06/2028      | 151 800           | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,700     | 18/06/2030      | 164 580           | (82)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,775     | 18/03/2030      | 75 000            | (70)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,810     | 27/03/2030      | 157 400           | (126)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,810     | 20/06/2030      | 32 027            | 33                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,860     | 18/06/2030      | 75 000            | 85                                | 0,01                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,950     | 07/05/2036      | 26 600            | 24                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,080     | 24/04/2036      | 211 800           | 158                               | 0,01                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,599     | 05/06/2029      | 337 200           | (145)                             | (0,01)              |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,770     | 12/03/2035      | 125 800           | 349                               | 0,02                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 1,947     | 23/11/2027      | 999 000           | 40                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 1,965     | 24/11/2027      | 851 000           | 34                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 2,183     | 04/12/2027      | 2 661 000         | (96)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 3,530     | 06/07/2026      | 1 995 000         | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,000     | 06/07/2028      | 1 019 000         | 12                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,490     | 01/10/2028      | 2 311 000         | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,590     | 01/10/2029      | 5 161 000         | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,676     | 01/09/2030      | 459 000           | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,710     | 01/09/2030      | 7 314 000         | (22)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,810     | 01/10/2034      | 5 200 000         | (62)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,880     | 17/06/2031      | 23 882 300        | 191                               | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,935     | 29/01/2034      | 8 000 000         | (20)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,970     | 18/06/2032      | 17 189 200        | (173)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,030     | 23/02/2034      | 709 200           | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,050     | 01/04/2033      | 2 200 000         | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,125     | 14/03/2030      | 3 744 100         | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 17/06/2031      | 1 998 000         | 25                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,180     | 01/10/2028      | 790 000           | (15)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,190     | 17/06/2031      | 1 609 000         | 37                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,240     | 01/09/2030      | 1 286 000         | (35)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 17/06/2031      | 552 000           | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,306     | 17/06/2031      | 8 483 000         | (246)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,360     | 27/03/2028      | 1 914 900         | (37)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,365     | 23/01/2030      | 5 584 400         | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,370     | 01/10/2028      | 3 136 000         | (75)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,470     | 01/09/2030      | 460 000           | (17)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,470     | 23/12/2034      | 3 714 000         | 119                               | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,548     | 10/04/2028      | 833 000           | 20                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,570     | 01/10/2028      | 245 000           | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,600     | 12/12/2027      | 1 803 000         | (33)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,635     | 12/12/2027      | 3 695 000         | (72)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,700     | 17/05/2028      | 1 602 100         | (43)                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,020     | 02/03/2029      | 190 000           | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,070     | 28/02/2028      | 3 391 700         | (118)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,194     | 10/03/2028      | 1 681 200         | 63                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,223     | 13/03/2028      | 680 300           | 26                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,255     | 13/03/2028      | 478 200           | 18                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,270     | 02/03/2027      | 415 700           | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,330     | 09/03/2028      | 526 800           | 21                                | 0,00                |



| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,360 %   | 25/05/2027      | CLP 24 600        | \$ 0                              | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,386     | 24/05/2027      | 1 861 000         | 38                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,440     | 07/03/2028      | 1 344 000         | 57                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,590     | 21/03/2027      | 4 540 300         | 37                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,805     | 06/03/2027      | 1 852 000         | 46                                | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 7,000     | 27/09/2032      | 1 785 800         | 244                               | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 1,025     | 29/07/2030      | CZK 147 600       | 148                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 1,725     | 22/07/2026      | 23 800            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 1,815     | 28/01/2031      | 34 200            | 165                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,130     | 09/04/2030      | 196 100           | (281)                             | (0,02)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,480     | 15/02/2034      | 21 500            | (50)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,490     | 18/01/2032      | 10 600            | 16                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,580     | 25/10/2029      | 150 800           | 18                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,636     | 09/02/2031      | 1 186 400         | (43)                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,675     | 08/01/2029      | 62 600            | (31)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,680     | 03/03/2027      | 78 400            | (41)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,680     | 29/01/2031      | 464 700           | (53)                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,705     | 12/08/2030      | 11 490            | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,735     | 05/08/2030      | 125 100           | 33                                | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,767     | 17/10/2030      | 3 800             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,777     | 15/10/2030      | 34 290            | 11                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,845     | 05/03/2031      | 225 400           | 37                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,850     | 03/03/2036      | 170 400           | (217)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,920     | 09/02/2031      | 44 700            | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,930     | 22/05/2036      | 37 300            | (23)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,999     | 14/11/2030      | 18 000            | (14)                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,018     | 25/11/2030      | 401 800           | 364                               | 0,02                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,040     | 06/02/2031      | 564 200           | (374)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,049     | 12/12/2030      | 48 100            | (41)                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,071     | 22/04/2031      | 103 700           | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,164     | 14/03/2027      | 73 600            | (12)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,220     | 14/03/2027      | 73 500            | (13)                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 18/04/2029      | 108 000           | (104)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,300     | 18/03/2027      | 143 400           | 58                                | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,310     | 15/03/2027      | 19 100            | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,320     | 15/03/2027      | 7 200             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,395     | 10/03/2036      | 14 900            | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,470     | 25/05/2031      | 143 800           | 80                                | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,505     | 16/03/2036      | 14 200            | (18)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,523     | 01/12/2035      | 301 000           | 143                               | 0,01                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,530     | 31/12/2035      | 44 500            | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,560     | 14/07/2032      | 111 300           | (168)                             | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,638     | 03/10/2033      | 15 200            | (16)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,700     | 23/03/2036      | 9 100             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,720     | 02/04/2036      | 14 100            | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,740     | 28/02/2033      | 183 400           | 222                               | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 5,040     | 17/04/2028      | 27 900            | 26                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 5,100     | 18/04/2028      | 11 800            | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 5,606     | 28/06/2027      | 54 800            | 39                                | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,550     | 15/12/2040      | € 300             | 138                               | 0,01                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,248     | 30/09/2029      | 4 500             | (15)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | 132 800           | 495                               | 0,03                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,287     | 25/11/2029      | 5 900             | 20                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 43 100            | (610)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,650     | 08/01/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,670     | 03/04/2034      | 300               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 44 100            | (474)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 03/01/2029      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 04/03/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,780     | 02/05/2029      | 1 400             | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,818     | 26/06/2029      | 3 900             | 81                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,827     | 06/05/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,880     | 19/12/2028      | 200               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,890     | 22/12/2033      | 200               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,910     | 29/12/2033      | 300               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,920     | 13/12/2028      | 500               | (10)                              | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,950     | 12/06/2029      | 700               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,970     | 15/12/2033      | 1 500             | (37)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,990     | 08/12/2033      | 600               | (16)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,148     | 20/11/2033      | 100               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,250     | 06/11/2033      | 500               | (24)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,255     | 22/11/2028      | 200               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,270     | 08/11/2028      | 600               | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 1,760     | 21/01/2030      | HUF 380 000       | 148                               | 0,01                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 2,680     | 29/06/2031      | 7 790 100         | 2 018                             | 0,11                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,670     | 24/10/2035      | 762 000           | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,675     | 24/10/2035      | 507 500           | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,685     | 24/10/2035      | 854 300           | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 4,690     | 24/11/2032      | 582 700           | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 5,500     | 04/03/2027      | 2 382 600         | (26)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 5,750     | 17/06/2031      | 4 596 000         | (693)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 5,770     | 25/07/2029      | 1 503 600         | (236)                             | (0,01)              |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,070 %   | 15/04/2036      | HUF 2 032 500     | \$ 389                            | 0,02                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,110     | 30/12/2030      | 482 800           | (113)                             | (0,01)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,140     | 15/02/2034      | 218 000           | 52                                | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,190     | 18/11/2030      | 1 134 050         | (328)                             | (0,02)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,250     | 09/04/2030      | 3 538 600         | 449                               | 0,03                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,280     | 18/03/2027      | 2 363 300         | 115                               | 0,01                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,319     | 03/11/2030      | 739 800           | (205)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,350     | 14/11/2030      | 751 900           | (211)                             | (0,01)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,363     | 31/01/2030      | 2 555 200         | 375                               | 0,02                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,435     | 21/11/2030      | 2 276 200         | (676)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,439     | 24/11/2030      | 690 600           | (207)                             | (0,01)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 7,000     | 30/04/2029      | 4 338 400         | 536                               | 0,03                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 8,740     | 28/04/2028      | 9 901 600         | (469)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 1,110     | 12/01/2031      | PLN 9 800         | 335                               | 0,02                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 1,165     | 28/01/2031      | 4 400             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 1,215     | 29/07/2030      | 10 300            | 288                               | 0,02                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 1,855     | 28/01/2031      | 6 000             | (151)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 2,635     | 28/10/2026      | 32 900            | (881)                             | (0,05)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 2,920     | 13/12/2031      | 89 900            | 733                               | 0,04                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,035     | 09/12/2026      | 42 000            | (115)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,750     | 17/06/2031      | 194 700           | (1 580)                           | (0,09)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,962     | 06/05/2030      | 22 100            | 36                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,065     | 24/11/2030      | 22 870            | (101)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,075     | 07/03/2027      | 28 700            | (58)                              | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,091     | 23/02/2036      | 10 400            | (28)                              | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,135     | 20/05/2036      | 6 500             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,161     | 03/03/2036      | 2 800             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,195     | 29/09/2030      | 7 000             | (60)                              | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,207     | 30/01/2036      | 2 400             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,223     | 04/02/2036      | 900               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,230     | 15/04/2036      | 5 500             | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,235     | 27/11/2035      | 1 900             | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,275     | 02/03/2036      | 5 700             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,285     | 19/12/2035      | 20 100            | 139                               | 0,01                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,340     | 12/12/2035      | 12 400            | (100)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,348     | 05/03/2036      | 4 900             | (14)                              | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,353     | 23/10/2035      | 6 500             | 57                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,356     | 17/10/2035      | 6 060             | 54                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,360     | 25/07/2028      | 12 000            | (109)                             | (0,01)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,370     | 25/11/2035      | 11 600            | 102                               | 0,01                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,370     | 05/03/2036      | 8 500             | (28)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,385     | 06/02/2036      | 5 500             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,393     | 16/10/2035      | 6 060             | 59                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,416     | 12/03/2036      | 13 300            | 55                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,430     | 10/11/2035      | 200               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,434     | 03/11/2035      | 9 000             | (94)                              | (0,01)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,440     | 19/09/2035      | 2 700             | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,445     | 22/12/2035      | 3 650             | (25)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,450     | 24/02/2036      | 5 600             | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,463     | 09/03/2036      | 5 000             | (27)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,475     | 26/11/2035      | 12 800            | (93)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,650     | 28/04/2036      | 61 300            | (544)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,665     | 27/04/2036      | 6 100             | (56)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 10/03/2036      | 900               | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,710     | 25/05/2027      | 12 000            | (24)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,723     | 01/12/2035      | 53 160            | (124)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,730     | 31/12/2035      | 7 800             | (14)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,735     | 09/10/2028      | 12 100            | (142)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,740     | 25/10/2033      | 7 100             | (124)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,794     | 25/10/2029      | 27 200            | (128)                             | (0,01)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,830     | 18/03/2027      | 17 300            | 84                                | 0,01                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,845     | 02/04/2036      | 1 700             | 23                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,895     | 17/03/2027      | 7 200             | 19                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,920     | 17/03/2027      | 15 000            | 40                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,970     | 21/03/2029      | 27 840            | 224                               | 0,01                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,155     | 25/10/2034      | 2 700             | 26                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,200     | 23/03/2036      | 1 600             | 10                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,230     | 02/04/2036      | 2 600             | 16                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,310     | 21/03/2033      | 7 400             | 32                                | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,430     | 16/03/2028      | 315 600           | 745                               | 0,04                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,300     | 25/04/2028      | 11 900            | (45)                              | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,670     | 28/06/2027      | 6 200             | 44                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,725     | 27/06/2027      | 20 700            | (149)                             | (0,01)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 6,843     | 28/06/2027      | 1 500             | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 7,310     | 30/06/2027      | 11 000            | (96)                              | (0,01)              |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      | MXN 1 235 600     | 155                               | 0,01                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,230     | 14/03/2029      | 32 100            | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,545     | 12/03/2031      | 98 200            | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | TIIE MXN à 28 jours     | 7,550     | 02/05/2031      | 55 300            | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,555     | 31/05/2029      | 118 300           | 35                                | 0,00                |
| À recevoir                       | TIIE MXN à 28 jours     | 7,555     | 24/01/2031      | 17 900            | 4                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | TIIE MXN à 28 jours     | 7,600     | 04/04/2031      | 61 800            | 16                                | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,620 %   | 18/04/2031      | MXN 178 700       | \$ 15                             | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,645     | 24/04/2031      | 33 000            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,650     | 18/04/2031      | 142 800           | (2)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours     | 7,670     | 04/04/2031      | 28 200            | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | TIIE MXN à 28 jours     | 7,681     | 05/03/2031      | 360 100           | (44)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,685     | 07/04/2031      | 148 500           | 14                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,700     | 24/12/2030      | 54 350            | 10                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,740     | 20/09/2030      | 284 100           | (202)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 12/03/2031      | 543 200           | (666)                             | (0,04)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,753     | 16/04/2030      | 151 500           | 69                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,790     | 01/04/2030      | 333 300           | (245)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours     | 7,820     | 02/05/2031      | 114 700           | 67                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      | 615 200           | 681                               | 0,04                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,150     | 04/06/2036      | 260 000           | 55                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,170     | 26/03/2031      | 174 700           | 209                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,200     | 11/06/2031      | 94 900            | (119)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,215     | 04/06/2036      | 336 500           | (131)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,295     | 11/06/2031      | 28 100            | 42                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,300     | 11/06/2031      | 509 800           | (707)                             | (0,04)              |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,318     | 04/06/2036      | 269 800           | (215)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,340     | 11/06/2031      | 79 700            | 128                               | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,500     | 04/06/2036      | 31 300            | 47                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 9,700     | 31/05/2034      | 85 500            | (401)                             | (0,02)              |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (5 756)                        | (0,32)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (3 253)                        | (0,18)              |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - EUR contre BRL hors cote | BRL 5,850       | 19/08/2026        | 21 622                           | \$ 317 | \$ 108       | 0,01                |
|              | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 06/08/2026        | 2 500                            | 10     | 1            | 0,00                |
| MYI          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | 24,040          | 06/08/2026        | 4 775                            | 19     | 1            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 346 | \$ 110       | 0,01                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre BRL hors cote | BRL 6,250       | 19/08/2026        | 21 622                           | \$ (334) | \$ (128)     | (0,01)              |
|              | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | TRY 53,100      | 07/08/2026        | 9 681                            | (168)    | (33)         | 0,00                |
|              |                                           |                 |                   |                                  | \$ (502) | \$ (161)     | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement colombien                 | 1,000 %              | 20/06/2036      | \$ 8 300                         | \$ (1 003)             | \$ 148                            | \$ (855)     | (0,05)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | 1,000                | 20/12/2029      | 7 900                            | (194)                  | 197                               | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien                | 5,000                | 20/06/2031      | 8 300                            | 473                    | 10                                | 483          | 0,03                |
|              | Obligation internationale du gouvernement salvadorien               | 1,000                | 20/06/2031      | 9 500                            | (601)                  | 19                                | (582)        | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement kenyan                    | 1,000                | 20/06/2031      | 11 200                           | (1 116)                | 40                                | (1 076)      | (0,06)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian                  | 1,000                | 20/06/2031      | 11 600                           | (717)                  | (64)                              | (781)        | (0,04)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2031      | 7 800                            | (431)                  | 31                                | (400)        | (0,02)              |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement kenyan                    | 1,000                | 20/06/2031      | 1 600                            | (174)                  | 20                                | (154)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  | 1,000                | 20/12/2027      | 1 500                            | 3                      | 11                                | 14           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc                      | 1,000                | 20/06/2031      | 9 400                            | (481)                  | (1)                               | (482)        | (0,03)              |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Entité de référence                                        | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000 %              | 20/12/2026      | \$ 258                           | \$ 2                   | \$ 3                              | \$ 5         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | 1,000                | 20/06/2031      | 9 400                            | (490)                  | 11                                | (479)        | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien       | 5,000                | 20/06/2031      | 8 000                            | 433                    | 32                                | 465          | 0,03                |
|              | Obligation internationale du gouvernement égyptien         | 1,000                | 20/06/2031      | 8 000                            | (640)                  | 44                                | (596)        | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement kenyan           | 1,000                | 20/06/2031      | 8 300                            | (947)                  | 150                               | (797)        | (0,04)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian         | 1,000                | 20/06/2027      | 500                              | (5)                    | 4                                 | (1)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian         | 1,000                | 20/12/2030      | 600                              | (54)                   | 19                                | (35)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                | 20/06/2031      | 400                              | 2                      | 0                                 | 2            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien         | 1,000                | 20/06/2035      | 4 800                            | 21                     | 22                                | 43           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/12/2026      | 336                              | 3                      | 4                                 | 7            | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/06/2031      | 7 500                            | 65                     | 13                                | 78           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                | 20/06/2036      | 18 200                           | (1 905)                | 30                                | (1 875)      | (0,10)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | 1,000                | 20/06/2031      | 7 800                            | (388)                  | (10)                              | (398)        | (0,02)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien       | 5,000                | 20/06/2031      | 5 800                            | 321                    | 16                                | 337          | 0,02                |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                | 20/06/2036      | 7 500                            | (336)                  | 7                                 | (329)        | (0,02)              |
|              | Petroleos Mexicanos                                        | 1,000                | 20/12/2026      | 700                              | (7)                    | 8                                 | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                | 20/06/2030      | 8 700                            | (745)                  | 479                               | (266)        | (0,02)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/12/2026      | 961                              | 5                      | 15                                | 20           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/06/2027      | 1 375                            | (197)                  | 246                               | 49           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/06/2031      | 16 200                           | (9)                    | 178                               | 169          | 0,01                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement égyptien         | 1,000                | 20/06/2031      | 8 000                            | (658)                  | 62                                | (596)        | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement nigérian         | 1,000                | 20/06/2031      | 13 600                           | (891)                  | (25)                              | (916)        | (0,05)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | 1,000                | 20/06/2031      | 7 600                            | (440)                  | 53                                | (387)        | (0,02)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement équatorien       | 5,000                | 20/06/2027      | 4 200                            | 139                    | 20                                | 159          | 0,01                |
|              | Obligation internationale du gouvernement égyptien         | 1,000                | 20/06/2031      | 9 600                            | (726)                  | 10                                | (716)        | (0,04)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement salvadorien      | 1,000                | 20/06/2031      | 7 300                            | (509)                  | 62                                | (447)        | (0,03)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                | 20/12/2029      | 9 200                            | (386)                  | 431                               | 45           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin         | 5,000                | 20/06/2027      | 1 605                            | (240)                  | 297                               | 57           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien        | 1,000                | 20/12/2035      | 1 500                            | (229)                  | 86                                | (143)        | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement panaméen         | 1,000                | 20/06/2031      | 600                              | 3                      | 1                                 | 4            | 0,00                |
| MYC          | SoftBank Group Corp.                                       | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 942 200                        | (98)                   | 60                                | (38)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain     | 1,000                | 20/06/2029      | \$ 562                           | (19)                   | 24                                | 5            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement turc             | 1,000                | 20/06/2031      | 7 600                            | (443)                  | 54                                | (389)        | (0,02)              |
|              |                                                            |                      |                 |                                  | \$ (13 609)            | \$ 2 817                          | \$ (10 792)  | (0,60)              |

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

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

### SWAPS SUR DEISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,140 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2033      | \$ 8 334                             | CNH 56 171                            | \$ 53                  | \$ (24)                           | \$ 29        | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,150 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2036      | 2 754                                | 18 546                                | 16                     | (22)                              | (6)          | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,150 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2038      | 10 855                               | 73 106                                | 62                     | (55)                              | 7            | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,135 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2036      | 12 528                               | 84 540                                | 137                    | 83                                | 220          | 0,01                |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         |                 |                                      |                                       | \$ 268                 | \$ (18)                           | \$ 250       | 0,01                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | NZD 272         | \$ 160            | \$ 6               | \$ 0                  | \$ 6                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 570         | 447               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 598        | AUD 7 860         | 0                  | (152)                 | (152)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 138             | NZD 244           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 244         | \$ 138            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 965        | IDR 35 257 013    | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 183 828     | \$ 35 384         | 0                  | (131)                 | (131)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | DOP 76 833      | 1 306             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 3 444         | RSD 408 699       | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 160           | \$ 214            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | HUF 360 916     | 1 161             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 42 803        | 269               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 115 730     | 76                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 27 539      | 8 188             | 115                | 0                     | 115                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | PHP 301 519     | 4 875             | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 16 590      | 523               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 936          | EGP 55 427        | 182                | 0                     | 182                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 5 972           | HUF 1 854 081     | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 442           | NOK 41 181        | 0                  | (280)                 | (280)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | CZK 13 996      | € 574             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP 225 879     | \$ 3 789          | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 14 257      | 1 822             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 283         | 95                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 31 233       | BRL 163 541       | 118                | 0                     | 118                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | ZAR 58 071      | \$ 3 334          | 0                  | (195)                 | (195)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | COP 82 383 418  | 23 351            | 0                  | (130)                 | (130)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | KZT 228 856     | 455               | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP 1 039 911   | 16 864            | 0                  | (31)                  | (31)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 236         | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 5 633        | MXN 98 894        | 2                  | (11)                  | (9)                                     | 0,00                |
| BPS          | 10/2026           | 4 151           | BRL 22 015        | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR 19 630      | \$ 1 093          | 0                  | (92)                  | (92)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | CLP 11 445 537  | 12 609            | 179                | 0                     | 179                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | ARS 635 321     | 424               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 77 980      | € 13 146          | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 137 765         | \$ 26 549         | 0                  | (67)                  | (67)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 69 786      | 10 313            | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1 778         | 2 393             | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 885 924     | 2 857             | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 549         | 186               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 6 340         | 40                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 294 144     | 9 321             | 93                 | 0                     | 93                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 712          | ARS 1 165 831     | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 098           | BRL 25 967        | 0                  | (81)                  | (81)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 294           | CNY 56 577        | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14 705          | CZK 307 617       | 0                  | (212)                 | (212)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 3 052           | € 2 671           | 9                  | (7)                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 094           | £ 827             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 561           | INR 439 297       | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 2 840       | \$ 173            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 08/2026           | \$ 1 991        | BRL 10 140        | 0                  | (47)                  | (47)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 15 428 663  | \$ 4 117          | 0                  | (281)                 | (281)                                   | (0,02)              |
|              | 09/2026           | IDR 157 088 670 | 8 687             | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 100 702     | 1 056             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 614 265     | 18 821            | 214                | 0                     | 214                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$ 25 326       | IDR 449 992 982   | 38                 | (420)                 | (382)                                   | (0,02)              |
|              | 09/2026           | 3 257           | INR 309 452       | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 2 044           | PEN 6 928         | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 14 967          | THB 488 139       | 0                  | (181)                 | (181)                                   | (0,01)              |
|              | 10/2026           | 4 165           | BRL 22 163        | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR 86 197      | \$ 4 800          | 0                  | (409)                 | (409)                                   | (0,02)              |
|              | 12/2026           | \$ 8 687        | IDR 158 157 153   | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              | 06/2027           | 772             | KWD 234           | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD 3 368       | \$ 11 578         | 594                | 0                     | 594                                     | 0,03                |
|              | 07/2029           | 409             | 1 407             | 72                 | 0                     | 72                                      | 0,00                |
|              | 05/2030           | 498             | 1 715             | 88                 | 0                     | 88                                      | 0,01                |
|              | 08/2030           | 1 298           | 4 377             | 134                | 0                     | 134                                     | 0,01                |
|              | 01/2031           | 3 394           | 11 439            | 337                | 0                     | 337                                     | 0,02                |
|              | 06/2031           | 3 297           | 11 092            | 300                | 0                     | 300                                     | 0,02                |
|              | 12/2040           | CNH 30 262      | 6 414             | 0                  | (67)                  | (67)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 9 155 535   | 2 660             | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 3 995         | 5 280             | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 608         | 205               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 394         | 233               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 5 081       | 1 501             | 13                 | (2)                   | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 2 321       | 49                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 387        | CNH 56 866        | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 411           | COP 9 155 535     | 228                | 0                     | 228                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 52 031          | MYR 211 324       | 0                  | (299)                 | (299)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 6 406           | PLN 24 047        | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 41 686          | TRY 1 978 655     | 359                | 0                     | 359                                     | 0,02                |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BSH          | 07/2026           | \$ 6 621        | ZAR 109 270       | \$ 35              | \$ 0                  | \$ 35                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 16 690      | \$ 1 028          | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 626        | COP 9 155 535     | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 22 384          | INR 2 125 808     | 0                  | (74)                  | (74)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 912           | \$ 1 063          | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 33 597        | \$ 211            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 32 340      | 9 410             | 15                 | (84)                  | (69)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 239          | NZD 422           | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 422         | \$ 239            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 33 367       | BRL 170 244       | 0                  | (731)                 | (731)                                   | (0,04)              |
| CBK          | 09/2026           | COP 106 438 376 | \$ 27 463         | 0                  | (2 876)               | (2 876)                                 | (0,16)              |
|              | 09/2026           | \$ 2 078        | COP 7 591 716     | 86                 | 0                     | 86                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | 2 281           | PEN 7 720         | 0                  | (32)                  | (32)                                    | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN 9 831       | \$ 2 894          | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ARS 1 863 363   | 1 181             | 0                  | (74)                  | (74)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 42 495      | 29 826            | 386                | 0                     | 386                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | COP 35 931 740  | 9 423             | 0                  | (972)                 | (972)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | EGP 20 188      | 403               | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 1 049 397   | 3 361             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 612         | 211               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 18 193      | 5 217             | 26                 | (143)                 | (117)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | PHP 480 479     | 7 764             | 0                  | (62)                  | (62)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 105 355     | 3 331             | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 824          | ARS 1 332 852     | 74                 | 0                     | 74                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 20 601          | AUD 28 808        | 0                  | (643)                 | (643)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | 2 100           | BRL 10 854        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 729           | COP 23 515 770    | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 517           | EGP 83 196        | 165                | 0                     | 165                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 2 250           | € 1 929           | 0                  | (44)                  | (44)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 46 716          | HUF 14 248 663    | 0                  | (963)                 | (963)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | 2 006           | LKR 629 884       | 0                  | (135)                 | (135)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 12 367          | PEN 41 899        | 2                  | (88)                  | (86)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 12 764          | PHP 781 181       | 0                  | (40)                  | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 255             | PLN 931           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14 669          | VND 392 328 360   | 222                | 0                     | 222                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | ILS 1 061       | \$ 368            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 7 061       | 2 069             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP 10 571 310  | 11 768            | 295                | 0                     | 295                                     | 0,02                |
|              | 09/2026           | COP 329 543 911 | 87 154            | 43                 | (6 819)               | (6 776)                                 | (0,38)              |
|              | 09/2026           | IDR 672 934 057 | 37 271            | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 477 888     | 947               | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 184 138     | 53 820            | 149                | (167)                 | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP 784 280     | 12 788            | 46                 | 0                     | 46                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 347        | COP 9 155 353     | 262                | 0                     | 262                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | 403             | EGP 20 743        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 5 224           | IDR 93 173 162    | 0                  | (60)                  | (60)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 27 276          | INR 2 581 683     | 0                  | (182)                 | (182)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 255             | MXN 4 555         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 244             | RSD 24 708        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 44 512      | \$ 13 052         | 84                 | (30)                  | 54                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | UGX 2 031 360   | 552               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$ 2 069        | PEN 7 079         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | 482             | UGX 1 876 885     | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS 2 593 800   | \$ 198            | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 24 235 805  | 6 729             | 0                  | (76)                  | (76)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN 243 058     | 149               | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN 31 583      | 9 228             | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$ 20 771       | KES 2 741 342     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 37 271          | IDR 677 439 886   | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
| DUB          | 01/2027           | PEN 12 176      | \$ 3 573          | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 13 212        | BRL 77 980        | 0                  | (39)                  | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 14 058      | \$ 45             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 726 365     | 7 692             | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT 4 860 178   | 10 255            | 174                | 0                     | 174                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD 681         | 534               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 71 990      | 2 193             | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 38           | AUD 53            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 028           | CNY 13 824        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 11 238          | CZK 233 987       | 0                  | (214)                 | (214)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 170             | EGP 9 049         | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 133           | INR 495 118       | 89                 | 0                     | 89                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 7 051           | NOK 65 511        | 0                  | (430)                 | (430)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 12 930          | PEN 43 728        | 0                  | (111)                 | (111)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 163             | PLN 606           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10 122          | RON 45 982        | 9                  | (109)                 | (100)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR 8 574       | \$ 530            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 77 980      | € 13 093          | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 3 197       | \$ 1 070          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT 1 791 611   | 3 718             | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 379        | EGP 75 961        | 137                | 0                     | 137                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | PEN 66 567      | \$ 19 484         | 109                | (85)                  | 24                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | PKR 156 231     | 524               | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|------|
| FAR          | 09/2026           | \$              | 1 615             | COP 6 074 677      | \$ 116                | \$ 0                                    | \$ 116              | 0,01   |      |
|              | 09/2026           |                 | 7 800             | EGP 400 686        | 133                   | 0                                       | 133                 | 0,01   |      |
|              | 09/2026           |                 | 4 281             | IDR 77 743 456     | 28                    | 0                                       | 28                  | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 7 692             | INR 731 287        | 0                     | (26)                                    | (26)                | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 1 921             | KZT 974 493        | 73                    | 0                                       | 73                  | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 1 011             | THB 32 746         | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00   |      |
|              | 10/2026           | UGX             | 659 750           | \$ 182             | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |      |
|              | 10/2026           | UZS             | 83 410 265        | 6 553              | 0                     | (293)                                   | (293)               | (0,02) |      |
|              | 11/2026           | KZT             | 387 051           | 782                | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |      |
|              | 11/2026           | UZS             | 20 486 270        | 1 568              | 0                     | (105)                                   | (105)               | (0,01) |      |
|              | 12/2026           | \$              | 1 286             | KZT 676 541        | 61                    | 0                                       | 61                  | 0,00   |      |
|              | 12/2026           | UZS             | 34 587 814        | 2 663              | 0                     | (154)                                   | (154)               | (0,01) |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 69 426            | 10 262             | 34                    | 0                                       | 34                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | €               | 814               | 928                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | £               | 29 287            | 39 383             | 512                   | 0                                       | 512                 | 0,03   |      |
|              | 07/2026           | ¥               | 17 796            | 112                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | PEN             | 5 277             | 1 561              | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 929             | 1 512              | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 55 832            | CNH 379 600        | 90                    | 0                                       | 90                  | 0,01   |      |
|              | 07/2026           |                 | 131               | HUF 40 328         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 2 119             | ¥ 342 905          | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 3 587             | NOK 34 990         | 0                     | (52)                                    | (52)                | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 12 341            | PLN 45 068         | 0                     | (351)                                   | (351)               | (0,02) |      |
|              | 07/2026           | ZAR             | 9 292             | \$ 563             | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | CNH             | 378 760           | 55 832             | 0                     | (86)                                    | (86)                | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | COP             | 13 019 879        | 3 449              | 0                     | (298)                                   | (298)               | (0,02) |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 542               | 189                | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | ¥               | 342 008           | 2 119              | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | PEN             | 8 525             | 2 522              | 25                    | 0                                       | 25                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | \$              | 930               | € 814              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | INR             | 995 776           | \$ 10 391          | 0                     | (59)                                    | (59)                | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | PEN             | 25 345            | 7 373              | 0                     | (33)                                    | (33)                | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | \$              | 10 049            | IDR 180 175 555    | 0                     | (62)                                    | (62)                | 0,00   |      |
|              | GLM               | 09/2026         |                   | 207                | MXN 3 650             | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00 |
|              |                   | 09/2026         |                   | 1 576              | THB 51 064            | 0                                       | (29)                | (29)   | 0,00 |
| 03/2027      |                   | ZAR             | 1 496 000         | \$ 89 156          | 0                     | (180)                                   | (180)               | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   | ARS             | 323 584           | 214                | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | BRL             | 128 633           | 24 742             | 1                     | (111)                                   | (110)               | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   | DOP             | 115 571           | 1 900              | 0                     | (35)                                    | (35)                | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | HUF             | 10 474 699        | 33 391             | 0                     | (256)                                   | (256)               | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   | \$              | 219               | ARS 323 584        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 57 822            | BRL 305 241        | 1 619                 | (467)                                   | 1 152               | 0,06   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 206               | CAD 294            | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 2 990             | COP 10 414 884     | 22                    | 0                                       | 22                  | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 26                | MYR 108            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 2 895             | PEN 10 182         | 90                    | 0                                       | 90                  | 0,01   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 3                 | PLN 11             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 12 630            | RON 57 167         | 0                     | (163)                                   | (163)               | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   | ZAR             | 239 434           | \$ 14 500          | 0                     | (85)                                    | (85)                | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | CAD             | 293               | 206                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | DOP             | 311 031           | 5 207              | 42                    | 0                                       | 42                  | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | \$              | 5 342             | BRL 27 519         | 0                     | (67)                                    | (67)                | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 6 330             | DOP 396 804        | 258                   | 0                                       | 258                 | 0,01   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 1                 | EGP 54             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 2 583             | INR 247 767        | 23                    | 0                                       | 23                  | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 2 094             | PEN 7 060          | 0                     | (26)                                    | (26)                | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | ZAR             | 112 249           | \$ 6 297           | 0                     | (533)                                   | (533)               | (0,03) |      |
| 09/2026      |                   | ARS             | 1 613 345         | 847                | 0                     | (198)                                   | (198)               | (0,01) |      |
| 09/2026      |                   | DOP             | 1 050 723         | 17 449             | 122                   | (68)                                    | 54                  | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | INR             | 6 410 648         | 67 585             | 404                   | (98)                                    | 306                 | 0,02   |      |
| 09/2026      |                   | \$              | 955               | ARS 1 613 345      | 90                    | 0                                       | 90                  | 0,01   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 11 985            | BRL 62 633         | 24                    | (87)                                    | (63)                | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 6 023             | DOP 367 602        | 62                    | 0                                       | 62                  | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 17 822            | IDR 320 303 828    | 41                    | (108)                                   | (67)                | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 9 123             | INR 876 739        | 78                    | 0                                       | 78                  | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 3 233             | THB 104 330        | 0                     | (73)                                    | (73)                | 0,00   |      |
| 10/2026      |                   | DOP             | 48 721            | \$ 818             | 15                    | 0                                       | 15                  | 0,00   |      |
| 10/2026      |                   | \$              | 14 947            | BRL 79 517         | 85                    | 0                                       | 85                  | 0,00   |      |
| 10/2026      |                   | 115             | MNT 420 399       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |      |
| 11/2026      | COP               | 10 732 892      | \$ 2 990          | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |        |      |
| 11/2026      | DOP               | 317 655         | 5 224             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |        |      |
| 12/2026      |                   | 50 239          | 841               | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |        |      |
| 04/2027      | \$                | 139             | MNT 524 058       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |      |
| 10/2027      |                   | 136             | 526 938           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |      |
| 04/2028      |                   | 407             | 1 615 089         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |      |
| 10/2028      |                   | 376             | 1 531 511         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |      |
| 04/2029      |                   | 348             | 1 456 570         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |      |
| 10/2029      |                   | 321             | 1 381 630         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |      |
| 04/2030      |                   | 296             | 1 306 690         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |      |
| 10/2030      |                   | 272             | 1 232 570         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |      |
| 04/2031      |                   | 248             | 1 149 240         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |      |
| IND          | 07/2026           |                 | 605               | HUF 184 731        | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |      |
| JPM          | 07/2026           | CNH             | 236 340           | \$ 34 773          | 0                     | (45)                                    | (45)                | 0,00   |      |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | EGP             | 55 427            | \$ 898             | \$ 0                  | \$ (219)                                | \$ (219) (0,01)     |
|              | 07/2026           | £               | 1 841             | 2 470              | 27                    | 0                                       | 27 0,00             |
|              | 07/2026           | ILS             | 19 877            | 6 699              | 27                    | (1)                                     | 26 0,00             |
|              | 07/2026           | KZT             | 63 324            | 132                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | NOK             | 234 024           | 23 643             | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 272               | AUD 381            | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 15 349            | BRL 78 620         | 4                     | (164)                                   | (160) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 7 782             | CNH 52 531         | 0                     | (43)                                    | (43) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 387               | EGP 20 511         | 29                    | 0                                       | 29 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 32                | HUF 9 594          | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 29 958            | PLN 109 139        | 0                     | (924)                                   | (924) (0,05)        |
|              | 07/2026           |                 | 5 695             | VND 151 714 800    | 63                    | 0                                       | 63 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 740               | ZAR 12 083         | 1                     | (5)                                     | (4) 0,00            |
|              | 08/2026           | HKD             | 52 963            | \$ 6 770           | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 836             | 632                | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|              | 08/2026           | \$              | 23 643            | NOK 234 127        | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 09/2026           | MXN             | 616 895           | \$ 35 507          | 426                   | 0                                       | 426 0,02            |
|              | 09/2026           | TWD             | 13 385            | 423                | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 873               | IDR 15 995 048     | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 5 011             | INR 477 972        | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           |                 | 8 816             | KZT 4 451 815      | 258                   | 0                                       | 258 0,01            |
|              | 09/2026           |                 | 4 901             | MXN 85 813         | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 20 163            | THB 660 336        | 0                     | (161)                                   | (161) (0,01)        |
|              | 10/2026           | UGX             | 2 144 670         | \$ 582             | 11                    | 0                                       | 11 0,00             |
|              | 10/2026           | \$              | 4 236             | UZS 51 342 558     | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
|              | 10/2026           | UZS             | 17 323 128        | \$ 1 365           | 0                     | (57)                                    | (57) 0,00           |
|              | 11/2026           | \$              | 569               | EGP 32 897         | 67                    | 0                                       | 67 0,00             |
|              | 11/2026           | ZAR             | 57 440            | \$ 3 277           | 0                     | (189)                                   | (189) (0,01)        |
|              | 12/2026           | MXN             | 86 117            | 4 878              | 16                    | 0                                       | 16 0,00             |
|              | 12/2026           | \$              | 965               | MXN 16 924         | 0                     | (9)                                     | (9) 0,00            |
|              | 06/2027           | UZS             | 497 120           | \$ 37              | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 07/2026           | €               | 26 199            | 30 065             | 111                   | 0                                       | 111 0,01            |
|              | 07/2026           | INR             | 729 235           | 7 722              | 25                    | 0                                       | 25 0,00             |
|              | 07/2026           | ¥               | 160 893           | 1 011              | 21                    | 0                                       | 21 0,00             |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 991 970         | 1 314              | 27                    | 0                                       | 27 0,00             |
|              | 07/2026           | NOK             | 75 472            | 7 594              | 0                     | (33)                                    | (33) 0,00           |
|              | 07/2026           | \$              | 2 760             | AUD 3 917          | 5                     | (51)                                    | (46) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 557               | CHF 437            | 0                     | (16)                                    | (16) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 1 888             | € 1 627            | 0                     | (28)                                    | (28) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 11 906            | INR 1 147 625      | 199                   | 0                                       | 199 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 16 790            | NOK 155 686        | 0                     | (1 058)                                 | (1 058) (0,06)      |
|              | 08/2026           | AUD             | 1 818             | \$ 1 253           | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 135               | EGP 7 389          | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 08/2026           |                 | 17 400            | HKD 136 230        | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 7 594             | NOK 75 504         | 32                    | 0                                       | 32 0,00             |
|              | 09/2026           | EGP             | 46 436            | \$ 834             | 0                     | (79)                                    | (79) 0,00           |
|              | 09/2026           | MXN             | 6 625             | 382                | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 2 369             | COP 8 218 748      | 0                     | (26)                                    | (26) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 20 307            | INR 1 940 569      | 78                    | (34)                                    | 44 0,00             |
| MYI          | 07/2026           | €               | 1 637             | \$ 1 871           | 2                     | (3)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           | £               | 11                | 15                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 371               | £ 280              | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 8 896             | MYR 36 883         | 133                   | 0                                       | 133 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 16 995            | PEN 59 362         | 410                   | 0                                       | 410 0,02            |
|              | 08/2026           | CZK             | 25 076            | € 1 028            | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 09/2026           | \$              | 14 091            | IDR 252 750 267    | 0                     | (81)                                    | (81) 0,00           |
|              | 10/2026           |                 | 898               | AZN 1 607          | 40                    | 0                                       | 40 0,00             |
|              | 10/2027           |                 | 1 796             | 3 305              | 87                    | 0                                       | 87 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 12 040            | INR 1 158 287      | 185                   | 0                                       | 185 0,01            |
| NSL          | 07/2026           |                 | 2 953             | TRY 139 005        | 13                    | 0                                       | 13 0,00             |
|              | 09/2026           |                 | 3 268             | IDR 58 145 059     | 0                     | (45)                                    | (45) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 123               | CZK 2 613          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| RYL          | 09/2026           |                 | 9 418             | MXN 165 628        | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | €               | 1 678             | \$ 1 951           | 32                    | 0                                       | 32 0,00             |
| SCX          | 07/2026           | PEN             | 3 585             | 1 046              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           | THB             | 348 592           | 10 610             | 110                   | 0                                       | 110 0,01            |
|              | 07/2026           | TWD             | 383 959           | 12 097             | 48                    | 0                                       | 48 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 24 163            | CNY 164 915        | 63                    | 0                                       | 63 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 782               | EGP 41 424         | 53                    | 0                                       | 53 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 15 845            | INR 1 518 813      | 185                   | 0                                       | 185 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 1 596             | NOK 14 770         | 0                     | (103)                                   | (103) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 10 031            | PEN 35 279         | 313                   | 0                                       | 313 0,02            |
|              | 08/2026           | HKD             | 64 721            | \$ 8 274           | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 866               | EGP 48 217         | 96                    | 0                                       | 96 0,01             |
|              | 08/2026           |                 | 6 423             | INR 615 410        | 51                    | 0                                       | 51 0,00             |
|              | 08/2026           |                 | 37 389            | KZT 18 830 857     | 1 244                 | 0                                       | 1 244 0,07          |
|              | 08/2026           |                 | 9 901             | NGN 13 788 208     | 0                     | (128)                                   | (128) (0,01)        |
|              | 09/2026           | EGP             | 23 940            | \$ 466             | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 09/2026           | KZT             | 74 923            | 149                | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 09/2026           | PHP             | 229 460           | 3 743              | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|              | 09/2026           | THB             | 418 777           | 12 773             | 88                    | 0                                       | 88 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 2 969             | EGP 158 976        | 176                   | 0                                       | 176 0,01            |
|              | 09/2026           |                 | 26 985            | IDR 484 295 233    | 15                    | (155)                                   | (140) (0,01)        |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |          |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|----------|--------|
| SOG          | 09/2026           | \$              | 51 230            | INR                | 4 854 484             | \$ 0                                    | \$ (283)            | \$ (283) | (0,02) |
|              | 09/2026           |                 | 7 324             | THB                | 239 575               | 0                                       | (67)                | (67)     | 0,00   |
|              | 10/2026           |                 | 711               | UGX                | 2 659 579             | 3                                       | (6)                 | (3)      | 0,00   |
|              | 11/2026           | UGX             | 1 271 605         | \$                 | 328                   | 0                                       | (9)                 | (9)      | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 113 368           |                    | 16 759                | 57                                      | 0                   | 57       | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 50 103            |                    | 58 447                | 1 165                                   | 0                   | 1 165    | 0,07   |
|              | 07/2026           | ¥               | 81 519            |                    | 513                   | 12                                      | 0                   | 12       | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 018             | AUD                | 1 475                 | 4                                       | 0                   | 4        | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 283             | EGP                | 121 526               | 160                                     | 0                   | 160      | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 83 099            | €                  | 73 054                | 424                                     | 0                   | 424      | 0,02   |
|              | 07/2026           |                 | 544               | PEN                | 1 839                 | 0                                       | (5)                 | (5)      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 460             | SGD                | 3 186                 | 3                                       | 0                   | 3        | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 1 475             | \$                 | 1 017                 | 0                                       | (4)                 | (4)      | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 73 054            |                    | 83 212                | 0                                       | (423)               | (423)    | (0,02) |
|              | 08/2026           | SGD             | 3 178             |                    | 2 460                 | 0                                       | (3)                 | (3)      | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 2 100             | EGP                | 116 690               | 231                                     | 0                   | 231      | 0,01   |
|              | 09/2026           |                 | 1 000             |                    | 54 700                | 83                                      | 0                   | 83       | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 2 328             | INR                | 221 157               | 0                                       | (7)                 | (7)      | 0,00   |
|              | 11/2026           |                 | 2 577             | EGP                | 148 860               | 302                                     | 0                   | 302      | 0,02   |
|              | 12/2027           |                 | 33                | CNH                | 226                   | 2                                       | 0                   | 2        | 0,00   |
|              | 12/2028           |                 | 589               |                    | 3 978                 | 36                                      | 0                   | 36       | 0,00   |
|              | 12/2029           |                 | 1 638             |                    | 10 898                | 115                                     | 0                   | 115      | 0,01   |
|              | 12/2030           |                 | 2 855             |                    | 18 657                | 221                                     | 0                   | 221      | 0,01   |
|              | 12/2031           |                 | 3 422             |                    | 21 961                | 291                                     | 0                   | 291      | 0,02   |
|              | 12/2032           |                 | 3 662             |                    | 23 044                | 333                                     | 0                   | 333      | 0,02   |
|              | 12/2033           |                 | 3 859             |                    | 23 765                | 367                                     | 0                   | 367      | 0,02   |
|              | 12/2034           |                 | 4 100             |                    | 24 668                | 402                                     | 0                   | 402      | 0,02   |
|              | 12/2035           |                 | 4 352             |                    | 25 570                | 442                                     | 0                   | 442      | 0,02   |
|              | 12/2036           |                 | 4 645             |                    | 26 653                | 474                                     | 0                   | 474      | 0,03   |
|              | 12/2037           |                 | 4 888             |                    | 27 374                | 514                                     | 0                   | 514      | 0,03   |
|              | 12/2038           |                 | 5 179             |                    | 28 277                | 553                                     | 0                   | 553      | 0,03   |
|              | 12/2039           |                 | 5 487             |                    | 29 179                | 592                                     | 0                   | 592      | 0,03   |
|              | 12/2040           |                 | 5 846             |                    | 30 262                | 636                                     | 0                   | 636      | 0,04   |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 302               | \$                 | 219                   | 6                                       | 0                   | 6        | 0,00   |
|              | 07/2026           | TWD             | 102 372           |                    | 3 227                 | 15                                      | 0                   | 15       | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 5 795             | BRL                | 29 544                | 0                                       | (87)                | (87)     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 47 896            | £                  | 36 234                | 195                                     | 0                   | 195      | 0,01   |
|              | 08/2026           | COP             | 14 220 356        | \$                 | 3 728                 | 0                                       | (352)               | (352)    | (0,02) |
|              | 08/2026           | £               | 36 234            |                    | 47 895                | 0                                       | (195)               | (195)    | (0,01) |
|              | 09/2026           | MXN             | 6 544             |                    | 374                   | 2                                       | 0                   | 2        | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 34 956            |                    | 10 296                | 76                                      | 0                   | 76       | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 1 563             | COP                | 6 060 251             | 165                                     | 0                   | 165      | 0,01   |
|              | 09/2026           |                 | 11 762            | INR                | 1 120 693             | 0                                       | (1)                 | (1)      | 0,00   |
| UAG          | 07/2026           |                 | 17                | ILS                | 51                    | 0                                       | 0                   | 0        | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 166               | PLN                | 608                   | 0                                       | (5)                 | (5)      | 0,00   |
|              | 08/2026           | COP             | 15 229 585        | \$                 | 4 032                 | 0                                       | (351)               | (351)    | (0,02) |
|              | 09/2026           | CLP             | 13 057 995        |                    | 14 672                | 501                                     | 0                   | 501      | 0,03   |
|              | 09/2026           | \$              | 793               | MXN                | 13 903                | 0                                       | (2)                 | (2)      | 0,00   |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 436               | \$                 | 540                   | 0                                       | 0                   | 0        | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 540               | CHF                | 435                   | 1                                       | 0                   | 1        | 0,00   |
|              |                   |                 |                   | \$ 23 770          | \$ (28 501)           | \$ (4 731)                              | (0,27)              |          |        |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation, Investisseur en EUR (partiellement couverte) de capitalisation, E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------|--------|
| BOA          | 07/2026           | COP             | 49 938            | \$                 | 14                    | \$ 0                                    | \$ (1)              | 0,00    |        |
|              | 07/2026           | INR             | 3 097             |                    | 32                    | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
|              | 07/2026           | \$              | 125               | €                  | 107                   | 0                                       | (2)                 | 0,00    |        |
|              | 07/2026           |                 | 33                | INR                | 3 089                 | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
|              | 07/2026           |                 | 11                | MXN                | 193                   | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
|              | 08/2026           | INR             | 3 098             | \$                 | 33                    | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
| BPS          | 08/2026           | MXN             | 193               |                    | 11                    | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
|              | 07/2026           | CNH             | 6 227             |                    | 920                   | 3                                       | 0                   | 3       | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNY             | 111               |                    | 16                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 310               |                    | 353                   | 0                                       | (1)                 | (1)     | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 5 390             |                    | 166                   | 4                                       | 0                   | 4       | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 128 952           | €                  | 110 848               | 36                                      | (2 256)             | (2 220) | (0,12) |
| BRC          | 07/2026           |                 | 846               | MXN                | 14 865                | 5                                       | 0                   | 5       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 29                | TRY                | 1 390                 | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026           | MXN             | 14 865            | \$                 | 844                   | 0                                       | (5)                 | (5)     | 0,00   |
| BSH          | 07/2026           | \$              | 2 057             | €                  | 1 767                 | 0                                       | (36)                | (36)    | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           |                 | 15                | COP                | 49 938                | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 5 721             | €                  | 4 907                 | 0                                       | (111)               | (111)   | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 28                | IDR                | 506 408               | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026           | COP             | 49 938            | \$                 | 14                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           |                 | 49 938            |                    | 14                    | 0                                       | (1)                 | (1)     | 0,00   |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |         |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|---------|--------|
| FAR          | 07/2026              | \$                 | 3 287                | CNY                   | 22 301                   | \$ 0                                          | \$ (8)                 | \$ (8)  | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 20                   | HKD                   | 156                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026              | HKD                | 156                  | \$                    | 20                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026              | CNH                | 6 195                |                       | 916                      | 3                                             | 0                      | 3       | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 2 487                |                       | 2 836                    | 0                                             | (7)                    | (7)     | 0,00   |
|              | 07/2026              | MXN                | 15 818               |                       | 900                      | 0                                             | (5)                    | (5)     | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 3 313                | CNH                   | 22 538                   | 7                                             | 0                      | 7       | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 15                   | COP                   | 49 938                   | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 0                    | MXN                   | 1                        | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026              | CNH                | 22 488               | \$                    | 3 313                    | 0                                             | (7)                    | (7)     | 0,00   |
| GLM          | 08/2026              | COP                | 49 938               |                       | 15                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 2 840                | €                     | 2 487                    | 7                                             | 0                      | 7       | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 897                  | MXN                   | 15 818                   | 5                                             | 0                      | 5       | 0,00   |
|              | 07/2026              | BRL                | 703                  | \$                    | 139                      | 3                                             | 0                      | 3       | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 1 013                | MXN                   | 17 561                   | 0                                             | (8)                    | (8)     | 0,00   |
|              | 07/2026              | BRL                | 185                  | \$                    | 36                       | 1                                             | 0                      | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 123 267              |                       | 140 026                  | 6                                             | (911)                  | (905)   | (0,05) |
|              | 07/2026              | HKD                | 156                  |                       | 20                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026              | IDR                | 506 408              |                       | 28                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 170                  | BRL                   | 888                      | 1                                             | 0                      | 1       | 0,00   |
| JPM<br>MBC   | 07/2026              |                    | 57 576               | €                     | 49 595                   | 0                                             | (874)                  | (874)   | (0,05) |
|              | 07/2026              |                    | 161                  | THB                   | 5 390                    | 1                                             | 0                      | 1       | 0,00   |
|              | 08/2026              | BRL                | 888                  | \$                    | 169                      | 0                                             | (1)                    | (1)     | 0,00   |
|              | 08/2026              | THB                | 5 390                |                       | 162                      | 0                                             | (1)                    | (1)     | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 139 920              | €                     | 123 019                  | 916                                           | 0                      | 916     | 0,05   |
|              | 08/2026              |                    | 28                   | IDR                   | 506 408                  | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026              | COP                | 49 938               | \$                    | 14                       | 0                                             | (1)                    | (1)     | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 15                   | COP                   | 49 938                   | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026              | COP                | 49 938               | \$                    | 14                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 876                  | INR                   | 82 977                   | 0                                             | (2)                    | (2)     | 0,00   |
| SCX<br>SOG   | 07/2026              | CNH                | 10 115               | \$                    | 1 495                    | 5                                             | 0                      | 5       | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 261 373              |                       | 297 311                  | 0                                             | (1 516)                | (1 516) | (0,08) |
|              | 07/2026              | MXN                | 16 890               |                       | 961                      | 0                                             | (6)                    | (6)     | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 256 525              | €                     | 219 903                  | 0                                             | (5 112)                | (5 112) | (0,29) |
|              | 07/2026              |                    | 0                    | MXN                   | 0                        | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 297 715              | €                     | 261 373                  | 1 514                                         | 0                      | 1 514   | 0,09   |
|              | 08/2026              |                    | 958                  | MXN                   | 16 890                   | 6                                             | 0                      | 6       | 0,00   |
|              | 07/2026              | MYR                | 526                  | \$                    | 133                      | 4                                             | 0                      | 4       | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 353                  | €                     | 310                      | 1                                             | 0                      | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026              |                    | 128                  | MYR                   | 525                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
| SSB          | 08/2026              | €                  | 310                  | \$                    | 354                      | 0                                             | (1)                    | (1)     | 0,00   |
|              | 08/2026              | MYR                | 525                  |                       | 128                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 5                    | MXN                   | 88                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
| UAG          |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |
|              |                      |                    |                      |                       |                          |                                               |                        |         |        |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |        |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|--------|------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 13                | £                  | 10                    | \$                                      | 0                   | \$   | 0      | 0,00 |
| BOA          | 07/2026           | COP             | 522               | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | \$   | 0      | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 1 564             | £                  | 1 168                 | 0                                       | (13)                | (13) | 0,00   |      |
| BPS          | 07/2026           |                 | 0                 | MXN                | 6                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | MXN             | 6                 | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 65                |                    | 10                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | £               | 199               |                    | 263                   | 0                                       | (2)                 | (2)  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 3 932             | £                  | 2 940                 | 3                                       | (32)                | (29) | (0,01) |      |
| BRC          | 08/2026           |                 | 715               |                    | 541                   | 3                                       | 0                   | 3    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 144               |                    | 109                   | 1                                       | 0                   | 1    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 26                | MXN                | 453                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
| CBK          | 08/2026           | MXN             | 453               | \$                 | 26                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | COP                | 522                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
| DUB          | 07/2026           |                 | 129               | £                  | 96                    | 0                                       | (2)                 | (2)  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | COP             | 522               | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 522               |                    | 0                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
| FAR          | 07/2026           | \$              | 35                | CNY                | 238                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 65                | \$                 | 10                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | £               | 15                |                    | 20                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | MXN             | 482               |                    | 27                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 35                | CNH                | 237                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 0                 | COP                | 522                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | CNH             | 237               | \$                 | 35                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | COP             | 522               |                    | 0                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | \$              | 20                | £                  | 15                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 08/2026           |                 | 27                | MXN                | 482                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
| GLM          | 07/2026           |                 | 11                |                    | 190                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
| JPM          | 07/2026           |                 | 1 407             | £                  | 1 049                 | 0                                       | (15)                | (15) | 0,00   |      |
| MBC          | 07/2026           |                 | 425               |                    | 318                   | 1                                       | (4)                 | (3)  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 20                | MXN                | 353                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
| MYI          | 07/2026           | COP             | 522               | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 0                 | COP                | 522                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0,00   |      |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
|              | 07/2026           | \$              | 328               | £                  | 244                   | \$ 0                                    | \$ (4)              | 0,00   |
| NSL          | 08/2026           | COP             | 522               | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 39                |                    | 52                    | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| SCX          | 08/2026           | \$              | 52                | £                  | 39                    | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 4 866             | \$                 | 6 441                 | 0                                       | (18)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 64                | £                  | 47                    | 0                                       | (1)                 | 0,00   |
| SOG          | 08/2026           |                 | 6 441             |                    | 4 866                 | 18                                      | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 106               | \$                 | 16                    | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 2 451             |                    | 3 238                 | 0                                       | (15)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | MXN             | 514               |                    | 29                    | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 2 286             | £                  | 1 704                 | 0                                       | (24)                | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 3 238             |                    | 2 451                 | 15                                      | 0                   | 0,00   |
| SSB          | 08/2026           |                 | 29                | MXN                | 514                   | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 90                | \$                 | 119                   | 0                                       | (1)                 | 0,00   |
| UAG          | 08/2026           | \$              | 119               | £                  | 90                    | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | MXN             | 6                 | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 41                 | \$ (131)                                | \$ (90)             | (0,01) |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (23 759) (1,33)

| DESCRIPTION                                                                      | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                                  |                               |                            |                     |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>5,950 éch. 15/04/2030 <sup>(i)</sup>  | \$ 900                        | \$ 54                      | 0,00                |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC<br>8,000 % éch. 07/04/2030 <sup>(i)</sup>      | 400                           | 24                         | 0,00                |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,250 % éch. 23/05/2023 <sup>(i)</sup> | 1 600                         | 96                         | 0,01                |
| <b>Total des Autres actifs financiers</b>                                        | <b>\$</b>                     | <b>174</b>                 | <b>0,01</b>         |
| <b>Total des Investissements</b>                                                 | <b>\$</b>                     | <b>1 778 555</b>           | <b>99,81</b>        |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b>                                    | <b>\$</b>                     | <b>3 462</b>               | <b>0,19</b>         |
| <b>Actif net</b>                                                                 | <b>\$</b>                     | <b>1 782 017</b>           | <b>100,00</b>       |

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

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

<sup>A</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

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

(h) Affilié au Fonds.

(i) Titre convertible conditionnel.

(j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804 % | 20/04/2033      | 13/04/2026   | \$ 7 500 | \$ 7 487     | 0,42                |

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 50 841 \$ (31 décembre 2025 : 7 293 \$) et un montant en numéraire de 33 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 69 772 \$ (31 décembre 2025 : 11 897 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 25 650 \$ (31 décembre 2025 : 3 750 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 14                                                                             | \$ 1 372 399                                         | \$ 98 366                                         | \$ 1 470 779        |
| Fonds d'investissement                        | 172 674                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 172 674             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 161 100                                              | 0                                                 | 161 100             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (72)                                                                              | (26 100)                                             | 0                                                 | (26 172)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 174                                                  | 0                                                 | 174                 |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 172 616</b>                                                                 | <b>\$ 1 507 573</b>                                  | <b>\$ 98 366</b>                                  | <b>\$ 1 778 555</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 653 466                                           | \$ 44 856                                         | \$ 698 322        |
| Fonds d'investissement                        | 36 609                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 36 609            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 42                                                                                | 5 206                                                | 21                                                | 5 269             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 0                                                    | 174                                               | 174               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 36 651</b>                                                                  | <b>\$ 658 672</b>                                    | <b>\$ 45 051</b>                                  | <b>\$ 740 374</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 2,410 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 402)        | \$ (1 604)                               | (0,09)              |
|                                               |                |                   | TBD <sup>(1)</sup> | PLN (76 481)     | (20 526)                                 | (1,15)              |
| BRC                                           | 2,200          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (3 156)        | (3 611)                                  | (0,20)              |
|                                               | 2,450          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 869)          | (3 283)                                  | (0,18)              |
|                                               | 3,500          | 23/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1 362)       | (1 363)                                  | (0,08)              |
|                                               | 3,950          | 05/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | PLN (19 576)     | (5 277)                                  | (0,30)              |
| MBC                                           | 2,450          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (2 447)        | (2 801)                                  | (0,16)              |
| MEI                                           | 2,380          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (860)            | (984)                                    | (0,06)              |
| MYI                                           | 2,300          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 494)          | (2 854)                                  | (0,16)              |
| SOG                                           | 2,360          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 191)          | (4 796)                                  | (0,27)              |
| TDM                                           | 3,800          | 16/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1 643)       | (1 646)                                  | (0,09)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (48 745)</b>                       | <b>(2,74)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (151)                                                   | \$ 0                    | \$ (151)                          | \$ (4)                                                     | \$ 0                    | \$ (4)                            |
| BOA          | (3 479)                                                    | 2 570                   | (909)                             | (1 326)                                                    | 1 080                   | (246)                             |
| BPS          | (2 563)                                                    | 2 680                   | 117                               | 482                                                        | (420)                   | 62                                |
| BRC          | (1 150)                                                    | 1 160                   | 10                                | 1 724                                                      | (1 640)                 | 84                                |
| BSH          | (3 598)                                                    | 3 600                   | 2                                 | (258)                                                      | 260                     | 2                                 |
| CBK          | (10 921)                                                   | 10 600                  | (321)                             | (127)                                                      | 370                     | 243                               |
| DUB          | (815)                                                      | 760                     | (55)                              | (572)                                                      | 450                     | (122)                             |
| FAR          | (443)                                                      | 30                      | (413)                             | (542)                                                      | 520                     | (22)                              |
| GLM          | 596                                                        | (540)                   | 56                                | (283)                                                      | 420                     | 137                               |
| GST          | (1 054)                                                    | 560                     | (494)                             | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| IND          | (12)                                                       | 0                       | (12)                              | 18                                                         | 0                       | 18                                |
| JPM          | (2 265)                                                    | 1 720                   | (545)                             | (689)                                                      | 470                     | (219)                             |
| MBC          | (1 678)                                                    | 1 720                   | 42                                | (86)                                                       | 0                       | (86)                              |
| MYC          | (504)                                                      | 580                     | 76                                | (7)                                                        | 100                     | 93                                |
| MYI          | 581                                                        | (660)                   | (79)                              | 79                                                         | 0                       | 79                                |
| NSL          | 153                                                        | 0                       | 153                               | 162                                                        | 0                       | 162                               |
| SCX          | 1 729                                                      | (1 270)                 | 459                               | 480                                                        | (570)                   | (90)                              |
| SOG          | 1 844                                                      | (630)                   | 1 214                             | 2 289                                                      | (2 240)                 | 49                                |
| SSB          | (173)                                                      | 210                     | 37                                | (110)                                                      | 80                      | (30)                              |
| UAG          | 143                                                        | 0                       | 143                               | 905                                                        | 710                     | 1 615                             |
| WST          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 52,11            | 70,61                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 15,39            | 10,13                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,92             | 3,62                 |
| Fonds d'investissement                                           | 8,15             | 4,42                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 7,60             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,08             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 1,77             | 2,80                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,35             | 1,60                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,01             | 0,02                 |
| Autres actifs                                                    | 11,62            | 6,72                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Angola                            | S/O              | 0,48                 |
| Argentine                         | 1,16             | 1,47                 |
| Australie                         | 0,35             | S/O                  |
| Azerbaïdjan                       | 0,63             | 0,32                 |
| Bénin                             | 0,20             | S/O                  |
| Bolivie                           | 0,39             | S/O                  |
| Bosnie-Herzégovine                | 0,31             | S/O                  |
| Brésil                            | 0,51             | 0,66                 |
| Cameroun                          | 0,27             | 0,45                 |
| Îles Caïmans                      | 1,69             | 0,84                 |
| Chili                             | 2,01             | 2,46                 |
| Chine                             | 1,77             | 0,41                 |
| Colombie                          | 10,25            | 12,44                |
| Congo                             | 0,15             | S/O                  |
| Congo, République démocratique du | 0,18             | S/O                  |
| Costa Rica                        | 0,41             | 0,32                 |
| République tchèque                | 0,55             | 1,04                 |
| Danemark                          | 0,00             | 0,00                 |
| République dominicaine            | 2,07             | 3,67                 |
| Égypte                            | 0,75             | 0,90                 |
| Équateur                          | S/O              | 0,99                 |
| France                            | S/O              | 0,03                 |
| Gabon                             | 0,06             | 0,13                 |
| Ghana                             | 0,18             | 0,47                 |
| Guatemala                         | 0,04             | 0,10                 |
| Hong Kong                         | 0,09             | 0,22                 |
| Hongrie                           | 0,52             | S/O                  |
| Inde                              | 0,14             | 0,32                 |
| Indonésie                         | 1,95             | 0,55                 |
| Internationales                   | 0,07             | S/O                  |
| Irlande                           | 0,60             | 1,31                 |
| Île de Man                        | 0,47             | S/O                  |
| Israël                            | 0,31             | 0,21                 |
| Côte d'Ivoire                     | 1,57             | 1,82                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 0,13             | S/O                  |
| Jordanie                          | 0,07             | 0,16                 |
| Kazakhstan                        | 1,14             | 1,01                 |
| Kenya                             | 0,08             | 0,20                 |
| Koweït                            | 0,42             | 1,17                 |
| Luxembourg                        | 2,15             | 2,32                 |
| Malaisie                          | 1,11             | S/O                  |
| Mexique                           | 8,29             | 7,64                 |
| Maroc                             | 0,10             | 0,24                 |
| Pays-Bas                          | 0,55             | 0,45                 |
| Nigeria                           | 0,27             | 0,77                 |
| Pakistan                          | 0,21             | S/O                  |
| Panama                            | 0,35             | 0,17                 |
| Paraguay                          | 0,42             | 0,30                 |
| Pérou                             | 6,06             | 8,09                 |
| Philippines                       | 0,47             | S/O                  |
| Pologne                           | 1,94             | 4,80                 |
| Qatar                             | 0,85             | S/O                  |
| Roumanie                          | 0,60             | 1,45                 |
| Arabie saoudite                   | 0,06             | 0,14                 |
| Sénégal                           | 0,08             | 0,37                 |
| Serbie                            | 0,56             | 0,15                 |
| Afrique du Sud                    | 3,96             | 8,00                 |
| Sri Lanka                         | 0,48             | 0,13                 |
| Supranationales                   | 1,44             | 0,31                 |
| Thaïlande                         | S/O              | 0,33                 |
| Turquie                           | 0,72             | 1,24                 |
| Ouganda                           | S/O              | 0,15                 |
| Ukraine                           | 0,48             | 1,00                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Émirats arabes unis                                                                                      | 1,93             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                                                              | 0,80             | 1,67                 |
| États-Unis                                                                                               | 4,05             | 10,73                |
| Ouzbékistan                                                                                              | 0,22             | 0,76                 |
| Venezuela                                                                                                | 1,14             | 0,65                 |
| Îles Vierges britanniques                                                                                | 0,35             | S/O                  |
| Zambie                                                                                                   | S/O              | 0,18                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 11,40            | 6,73                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 9,69             | 4,87                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 9,04             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,05             | 0,09                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,14             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,32)           | 0,32                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,01             | 0,04                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,09)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | (0,03)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,60)           | (0,05)               |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | 0,01             | S/O                  |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | S/O              | (0,01)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,27)           | 0,09                 |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,47)           | 0,34                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,01             | 0,02                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 0,19             | 1,48                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |



| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                 | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                 | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                  |      |         |     |      |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------|------|---------|-----|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           | INDONÉSIE                                             |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| ARGENTINE                                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                                    |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement indonésien  |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                                               | \$                                  | 100                              | \$ 80                     | 0,39                                                            | Total Chine                                                         |                                  |                           |                                                       | 6,500 % éch. 15/07/2030                             | IDR                              | 831 000                   | \$ 46            | 0,22 |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       | 6,500 % éch. 15/04/2036                             |                                  | 543 000                   | 29               | 0,14 |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       | Total Indonésie                                     |                                  |                           | 75               | 0,36 |         |     |      |
| BRÉSIL                                                                                |                                     |                                  |                           | COLOMBIE                                                        |                                                                     |                                  |                           | IRLANDE                                               |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                         |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                           |                                                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Banco do Brasil S.A.                                                                  |                                     |                                  |                           | Bogota Distrito Capital                                         |                                                                     |                                  |                           | Iridium Capital PLC                                   |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 8,500 % éch. 29/07/2026                                                               | MXN                                 | 2 000                            | 115                       | 0,56                                                            | 13,140 % éch. 05/11/2035                                            | COP                              | 270 000                   | 78                                                    | 0,38                                                | 9,250 % éch. 18/06/2029          | €                         | 250              | 311  | 1,51    |     |      |
| Vale S.A.                                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                 | TES colombien                                                       |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 %                                                                               | BRL                                 | 1 490                            | 115                       | 0,56                                                            | 6,500 % éch. 22/01/2031 (e)                                         |                                  | 416 393                   | 120                                                   | 0,58                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 11,000 % éch. 22/08/2029                                            |                                  | 662 200                   | 187                                                   | 0,91                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 11,750 % éch. 24/01/2035                                            |                                  | 1 571 700                 | 448                                                   | 2,17                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 12,000 % éch. 13/03/2058                                            |                                  | 7 200                     | 2                                                     | 0,01                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 12,500 % éch. 27/02/2030                                            |                                  | 316 400                   | 92                                                    | 0,45                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 12,750 % éch. 28/11/2040                                            |                                  | 430 200                   | 130                                                   | 0,63                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 13,250 % éch. 09/02/2033                                            |                                  | 285 600                   | 87                                                    | 0,42                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | Total Colombie                                                      |                                  |                           | 1 144                                                 | 5,55                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                       |                                     |                                  |                           | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE                                              |                                                                     |                                  |                           | KAZAKHSTAN                                            |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Oi S.A.                                                                               |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                           |                                                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 30/12/2050                                                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République tchèque |                                                                     |                                  |                           | Baiterek National Investment Holding JSC              |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 03/06/2036                                         |                                                                     |                                  |                           | CZK                                                   | 40                                                  | 2                                | 0,01                      | 16,950 % éch.    |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/09/2030                                         |                                                                     |                                  |                           |                                                       | 500                                                 | 24                               | 0,12                      | 02/04/2029       | KZT  | 106 500 | 226 | 1,10 |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | Total République tchèque                                        |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     | 26                               | 0,13                      | 16,950 % éch.    |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           | 02/04/2031       |      | 106 500 | 230 | 1,11 |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           | Total Kazakhstan |      |         | 456 | 2,21 |
| ÎLES CAÏMANS                                                                          |                                     |                                  |                           | DANEMARK                                                        |                                                                     |                                  |                           | KENYA                                                 |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                                                   |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                   |                                                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | Jyske Realkredit A/S                                            |                                                                     |                                  |                           | Obligation d'infrastructure de la république du Kenya |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2026 (c)                                                           |                                     | 2                                | 0                         | 0,00                                                            | 1,500 % éch. 01/10/2053                                             | DKK                              | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                | 12,500 % éch.                    |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2027 (c)                                                           |                                     | 3                                | 0                         | 0,00                                                            | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                                |                                  |                           |                                                       |                                                     | 10/01/2033                       | KES                       | 17 200           | 134  | 0,65    |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2028 (c)                                                           |                                     | 5                                | 0                         | 0,00                                                            | 1,000 % éch. 01/10/2050                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2029 (c)                                                           |                                     | 5                                | 0                         | 0,00                                                            | 1,500 % éch. 01/10/2053                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2030 (c)                                                           |                                     | 6                                | 0                         | 0,00                                                            | Nykredit Realkredit A/S                                             |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2031 (c)                                                           |                                     | 6                                | 0                         | 0,00                                                            | 1,000 % éch. 01/10/2050                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (c)                                                           |                                     | 11                               | 0                         | 0,00                                                            | 1,000 % éch. 01/10/2053                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 1,500 % éch. 01/10/2053                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | Realkredit Danmark A/S                                              |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 1,000 % éch. 01/10/2050                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | 1,500 % éch. 01/10/2053                                             |                                  | 0                         | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 | Total Danemark                                                      |                                  |                           | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           | 0                                                     | 0,00                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                         |                                     |                                  |                           | RÉPUBLIQUE DOMINICAINE                                          |                                                                     |                                  |                           | KOWEÏT                                                |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                           |                                                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               |                                     | 1                                | 0                         | 0,00                                                            | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                  |                           |                                                       | Obligation internationale du gouvernement du Koweït |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                 | 10,500 % éch. 15/03/2037                                            | DOP                              | 8 000                     | 144                                                   | 0,70                                                | 4,016 % éch. 09/10/2028          | \$                        | 200              | 198  | 0,96    |     |      |
| 6,250 % éch. 28/12/2028 (a)                                                           |                                     | 4                                | 0                         | 0,00                                                            | 10,750 % éch. 01/06/2036                                            |                                  | 16 000                    | 291                                                   | 1,41                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                 | 13,625 % éch. 03/02/2033                                            |                                  | 8 000                     | 162                                                   | 0,78                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 6,500 % éch. 28/12/2029 (a)                                                           |                                     | 7                                | 0                         | 0,00                                                            | 13,625 % éch. 10/02/2034                                            |                                  | 200                       | 4                                                     | 0,02                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                 | Total République dominicaine                                        |                                  |                           | 601                                                   | 2,91                                                |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 6,750 % éch. 28/12/2030 (a)                                                           |                                     | 8                                | 0                         | 0,00                                                            |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 7,000 % éch. 28/12/2031 (a)                                                           |                                     | 13                               | 0                         | 0,00                                                            |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 7,250 % éch. 28/12/2032 (a)                                                           |                                     | 12                               | 1                         | 0,01                                                            |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
| 7,721 % éch. 28/12/2028 (a)                                                           |                                     | 3                                | 0                         | 0,00                                                            |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                 |                                                                     |                                  |                           |                                                       |                                                     |                                  |                           |                  |      |         |     |      |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>PARAGUAY</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>SUPRANATIONALES</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>RD Michigan Property Owner LLC</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen |                                     |                                  |                           | Banque Ouest Africaine de Développement                      |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                                                                        | \$ 100                              | \$ 100                           | 0,48                      |
| 7,900 % éch. 09/02/2031                              | PYG                                 | 428 000                          | \$ 68                     | 6,250 % éch. 14/10/2040                                      | € 100                               | \$ 110                           | 0,53                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 04/03/2035                              |                                     | 216 000                          | 34                        |                                                              |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 04/04/2038                              |                                     | 144 000                          | 23                        |                                                              |                                     |                                  |                           | Banc of America Mortgage Trust                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Total Paraguay                                       |                                     |                                  | 125                       | Banque européenne pour la reconstruction et le développement |                                     |                                  |                           | 5,508 % éch. 25/07/2034                                                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 6,060 % éch. 02/12/2029                                      | AZN                                 | 500                              | 294                       | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 6,300 % éch. 31/03/2028                                      |                                     | 400                              | 235                       | 4,015 % éch. 25/05/2047                                                                        | 4                                   | 4                                | 0,02                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 16/01/2029                                      |                                     | 650                              | 383                       | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Banque européenne d'investissement                           |                                     |                                  |                           | 3,871 % éch. 25/04/2037                                                                        | 139                                 | 95                               | 0,46                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 15/11/2029                                      | PLN                                 | 800                              | 203                       | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 25/07/2030                                      |                                     | 100                              | 26                        | 3,918 % éch. 26/12/2046                                                                        | 9                                   | 7                                | 0,03                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Total Supranationales                                        |                                     |                                  | 1 251                     | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           | 3,833 % éch. 25/01/2037                                                                        | 1                                   | 1                                | 0,01                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>TURQUIE</b>                                               |                                     |                                  |                           | 4,445 % éch. 25/09/2037                                                                        | 58                                  | 56                               | 0,27                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                           | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement turc               |                                     |                                  |                           | 5,737 % éch. 25/08/2035                                                                        | 2                                   | 1                                | 0,01                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 36,000 % éch. 12/08/2026                                     | TRY                                 | 3 600                            | 77                        | GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 19/08/2026                                     |                                     | 200                              | 4                         | 6,427 % éch. 25/10/2033                                                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 17/05/2028                                     |                                     | 7 100                            | 154                       | IndyMac Mortgage Loan Trust                                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Total Turquie                                                |                                     |                                  | 235                       | 3,393 % éch. 25/11/2037                                                                        | 48                                  | 39                               | 0,19                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           | 4,355 % éch. 25/12/2034                                                                        | 2                                   | 2                                | 0,01                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                   |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/07/2045                                                                        | 19                                  | 15                               | 0,07                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                           | Lehman XS Trust                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                                    |                                     |                                  |                           | 4,143 % éch. 25/09/2046                                                                        | 85                                  | 78                               | 0,38                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,789 % éch. 03/06/2031                                      | \$ 200                              | 200                              | 0,97                      | Residential Accredit Loans, Inc. Trust                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           | 4,655 % éch. 25/10/2037                                                                        | 37                                  | 30                               | 0,15                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ROYAUME-UNI</b>                                           |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,976 % éch. 25/02/2037                                                                        | 5                                   | 5                                | 0,02                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | ICBC Standard Bank PLC                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 333                              | 1,62                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 20,000 % éch. 18/09/2029                                     | UZS                                 | 1 500 000                        | 125                       |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 20,000 % éch. 13/12/2029                                     |                                     | 1 500 000                        | 125                       |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Total Royaume-Uni                                            |                                     |                                  | 250                       |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉTATS-UNIS</b>                                            |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                           |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement colombien</b>                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                   |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 24/01/2035                                                                        | COP 141 700                         | 40                               | 0,20                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 5,330 % éch. 25/01/2035                                      | \$ 34                               | 34                               | 0,17                      | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Fannie Mae                                                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,823 % éch. 25/07/2045                                      |                                     | 6                                | 4                         | 4,678 % éch. 25/01/2055                                                                        | \$ 136                              | 137                              | 0,66                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.            |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/02/2037                                      |                                     | 13                               | 0,06                      | Billets du Trésor américain                                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,888 % éch. 25/11/2035                                      |                                     | 32                               | 0,16                      | 4,250 % éch. 15/08/2035                                                                        | 10                                  | 10                               | 0,05                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC            |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                                                               |                                     | 994                              | 4,82                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/11/2036                                      |                                     | 1                                | 0,01                      | <b>URUGUAY</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Fieldstone Mortgage Investment Trust                         |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,143 % éch. 25/05/2036                                      |                                     | 56                               | 0,21                      | Obligation internationale du gouvernement uruguayen                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                                  |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/12/2028 (e)                                                                    | UYU 2 855                           | 73                               | 0,36                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,853 % éch. 25/01/2037                                      |                                     | 39                               | 0,12                      | <b>VENEZUELA</b>                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Home Equity Asset Trust                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/11/2032                                      |                                     | 4                                | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement vénézuélien                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | HSI Asset Loan Obligation Trust                              |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 13/10/2019 ^                                                                      | \$ 100                              | 45                               | 0,22                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/12/2036                                      |                                     | 2                                | 0,00                      | 8,250 % éch. 13/10/2024 ^                                                                      | 25                                  | 11                               | 0,05                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                       |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 15/09/2027 ^                                                                      | 100                                 | 49                               | 0,24                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,823 % éch. 25/05/2037                                      |                                     | 2                                | 0,01                      | Total Venezuela                                                                                |                                     | 105                              | 0,51                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,528 % éch. 25/01/2035                                      |                                     | 23                               | 0,11                      | <b>ZAMBIE</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,558 % éch. 25/03/2034                                      |                                     | 28                               | 0,15                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement zambien                                              |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 5,113 % éch. 25/02/2033                                      |                                     | 6                                | 0,03                      | 23,000 % éch. 22/01/2031                                                                       | ZMW 400                             | 28                               | 0,13                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | New Century Home Equity Loan Trust                           |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/05/2036                                      |                                     | 3                                | 0,01                      | <b>BILLETS À COURT TERME</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Saxon Asset Securities Trust                                 |                                     |                                  |                           | Federal Home Loan Bank                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,073 % éch. 25/09/2037                                      |                                     | 6                                | 0,02                      | 3,630 % éch. 04/09/2026                                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Soundview Home Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           | (c)(d)                                                                                         | \$ 1 000                            | 993                              | 4,82                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,843 % éch. 25/06/2037                                      |                                     | 3                                | 0,01                      | <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,933 % éch. 25/07/2037                                      |                                     | 43                               | 0,18                      | 23,650 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust        |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (c)(d)                                                                              | EGP 100                             | 2                                | 0,01                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 25/10/2037                                      |                                     | 112                              | 0,34                      | 24,000 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                    |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (c)(d)                                                                              | 200                                 | 4                                | 0,02                      |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/05/2037                                      |                                     | 41                               | 0,18                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust            |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/10/2036                                      |                                     | 3                                | 0,00                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  | 374                       | 1,81                                                                                           |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|---------|-------------------------------------|----------------------------------|
| 24,001 % éch. 13/10/2026 (c)(d) EGP | 1 900                               | \$ 36                            | 0,18                      | 21,333 % éch. 15/09/2026 (c)(d) NGN | 12 000                              | \$ 8                             | 0,04                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |         |                                     |                                  |
| 24,050 % éch. 20/10/2026 (c)(d)     | 1 100                               | 21                               | 0,10                      | 21,380 % éch. 03/11/2026 (c)(d)     | 97 100                              | 66                               | 0,32                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |         |                                     |                                  |
| 24,060 % éch. 20/10/2026 (c)(d)     | 100                                 | 2                                | 0,01                      | 21,702 % éch. 18/08/2026 (c)(d)     | 109 400                             | 77                               | 0,37                      | PIMCO Select Funds plc -                 |         |                                     |                                  |
| 24,200 % éch. 22/09/2026 (c)(d)     | 1 200                               | 23                               | 0,11                      | 21,746 % éch. 04/08/2026 (c)(d)     | 227 400                             | 162                              | 0,79                      | PIMCO US Dollar Short-                   |         |                                     |                                  |
| 24,351 % éch. 22/09/2026 (c)(d)     | 2 500                               | 48                               | 0,23                      |                                     |                                     |                                  |                           | Term Floating NAV                        | 11 963  | \$ 119                              | 0,58                             |
| 24,400 % éch. 17/11/2026 (c)(d)     | 11 350                              | 212                              | 1,03                      |                                     |                                     | 1 241                            | 6,02                      | Fund (f)                                 |         |                                     |                                  |
|                                     |                                     | 348                              | 1,69                      | <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN</b>  |                                     |                                  |                           | PIMCO Specialty Funds                    |         |                                     |                                  |
| <b>BONS DU TRÉSOR HONGROIS</b>      |                                     |                                  |                           | 7,400 % éch. 05/08/2026 (c)(d) ZAR  | 300                                 | 18                               | 0,09                      | Ireland p.l.c. - PIMCO                   |         |                                     |                                  |
| 6,082 % éch. 02/07/2026 (c)(d) HUF  | 126 000                             | 405                              | 1,96                      | 7,400 % éch. 07/10/2026 (c)(d)      | 100                                 | 6                                | 0,03                      | China Bond Fund (f)                      | 15 103  | 237                                 | 1,15                             |
| <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>      |                                     |                                  |                           | 7,766 % éch. 03/03/2027 (c)(d)      | 21 600                              | 1 259                            | 6,11                      |                                          |         | 356                                 | 1,73                             |
| 18,779 % éch. 21/07/2026 (c)(d) NGN | 34 535                              | 25                               | 0,12                      | 7,894 % éch. 10/03/2027 (c)(d)      | 2 200                               | 128                              | 0,62                      |                                          |         |                                     |                                  |
| 20,537 % éch. 14/01/2027 (c)(d)     | 428 700                             | 281                              | 1,36                      |                                     |                                     | 1 411                            | 6,85                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |         |                                     |                                  |
| 20,607 % éch. 21/01/2027 (c)(d)     | 412 000                             | 268                              | 1,30                      | Total des Instruments à court terme |                                     | 4 398                            | 21,34                     | PIMCO ETFs plc - Fonds                   |         |                                     |                                  |
| 20,677 % éch. 28/01/2027 (c)(d)     | 413 500                             | 268                              | 1,30                      | <b>Total des Valeurs mobilières</b> |                                     | \$ 18 016                        | 87,39                     | PIMCO US Dollar Short                    |         |                                     |                                  |
| 21,064 % éch. 13/10/2026 (c)(d)     | 25 400                              | 17                               | 0,08                      |                                     |                                     |                                  |                           | Maturity UCITS ETF (f)                   | 10 900  | 1 095                               | 5,31                             |
| 21,150 % éch. 20/10/2026 (c)(d)     | 25 500                              | 17                               | 0,08                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                     |                                  |
| 21,186 % éch. 07/07/2026 (c)(d)     | 24 062                              | 18                               | 0,09                      |                                     |                                     |                                  |                           | <b>Total des Fonds d'investissement</b>  |         | \$ 1 451                            | 7,04                             |
| 21,265 % éch. 20/10/2026 (c)(d)     | 25 400                              | 17                               | 0,08                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                     |                                  |
| 21,270 % éch. 01/09/2026 (c)(d)     | 14 000                              | 10                               | 0,05                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                     |                                  |
| 21,310 % éch. 20/10/2026 (c)(d)     | 3 617                               | 3                                | 0,02                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                     |                                  |
| 21,323 % éch. 20/10/2026 (c)(d)     | 5 100                               | 4                                | 0,02                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                          |         |                                     |                                  |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                       | Type | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------|------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre   | Long | 09/2026              | 3                     | \$ 3                                    | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre    | Long | 09/2026              | 1                     | 2                                       | 0,01                   |
|                                                                                   |      |                      |                       | \$ 5                                    | 0,02                   |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b> |      |                      |                       | \$ 5                                    | 0,02                   |

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,250 %      | 16/09/2031         | INR 38 860           | \$ (7)                                  | (0,03)                 |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,500        | 16/09/2036         | 1 550                | (1)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 17/06/2027         | ¥ 240 000            | (1)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 17/12/2027         | 110 000              | 2                                       | 0,01                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/03/2028         | 80 000               | (1)                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 16/09/2028         | 161 000              | (2)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,403        | 30/12/2026         | SGD 690              | (1)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | 320                  | (3)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,250        | 16/09/2028         | THB 10 300           | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,500        | 16/09/2031         | 1 650                | 0                                       | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 17/06/2028         | \$ 2 300             | (2)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 16/09/2028         | 100                  | 0                                       | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 18/06/2030         | 500                  | (3)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 18/06/2034         | 100                  | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 18/06/2055         | 30                   | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 17/12/2028         | 200                  | 4                                       | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 20/12/2033         | 70                   | (3)                                     | (0,02)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/09/2027         | 600                  | (8)                                     | (0,04)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/09/2030         | 100                  | 2                                       | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/12/2030         | 150                  | (4)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 20/06/2031         | 1 350                | 4                                       | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/09/2035         | 230                  | 4                                       | 0,02                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/12/2035         | 400                  | (12)                                    | (0,06)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/06/2036         | 400                  | (4)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                  | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 16/09/2036         | 300                  | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 18/12/2036         | 50                   | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/12/2045         | 20                   | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/12/2055         | 70                   | 3                                       | 0,02                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000        | 18/03/2036         | 100                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000        | 17/06/2056         | 55                   | (1)                                     | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,086        | 13/01/2055         | 100                  | (3)                                     | (0,01)                 |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 9,783 %   | 04/01/2027      | BRL 2 300         | \$ 40                             | 0,19                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 9,795     | 04/01/2027      | 800               | (14)                              | (0,07)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 9,832     | 04/01/2027      | 400               | (7)                               | (0,03)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 9,840     | 04/01/2027      | 600               | (10)                              | (0,05)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 9,840     | 04/01/2027      | 1 000             | 18                                | 0,09                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 9,842     | 04/01/2027      | 900               | (16)                              | (0,07)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 9,946     | 04/01/2027      | 400               | 7                                 | 0,04                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 10,044    | 02/01/2029      | 800               | (18)                              | (0,09)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 10,225    | 04/01/2027      | 300               | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 10,235    | 04/01/2027      | 300               | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 10,565    | 04/01/2027      | 300               | (4)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 10,671    | 04/01/2027      | 1 600             | 20                                | 0,09                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 10,768    | 04/01/2027      | 500               | 6                                 | 0,03                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 10,792    | 04/01/2027      | 3 900             | (49)                              | (0,23)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 10,872    | 04/01/2027      | 800               | 10                                | 0,05                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 10,880    | 04/01/2027      | 1 300             | 15                                | 0,07                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 10,943    | 04/01/2027      | 700               | 8                                 | 0,04                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 10,980    | 04/01/2027      | 1 000             | (12)                              | (0,05)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 11,133    | 04/01/2027      | 700               | 7                                 | 0,03                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 11,490    | 02/01/2029      | 800               | (12)                              | (0,05)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 11,513    | 04/01/2027      | 500               | 4                                 | 0,02                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 11,523    | 02/01/2029      | 1 300             | (19)                              | (0,09)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 11,560    | 04/01/2027      | 500               | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 11,575    | 03/01/2028      | 300               | 3                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 11,590    | 03/01/2028      | 200               | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 11,695    | 03/01/2028      | 900               | (9)                               | (0,05)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 11,928    | 02/01/2029      | 1 100             | 14                                | 0,06                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,243    | 02/01/2029      | 200               | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,569    | 02/01/2029      | 200               | 1                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,716    | 02/01/2029      | 600               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,750    | 02/01/2029      | 300               | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,760    | 02/01/2029      | 1 100             | 7                                 | 0,04                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 12,808    | 02/01/2029      | 800               | 4                                 | 0,02                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,867    | 02/01/2031      | 600               | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 12,905    | 02/01/2029      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,041    | 02/01/2031      | 700               | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,055    | 02/01/2029      | 1 000             | (5)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,056    | 02/01/2029      | 1 000             | (5)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,060    | 02/01/2029      | 1 000             | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,120    | 02/01/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,156    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,189    | 02/01/2031      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,235    | 02/01/2031      | 1 400             | (5)                               | (0,03)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,235    | 02/01/2035      | 600               | (2)                               | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,245    | 02/01/2031      | 600               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,270    | 02/01/2029      | 600               | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,289    | 02/01/2029      | 1 700             | 5                                 | 0,03                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,291    | 02/01/2029      | 700               | (3)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,296    | 02/01/2031      | 600               | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,310    | 02/01/2031      | 500               | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,320    | 02/01/2029      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CDI BRL à un an         | 13,340    | 02/01/2029      | 300               | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,350    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,357    | 02/01/2029      | 900               | 3                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,405    | 02/01/2029      | 700               | (3)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,425    | 02/01/2029      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,430    | 02/01/2029      | 400               | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,500    | 02/01/2029      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,518    | 02/01/2029      | 400               | 1                                 | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,520    | 02/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,545    | 02/01/2029      | 400               | 1                                 | 0,01                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      | 300               | (1)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,564    | 02/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,575    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,589    | 02/01/2029      | 900               | 3                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,698    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,700    | 02/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,844    | 02/01/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,882    | 02/01/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,899    | 02/01/2031      | 1 000             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 13,923    | 02/01/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,927    | 04/01/2027      | 2 200             | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,979    | 02/01/2031      | 800               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,998    | 02/01/2029      | 800               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,020    | 04/01/2027      | 1 000             | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,026    | 02/01/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,035    | 02/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,087    | 02/01/2029      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an         | 14,140    | 02/01/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,140    | 02/01/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,185    | 02/01/2029      | 700               | 0                                 | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,213 %  | 02/01/2029      | BRL 300           | \$ 0                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,245    | 02/01/2029      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,247    | 02/01/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,334    | 02/01/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,370    | 02/01/2029      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,505    | 02/01/2031      | 500               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 14,514    | 02/01/2031      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,570    | 02/01/2029      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,620    | 02/01/2029      | 700               | 1                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,695    | 02/01/2029      | 600               | 1                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 15,065    | 02/01/2029      | 500               | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 15,130    | 02/01/2029      | 300               | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 17/06/2028      | CAD 1 700         | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 17/06/2036      | 400               | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 16/09/2031      | CNY 7 830         | (7)                               | (0,04)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 4,040     | 13/01/2031      | COP 1 002 000     | 69                                | 0,33                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 4,200     | 18/09/2030      | 514 560           | (19)                              | (0,09)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,400     | 09/09/2029      | 633 800           | (17)                              | (0,08)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,410     | 09/08/2028      | 296 600           | 6                                 | 0,03                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,520     | 13/08/2031      | 81 100            | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,530     | 02/01/2029      | 129 000           | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,540     | 09/08/2031      | 300 000           | 10                                | 0,04                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,580     | 09/08/2031      | 278 300           | 9                                 | 0,04                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,650     | 12/08/2031      | 72 700            | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,705     | 26/03/2031      | 548 600           | 16                                | 0,07                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,770     | 18/07/2029      | 1 043 500         | (25)                              | (0,11)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,800     | 30/06/2032      | 112 500           | 3                                 | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,805     | 22/10/2029      | 775 500           | (16)                              | (0,07)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,960     | 01/09/2028      | 540 900           | 6                                 | 0,03                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,970     | 28/04/2028      | 234 900           | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,990     | 25/11/2034      | 284 900           | 8                                 | 0,04                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,020     | 04/12/2030      | 235 500           | 5                                 | 0,03                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,150     | 28/04/2028      | 208 000           | 3                                 | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,190     | 13/06/2029      | 451 760           | (8)                               | (0,04)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,215     | 14/11/2028      | 356 300           | (7)                               | (0,03)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,250     | 18/06/2030      | 37 000            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,280     | 26/12/2027      | 265 900           | 3                                 | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,342     | 17/09/2027      | 192 000           | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,350     | 18/06/2030      | 164 400           | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,430     | 15/05/2030      | 55 800            | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,498     | 16/05/2030      | 243 000           | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,565     | 30/12/2027      | 166 500           | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,598     | 17/09/2030      | 23 000            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,630     | 17/09/2030      | 50 600            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,650     | 17/09/2030      | 124 000           | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,690     | 26/12/2031      | 232 000           | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,710     | 17/09/2030      | 116 400           | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,725     | 10/06/2030      | 65 000            | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,755     | 17/09/2030      | 24 200            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,770     | 10/06/2030      | 196 000           | (3)                               | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,790     | 10/06/2030      | 130 000           | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,800     | 18/06/2030      | 189 000           | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,933     | 22/08/2029      | 300 400           | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,980     | 17/12/2030      | 312 200           | 4                                 | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,045     | 30/12/2031      | 28 600            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,050     | 02/05/2033      | 35 360            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,055     | 26/08/2026      | 30 730            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,300     | 17/12/2030      | 59 000            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,329     | 17/12/2035      | 103 000           | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,525     | 18/06/2035      | 67 000            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,655     | 24/01/2035      | 72 000            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,820     | 24/01/2035      | 130 400           | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,700    | 17/06/2031      | 11 700            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,710    | 17/06/2031      | 11 500            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,720    | 18/03/2035      | 179 700           | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,730    | 17/06/2031      | 11 700            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,740    | 17/06/2031      | 12 700            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,745    | 17/06/2031      | 23 400            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,750    | 18/03/2031      | 36 700            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,770    | 17/06/2031      | 23 400            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,776    | 18/03/2031      | 180 800           | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,111    | 18/03/2031      | 559 700           | (8)                               | (0,04)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,200    | 17/06/2029      | 17 500            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,210    | 17/06/2029      | 18 100            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,250    | 17/06/2028      | 104 400           | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,425    | 17/06/2028      | 24 900            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,450    | 17/06/2028      | 77 500            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,500    | 17/06/2031      | 185 600           | 3                                 | 0,02                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,550    | 17/06/2028      | 74 500            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,634    | 17/06/2028      | 160 100           | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,700    | 17/06/2031      | 26 000            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,720    | 17/06/2031      | 25 000            | 0                                 | 0,00                |



# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable      | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |        |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|--------|
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,730 %  | 17/06/2031      | COP               | 26 000                            | \$ 0                | 0,00   |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,870    | 17/06/2031      |                   | 72 000                            | (1)                 | (0,01) |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,885    | 17/06/2031      |                   | 145 000                           | (3)                 | (0,01) |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,910    | 17/06/2031      |                   | 72 000                            | (1)                 | (0,01) |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,925    | 17/06/2033      |                   | 165 000                           | (4)                 | (0,02) |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,930    | 17/06/2033      |                   | 92 000                            | (3)                 | (0,01) |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,000    | 17/06/2027      |                   | 569 000                           | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,170    | 18/03/2029      |                   | 36 000                            | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,220    | 17/06/2027      |                   | 49 600                            | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,230    | 17/06/2027      |                   | 49 600                            | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,250    | 17/06/2027      |                   | 99 100                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,330    | 18/03/2028      |                   | 51 000                            | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,340    | 17/06/2027      |                   | 93 500                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | KORIBOR KRW à 3 mois         | 3,500     | 16/09/2036      | KRW               | 528 900                           | (3)                 | (0,01) |
| À payer <sup>(1)</sup>           | KORIBOR KRW à 3 mois         | 3,750     | 16/09/2028      |                   | 2 235 700                         | 4                   | 0,02   |
| À recevoir                       | STIBOR SEK à 3 mois          | 2,021     | 07/10/2029      | SEK               | 2 000                             | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois          | 2,298     | 07/10/2029      |                   | 2 000                             | 2                   | 0,01   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,067     | 21/12/2026      | ZAR               | 3 100                             | (1)                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,510     | 26/05/2031      |                   | 200                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,570     | 11/05/2031      |                   | 500                               | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,610     | 28/04/2031      |                   | 200                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,635     | 04/02/2027      |                   | 3 290                             | (8)                 | (0,04) |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,640     | 02/04/2031      |                   | 300                               | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,673     | 14/04/2031      |                   | 200                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,715     | 26/02/2031      |                   | 300                               | 1                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,745     | 06/03/2028      |                   | 1 800                             | 1                   | 0,01   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,770     | 10/03/2028      |                   | 13 800                            | 1                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,780     | 06/03/2028      |                   | 1 000                             | 1                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,815     | 08/12/2030      |                   | 600                               | 1                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,860     | 15/10/2030      |                   | 200                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,885     | 04/02/2031      |                   | 300                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,910     | 30/10/2030      |                   | 300                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 6,920     | 06/03/2031      |                   | 300                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,040     | 22/09/2030      |                   | 2 214                             | 1                   | 0,01   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,040     | 23/12/2030      |                   | 1 150                             | 1                   | 0,01   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,080     | 31/12/2030      |                   | 650                               | 1                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,091     | 17/02/2036      |                   | 500                               | 1                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,205     | 22/04/2027      |                   | 1 200                             | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,210     | 22/04/2027      |                   | 900                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,270     | 26/08/2030      |                   | 2 200                             | 1                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,310     | 02/09/2030      |                   | 600                               | (1)                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,310     | 02/10/2030      |                   | 100                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,360     | 09/03/2031      |                   | 2 700                             | (3)                 | (0,01) |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,370     | 26/08/2030      |                   | 1 400                             | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,370     | 27/01/2036      |                   | 200                               | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,520     | 02/04/2031      |                   | 800                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,560     | 22/09/2030      |                   | 20                                | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,570     | 27/05/2030      |                   | 500                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,650     | 20/06/2030      |                   | 1 974                             | (1)                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,700     | 08/06/2028      |                   | 2 100                             | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,700     | 18/06/2030      |                   | 3 970                             | (2)                 | (0,01) |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,710     | 13/08/2033      |                   | 1 600                             | (1)                 | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,770     | 19/11/2027      |                   | 100                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,775     | 18/03/2030      |                   | 2 000                             | (2)                 | (0,01) |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,780     | 20/11/2027      |                   | 100                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,790     | 31/01/2030      |                   | 7 700                             | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,810     | 27/03/2030      |                   | 600                               | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,810     | 20/06/2030      |                   | 768                               | 1                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,860     | 18/06/2030      |                   | 2 000                             | 2                   | 0,01   |
| À payer <sup>(1)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois           | 7,950     | 07/05/2036      |                   | 100                               | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,080     | 24/04/2036      |                   | 3 500                             | 3                   | 0,01   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,150     | 01/04/2036      |                   | 1 300                             | 2                   | 0,01   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,180     | 02/04/2036      |                   | 200                               | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,185     | 31/07/2026      |                   | 3 500                             | (1)                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,195     | 21/12/2026      |                   | 3 900                             | (2)                 | (0,01) |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,210     | 21/12/2026      |                   | 1 600                             | 1                   | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,355     | 31/01/2030      |                   | 900                               | (1)                 | 0,00   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,440     | 02/11/2028      |                   | 1 600                             | (1)                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,500     | 17/10/2027      |                   | 8 760                             | 8                   | 0,04   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,650     | 31/01/2030      |                   | 200                               | (1)                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,735     | 31/01/2030      |                   | 3 100                             | 4                   | 0,02   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois           | 8,872     | 24/07/2034      |                   | 600                               | 2                   | 0,01   |
| À recevoir                       | JIBAR ZAR à 3 mois           | 9,330     | 09/02/2034      |                   | 1 900                             | (6)                 | (0,03) |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,490     | 01/10/2028      | CLP               | 11 000                            | 0                   | 0,00   |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,540     | 01/10/2028      |                   | 60 800                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,555     | 08/10/2029      |                   | 26 700                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,590     | 01/10/2029      |                   | 23 000                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,640     | 01/10/2028      |                   | 245 000                           | (1)                 | (0,01) |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,675     | 18/03/2029      |                   | 232 000                           | (1)                 | (0,01) |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,690     | 18/06/2030      |                   | 17 700                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,695     | 14/02/2029      |                   | 21 800                            | 0                   | 0,00   |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois        | 4,715     | 18/06/2030      |                   | 24 300                            | 0                   | 0,00   |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,730 %   | 16/10/2029      | CLP 51 000        | \$ 0                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,740     | 18/03/2029      | 42 000            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,750     | 10/04/2030      | 60 500            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,805     | 17/06/2031      | 4 900             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,900     | 17/06/2031      | 83 200            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,920     | 13/02/2034      | 13 100            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,940     | 01/10/2028      | 40 000            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,970     | 18/06/2032      | 12 500            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 4,980     | 01/10/2028      | 40 000            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,000     | 19/07/2029      | 201 100           | 3                                 | 0,02                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,030     | 23/02/2034      | 70 300            | 1                                 | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,050     | 19/07/2029      | 52 900            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,060     | 18/03/2031      | 13 000            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,070     | 24/06/2031      | 110 600           | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,120     | 18/06/2035      | 9 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,150     | 17/06/2031      | 75 200            | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,165     | 01/08/2029      | 39 690            | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,190     | 17/06/2031      | 6 000             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,215     | 18/03/2036      | 81 000            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,240     | 01/09/2030      | 37 210            | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,245     | 18/03/2036      | 15 000            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 20/03/2028      | 95 100            | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 17/06/2031      | 2 300             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,250     | 13/05/2033      | 22 500            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,280     | 28/02/2030      | 76 000            | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,306     | 17/06/2031      | 45 000            | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,313     | 25/04/2034      | 33 900            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,350     | 01/09/2030      | 37 500            | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,360     | 26/04/2034      | 21 100            | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 01/04/2033      | 22 100            | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 16/11/2033      | 17 400            | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,400     | 03/07/2034      | 31 700            | 1                                 | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,440     | 28/02/2035      | 43 000            | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,450     | 28/06/2034      | 73 000            | (3)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,470     | 01/09/2030      | 50 000            | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,500     | 13/11/2028      | 78 200            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,550     | 05/06/2028      | 81 300            | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,631     | 23/08/2028      | 56 700            | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,690     | 01/09/2030      | 2 400             | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,750     | 13/05/2034      | 23 000            | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,780     | 03/10/2028      | 19 400            | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,790     | 06/10/2033      | 18 000            | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,855     | 05/10/2033      | 46 000            | (3)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,870     | 11/10/2033      | 18 200            | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,920     | 02/10/2028      | 36 000            | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,940     | 20/10/2033      | 8 000             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 5,990     | 20/10/2033      | 76 260            | (6)                               | (0,03)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,146     | 30/10/2032      | 125 400           | (11)                              | (0,05)              |
| À recevoir                       | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,235     | 26/10/2033      | 37 300            | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,370     | 29/06/2029      | 39 000            | 3                                 | 0,01                |
| À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 6,380     | 03/06/2027      | 116 000           | 3                                 | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 1,025     | 29/07/2030      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,130     | 09/04/2030      | 2 200             | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,258     | 05/05/2030      | 400               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,290     | 30/04/2030      | 400               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,315     | 06/05/2030      | 500               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,325     | 06/05/2030      | 1 300             | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,363     | 29/05/2030      | 1 400             | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,410     | 14/05/2030      | 1 000             | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,480     | 15/07/2029      | 3 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,534     | 21/03/2029      | 1 900             | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,554     | 11/06/2030      | 2 000             | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,575     | 03/07/2030      | 4 100             | (3)                               | (0,01)              |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,580     | 25/10/2029      | 6 400             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,605     | 12/07/2029      | 3 400             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,645     | 01/02/2029      | 4 000             | (2)                               | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,670     | 09/02/2031      | 750               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,705     | 12/08/2030      | 80                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,708     | 13/08/2030      | 1 400             | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,720     | 12/02/2031      | 800               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,736     | 12/08/2030      | 2 100             | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,745     | 12/01/2031      | 450               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,761     | 20/10/2030      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,765     | 09/01/2029      | 1 400             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,767     | 17/10/2030      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,773     | 10/04/2031      | 800               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,777     | 15/10/2030      | 240               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,845     | 05/03/2031      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,920     | 09/02/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,930     | 22/05/2036      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,950     | 10/04/2031      | 1 500             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,963     | 27/11/2030      | 400               | 0                                 | 0,00                |



# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,970 %   | 12/02/2031      | CZK 300           | \$ 0                              | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,980     | 04/12/2030      | 350               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 3,981     | 01/12/2030      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,000     | 17/06/2036      | 1 600             | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,018     | 25/11/2030      | 800               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,049     | 12/12/2030      | 550               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,071     | 22/04/2031      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,090     | 29/06/2031      | 1 500             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,100     | 30/06/2031      | 800               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,130     | 03/06/2029      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,130     | 20/07/2031      | 2 500             | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,250     | 27/04/2031      | 1 200             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,335     | 16/06/2031      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,335     | 01/07/2036      | 290               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,375     | 01/07/2036      | 290               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,388     | 15/11/2028      | 7 400             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,395     | 10/03/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,485     | 02/12/2035      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,505     | 16/03/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,510     | 17/06/2036      | 1 200             | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,523     | 01/12/2035      | 2 100             | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,530     | 31/12/2035      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,560     | 23/11/2027      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,611     | 06/06/2028      | 4 390             | (2)                               | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | € 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 50                | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,300     | 03/10/2033      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 2,680     | 29/06/2031      | HUF 6 000         | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,690     | 24/04/2032      | 910               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,735     | 22/04/2032      | 3 400             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,750     | 17/06/2031      | 6 700             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,845     | 27/04/2032      | 1 000             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,890     | 09/05/2030      | 17 500            | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,935     | 21/04/2033      | 3 240             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 5,990     | 21/04/2032      | 2 800             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,070     | 15/04/2036      | 35 300            | 7                                 | 0,03                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,090     | 21/10/2029      | 30 000            | 7                                 | 0,04                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,110     | 30/12/2030      | 150               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,190     | 18/11/2030      | 13 060            | (4)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,210     | 26/06/2030      | 66 600            | (10)                              | (0,05)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,250     | 09/04/2030      | 8 200             | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,270     | 16/06/2030      | 17 300            | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,319     | 03/11/2030      | 2 300             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,363     | 31/01/2030      | 24 400            | 4                                 | 0,02                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,392     | 11/03/2030      | 18 200            | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,435     | 21/11/2030      | 28 300            | (8)                               | (0,04)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,439     | 24/11/2030      | 8 600             | (3)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,450     | 06/06/2029      | 3 250             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 6,580     | 16/05/2035      | 3 200             | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 6,650     | 13/03/2030      | 7 900             | 1                                 | 0,01                |
| À payer                          | BBR HUF à 6 mois        | 7,330     | 06/11/2028      | 37 800            | 5                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 7,840     | 07/02/2033      | 6 600             | (4)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | BBR HUF à 6 mois        | 8,740     | 28/04/2028      | 173 400           | (8)                               | (0,04)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 0,925     | 16/10/2030      | PLN 100           | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 0,980     | 09/06/2030      | 300               | 10                                | 0,04                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 2,920     | 13/12/2031      | 1 400             | (17)                              | (0,08)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 2,950     | 13/12/2026      | 1 500             | (4)                               | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,710     | 25/07/2030      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,962     | 06/05/2030      | 400               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,015     | 17/04/2030      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,019     | 18/04/2030      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,049     | 18/04/2030      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,065     | 24/11/2030      | 140               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,075     | 07/03/2027      | 800               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,161     | 03/03/2036      | 800               | 8                                 | 0,04                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,180     | 22/05/2036      | 250               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,195     | 29/09/2030      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,200     | 13/05/2036      | 50                | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,207     | 30/01/2036      | 100               | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,259     | 08/08/2029      | 500               | (5)                               | (0,02)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,313     | 25/07/2029      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,320     | 09/03/2027      | 150               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,325     | 20/05/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,328     | 25/07/2029      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,349     | 06/03/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,353     | 23/10/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,355     | 04/11/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,356     | 17/10/2035      | 40                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,380     | 22/05/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,388     | 09/08/2029      | 500               | (5)                               | (0,03)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,393     | 16/10/2035      | 160               | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,400     | 13/05/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,415 %   | 12/08/2029      | PLN 200           | \$ (2)                            | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,430     | 10/11/2035      | 100               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,434     | 03/11/2035      | 100               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,475     | 26/11/2035      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,520     | 20/04/2036      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,560     | 06/11/2028      | 640               | (6)                               | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,574     | 10/03/2036      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,625     | 01/07/2036      | 50                | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,650     | 28/04/2036      | 1 000             | (9)                               | (0,04)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,660     | 19/02/2029      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,665     | 27/04/2036      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,665     | 01/07/2036      | 50                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,680     | 25/04/2029      | 600               | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 02/12/2035      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 29/04/2036      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,723     | 01/12/2035      | 630               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,730     | 31/12/2035      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,735     | 09/10/2028      | 300               | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,750     | 02/08/2029      | 100               | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,794     | 25/10/2029      | 400               | (6)                               | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,800     | 17/06/2036      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,810     | 16/02/2029      | 200               | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,820     | 25/07/2029      | 500               | (7)                               | (0,04)              |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,855     | 10/02/2030      | 600               | 5                                 | 0,03                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,865     | 18/07/2029      | 100               | 2                                 | 0,01                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,923     | 22/03/2029      | 300               | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,000     | 25/04/2029      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,010     | 25/07/2029      | 100               | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,060     | 25/04/2032      | 290               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,105     | 12/07/2029      | 600               | 12                                | 0,05                |
| À recevoir                       | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,340     | 28/03/2027      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | WIBOR PLN à 6 mois      | 5,430     | 16/03/2028      | 5 670             | 14                                | 0,06                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 6,880     | 02/03/2028      | 2 500             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 6,882     | 02/03/2028      | 3 500             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,220     | 14/06/2028      | 20 600            | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,230     | 14/03/2029      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,350     | 31/01/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,375     | 21/11/2030      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,450     | 13/09/2028      | 3 900             | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,480     | 11/06/2031      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIE MXN à 28 jours      | 7,495     | 04/02/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,500     | 11/09/2030      | 900               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,520     | 11/09/2030      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,520     | 16/04/2031      | 800               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,545     | 12/03/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,550     | 02/03/2028      | 4 300             | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,550     | 29/01/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,550     | 30/01/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIE MXN à 28 jours      | 7,550     | 02/05/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,555     | 24/01/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,570     | 12/03/2031      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,582     | 02/04/2030      | 1 200             | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIE MXN à 28 jours      | 7,600     | 04/04/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,610     | 20/09/2030      | 900               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,620     | 18/04/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,645     | 24/04/2031      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,650     | 18/04/2031      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,660     | 18/04/2031      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIE MXN à 28 jours      | 7,670     | 04/04/2031      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | TIE MXN à 28 jours      | 7,681     | 05/03/2031      | 1 700             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,685     | 07/04/2031      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,700     | 24/12/2030      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,720     | 01/04/2030      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,740     | 20/09/2030      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,748     | 02/04/2030      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,750     | 01/04/2030      | 1 200             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,750     | 11/06/2031      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,753     | 16/04/2030      | 1 500             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,760     | 01/03/2029      | 5 400             | 3                                 | 0,02                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,771     | 12/03/2031      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,775     | 01/04/2030      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,775     | 12/06/2030      | 800               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 7,790     | 01/04/2030      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,790     | 12/06/2030      | 1 800             | (1)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>           | TIE MXN à 28 jours      | 7,820     | 02/05/2031      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,936     | 12/06/2030      | 2 700             | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 7,990     | 31/05/2029      | 4 800             | (4)                               | (0,02)              |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 8,000     | 11/06/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 8,071     | 05/09/2035      | 1 500             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 8,075     | 17/03/2027      | 700               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | TIE MXN à 28 jours      | 8,150     | 12/03/2031      | 1 700             | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                          | TIE MXN à 28 jours      | 8,170     | 26/03/2031      | 800               | 1                                 | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,200 %   | 11/06/2031      | MXN 500           | \$ (1)                            | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,215     | 04/06/2036      | 5 600             | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,250     | 01/03/2029      | 900               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,255     | 11/06/2031      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,267     | 28/02/2030      | 3 500             | (5)                               | (0,02)              |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,270     | 07/03/2035      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,280     | 01/03/2029      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,285     | 06/06/2035      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,318     | 04/06/2036      | 800               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,330     | 01/03/2029      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,340     | 11/06/2031      | 400               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,365     | 28/03/2035      | 2 200             | 3                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,480     | 13/03/2030      | 3 100             | (6)                               | (0,03)              |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,500     | 04/06/2036      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,545     | 23/11/2034      | 400               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,550     | 22/02/2035      | 800               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,595     | 13/03/2030      | 2 100             | (4)                               | (0,02)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,640     | 07/03/2035      | 1 000             | (2)                               | (0,01)              |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,650     | 31/01/2030      | 1 900             | 4                                 | 0,02                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,655     | 07/03/2035      | 1 000             | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,665     | 11/12/2029      | 1 200             | (3)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,740     | 07/03/2035      | 2 600             | (7)                               | (0,03)              |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 8,800     | 12/12/2029      | 2 200             | 5                                 | 0,02                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,873     | 23/11/2034      | 500               | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 8,950     | 17/12/2029      | 300               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 9,131     | 11/12/2034      | 500               | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | TIE MXN à 28 jours      | 9,180     | 08/01/2030      | 2 600             | (7)                               | (0,03)              |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 9,295     | 30/10/2028      | 500               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | TIE MXN à 28 jours      | 9,370     | 21/12/2034      | 1 000             | 5                                 | 0,02                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (94)                           | (0,46)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (94)                           | (0,46)              |

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

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - EUR contre BRL hors cote | BRL 5,850       | 19/08/2026        | 174                              | \$ 3  | \$ 1         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 208                              | 10    | 19           | 0,10                |
| BPS          | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 305                              | 1     | 1            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 305                              | 1     | 1            | 0,01                |
| MYI          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 06/08/2026        | 115                              | 0     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 15 | \$ 22        | 0,11                |

#### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------|--------------|---------------------|
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | JIBAR ZAR à 3 mois      | À payer                          | 7,750 %         | 20/11/2026        | 3 250                            | \$ 1 | \$ 1         | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | PRIBOR CZK à 6 mois     | À payer                          | 4,550           | 19/11/2026        | 4 900                            | 1    | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | WIBOR PLN à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 09/12/2026        | 400                              | 0    | 1            | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | JIBAR ZAR à 3 mois      | À payer                          | 7,750           | 19/11/2026        | 2 000                            | 0    | 1            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 5,250           | 20/01/2028        | 200                              | 4    | 2            | 0,01                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 6 | \$ 6         | 0,03                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre BRL hors cote  | BRL 6,250       | 19/08/2026        | 174                              | \$ (3)  | \$ (1)       | (0,01)              |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 113                              | (1)     | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 42                               | (1)     | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre TRY hors cote  | TRY 53,100      | 07/08/2026        | 79                               | (1)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 417                              | (10)    | (17)         | (0,08)              |
| BPS          | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 305                              | (2)     | (3)          | (0,02)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 9                                | 0       | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 86                               | (1)     | (1)          | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (19) | \$ (22)      | (0,11)              |

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,500 %         | 23/07/2026        | 200                              | \$ 0   | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,800           | 28/07/2026        | 200                              | 0      | 0            | 0,00                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,250           | 20/11/2026        | 6 500                            | (1)    | (1)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | PRIBOR CZK à 6 mois     | À recevoir                       | 3,930           | 16/07/2026        | 900                              | 0      | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | PRIBOR CZK à 6 mois     | À recevoir                       | 4,050           | 19/11/2026        | 9 900                            | (1)    | (1)          | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | WIBOR PLN à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 09/12/2026        | 800                              | 0      | (1)          | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | JIBAR ZAR à 3 mois      | À recevoir                       | 7,250           | 19/11/2026        | 4 100                            | 0      | 0            | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (2) | \$ (3)       | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement brésilien | (1,000) %           | 20/06/2029      | \$ 100                           | \$ 2                   | \$ (3)                            | \$ (1)       | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement saoudien  | (1,000)             | 20/12/2033      | 100                              | 0                      | (1)                               | (1)          | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien  | (1,000)             | 20/06/2034      | 100                              | (1)                    | 0                                 | (1)          | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien  | (1,000)             | 20/12/2034      | 30                               | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              |                                                     |                     |                 |                                  | \$ 1                   | \$ (4)                            | \$ (3)       | (0,02)              |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000 %              | 20/12/2026      | \$ 5                             | \$ 0                   | \$ 0                              | \$ 0         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 10                               | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 7                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/12/2026      | 18                               | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement équatorien | 5,000                | 20/06/2027      | 50                               | 2                      | 0                                 | 2            | 0,01                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement argentin   | 5,000                | 20/06/2027      | 100                              | 1                      | 3                                 | 4            | 0,02                |
|              | SoftBank Group Corp.                                 | 1,000                | 20/06/2027      | ¥ 8 100                          | (1)                    | 1                                 | 0            | 0,00                |
|              |                                                      |                      |                 |                                  | \$ 2                   | \$ 4                              | \$ 6         | 0,03                |

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

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

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

## SWAPS SUR DEVICES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,140 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2033      | \$ 145                               | CNH 977                               | \$ 1                   | \$ 0                              | \$ 1         | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,150 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2036      | 49                                   | 329                                   | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,150 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2038      | 193                                  | 1 299                                 | 1                      | (1)                               | 0            | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                          | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,683 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | \$ 65                                | IDR 1 180 530                         | \$ (1)                 | \$ 0                             | \$ (1)       | 0,00                |
| CBK          | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour plus 0,689 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | IDR 1 421 780                        | \$ 79                                 | 1                      | 0                                | 1            | 0,00                |
| GLM          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,690 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR IDR composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | \$ 80                                | IDR 1 467 610                         | (2)                    | 0                                | (2)          | (0,01)              |
| GST          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,700 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR CNH composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 40                                   | 718 480                               | 0                      | (1)                              | (1)          | 0,00                |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         | 16/09/2036      | 16                                   | CNH 110                               | 0                      | 0                                | 0            | 0,00                |
|              |                                                                                                                     |                                                                                                         |                 |                                      |                                       | \$ 0                   | \$ (2)                           | \$ (2)       | (0,01)              |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GLM          | À payer                          | CHILIBOR CLP à 6 mois   | 3,265 %   | 14/06/2029      | CLP 11 100        | \$ 0                   | \$ (1)                           | \$ (1)       | 0,00                |

### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MBC          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 4,200 %       | INR 6 400         | 10/12/2026      | \$ 0                   | \$ 3                             | \$ 3         | 0,01                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | COP             | 55 \$             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DOP             | 6 177             | 105                | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 127               | RSD 15 087         | 1                     | 1                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 11                | \$ 13              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 288               | 71                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 182               | 54                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PHP             | 5 445             | 88                 | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 27                | 7                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 49                | CNH 332            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 105               | KRW 159 913        | 0                     | (2)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 109               | MYR 444            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 22                | NOK 200            | 0                     | (1)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | DOP             | 889               | \$ 15              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 9                 | ILS 26             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 25                | ZAR 446            | 2                     | 2                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 284               | \$ 16              | (1)                   | (1)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | COP             | 249 959           | 64                 | (7)                   | (7)                                    | (0,03)              |
|              | 09/2026           | MXN             | 86                | 5                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 1 851             | 57                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 197               | PHP 12 169         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | HUF             | 2 948             | € 8                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 0                 | COP 56             | 0                     | 0                                      | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 11/2026           | PEN             | 102       | \$ 30             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | MYR             | 539       |                   | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 03/2027           | ZAR             | 21 600    |                   | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | ARS             | 10 491    |                   | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 628       | € 106             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 279       | \$ 1              | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 83        | 94                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 15 733    | 166               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 15 272    | 95                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 49        | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 11        | ARS 18 199        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 103       | BRL 530           | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17        | CNH 113           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 72        | CNY 488           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 377       | CZK 7 841         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | (0,04)              |
|              | 07/2026           |                 | 17        | ILS 51            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 220       | INR 20 881        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 100       | KRW 152 960       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 26        | KWD 8             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 970       | TWD 30 621        | 0                  | (11)                  | (11)                                    | (0,05)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 1 374     | \$ 84             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 114       | £ 86              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 211 613 | \$ 67             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 132       | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 232       | IDR 4 112 815     | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | 333       | INR 31 824        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 154       | THB 4 960         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 12/2026           | MYR             | 1 257     | \$ 311            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 12/2026           | \$              | 67        | IDR 1 219 854     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           |                 | 22        | KWD 7             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD             | 93        | \$ 321            | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,08                |
|              | 07/2029           |                 | 11        | 38                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 05/2030           |                 | 38        | 130               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,03                |
|              | 08/2030           |                 | 3         | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2031           |                 | 12        | 39                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 06/2031           |                 | 23        | 76                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
| BRC          | 12/2040           | CNH             | 348       | 74                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 247 795   | 72                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 72        | RON 379           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 251       | \$ 61             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 151       | 44                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 15        | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 57        | CNH 386           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 65        | COP 247 795       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           |                 | 19        | ILS 56            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 149       | MYR 606           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 024     | TRY 48 789        | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,04                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 6 784     | \$ 418            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | TRY             | 3 595     | 66                | 0                  | (10)                  | (10)                                    | (0,04)              |
|              | 09/2026           | \$              | 71        | COP 247 795       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 09/2026           |                 | 157       | INR 15 120        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 031     | \$ 200            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP             | 36 017    | 40                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ¥               | 382       | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 577       | 165               | 1                  | (5)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | COP             | 125 588   | 32                | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
| CBK          | 09/2026           | \$              | 1 105     | BRL 5 669         | 0                  | (27)                  | (27)                                    | (0,13)              |
|              | 12/2026           |                 | 10        | PEN 35            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ARS             | 28 940    | \$ 18             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CNY             | 56        | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 496 668   | 132               | 0                  | (12)                  | (12)                                    | (0,05)              |
|              | 07/2026           | PEN             | 101       | 29                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 13        | ARS 21 231        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 63        | BRL 318           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 127       | CNH 861           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 68        | COP 238 340       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 22        | EGP 1 210         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 183       | HUF 55 895        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 26        | IDR 468 442       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19        | ILS 56            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 128       | KZT 68 595        | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,08                |
|              | 07/2026           |                 | 72        | LKR 22 662        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 267       | PEN 909           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 89        | PHP 5 439         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 29        | PLN 106           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 319       | TWD 10 086        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 144       | VND 3 853 440     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | NGN             | 285 828   | \$ 202            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 22        | ILS 64            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 300       | KZT 151 200       | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,05                |
|              | 09/2026           | CLP             | 180 183   | \$ 201            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,03                |
|              | 09/2026           | COP             | 275 493   | 72                | 0                  | (6)                   | (6)                                     | (0,03)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 6 016 475 | 333               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 09/2026           | INR             | 6 253             | \$ 65              | \$ 0                  | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 651               | 190                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             | 5 451             | 89                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | RSD             | 7 773             | 77                 | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | THB             | 1 461             | 45                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1                 | EGP 55             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 54                | IDR 954 797        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 36                | INR 3 392          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 150               | THB 4 840          | 0                     | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 10/2026           | COP             | 21 799            | \$ 6               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 904               | 263                | 1                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 10/2026           | UGX             | 47 840            | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 77                | PEN 268            | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 10/2026           |                 | 6                 | UGX 21 500         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | UZS             | 39 300            | \$ 3               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 223 586           | 62                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | KES             | 80 284            | 608                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN             | 4 085             | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$              | 301               | NGN 437 502        | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 12/2026           |                 | 287               | IDR 5 225 051      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 600               | PEN 2 099          | 11                    | 11                                      | 0,05                |
|              | 01/2027           | PEN             | 556               | \$ 164             | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 05/2027           | \$              | 65                | PEN 229            | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 06/2027           | MNT             | 363 840           | \$ 96              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 6 504             | 69                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             | 82 497            | 174                | 3                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | MYR             | 261               | 65                 | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | THB             | 525               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 147               | CNH 995            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 407               | CZK 8 474          | 0                     | (9)                                     | (0,04)              |
|              | 07/2026           |                 | 85                | EGP 4 539          | 6                     | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           |                 | 75                | IDR 1 350 788      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 27                | INR 2 649          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 26                | KZT 14 098         | 3                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 54                | NOK 498            | 0                     | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 70                | PEN 237            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 26                | PLN 97             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 210               | RON 950            | 0                     | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 3 155             | \$ 195             | 3                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | EGP             | 18 906            | 371                | 0                     | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | KZT             | 389 411           | 803                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 180               | GHS 2 138          | 7                     | 7                                       | 0,03                |
|              | 08/2026           |                 | 600               | KZT 302 280        | 21                    | 21                                      | 0,10                |
|              | 09/2026           | EGP             | 10 600            | \$ 206             | 0                     | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | PEN             | 308               | 90                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 483               | EGP 26 523         | 43                    | 43                                      | 0,21                |
|              | 09/2026           |                 | 35                | IDR 643 436        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 90                | INR 8 565          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 232               | KZT 116 814        | 8                     | 8                                       | 0,04                |
|              | 09/2026           |                 | 24                | PEN 82             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 74                | THB 2 411          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 1 411             | \$ 413             | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 10/2026           | UGX             | 76 125            | 21                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 335               | KZT 169 757        | 9                     | 9                                       | 0,04                |
|              | 10/2026           | UZS             | 933 097           | \$ 73              | 0                     | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 11/2026           | KZT             | 55 929            | 113                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | UZS             | 179 690           | 14                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | MYR             | 539               | 133                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 302               | EGP 17 139         | 27                    | 27                                      | 0,13                |
|              | 12/2026           | UZS             | 1 541 950         | \$ 119             | 0                     | (7)                                     | (0,03)              |
|              | 02/2027           | \$              | 465               | KZT 255 983        | 35                    | 35                                      | 0,16                |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 1 654             | \$ 243             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 303               | 408                | 5                     | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | PEN             | 59                | 17                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 17                | CNH 113            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 52                | € 46               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 117               | ¥ 18 867           | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 158               | PLN 579            | 0                     | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 517             | SGD 1 935          | 0                     | (22)                                    | (0,10)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 4 494             | \$ 272             | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | €               | 46                | 53                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | ¥               | 18 818            | 117                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 243               | CNH 1 650          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 5                 | ILS 13             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 51                | \$ 15              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 706               | INR 67 654         | 4                     | 4                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           |                 | 94                | PEN 322            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ARS             | 5 348             | \$ 4               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DOP             | 3 891             | 64                 | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | €               | 106               | BRL 628            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 96 345            | \$ 307             | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | INR             | 3 698             | 39                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |         | Devise à recevoir |           | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|---------|-------------------|-----------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| IND          | 07/2026           | MYR             | 62      | \$                | 15        | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 4       | ARS               | 5 348     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 234     | BRL               | 1 183     | 0                  | (6)                   | (6)                                     | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 3       | CAD               | 5         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 70      | CNH               | 473       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 70      | COP               | 243 670   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 102     | INR               | 9 615     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 35      | MYR               | 143       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 24      | RON               | 108       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 280     | \$                | 17        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 628     | €                 | 105       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 5       | \$                | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DOP             | 7 622   |                   | 124       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 372     | DOP               | 23 141    | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,06                |
|              | 08/2026           |                 | 12      | INR               | 1 148     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ARS             | 1 882   | \$                | 1         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 80 370  |                   | 22        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | DOP             | 20 700  |                   | 345       | 3                  | (1)                   | 2                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | INR             | 37 168  |                   | 393       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | MXN             | 741     |                   | 43        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1       | ARS               | 1 882     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 12      | DOP               | 732       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 138     | EGP               | 7 532     | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,05                |
|              | 09/2026           |                 | 160     | IDR               | 2 875 758 | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 592     | INR               | 57 048    | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,03                |
|              | 09/2026           |                 | 173     | THB               | 5 579     | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 10/2026           | DOP             | 1 072   | \$                | 18        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 18      | MNT               | 67 264    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 250 977 | \$                | 70        | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | DOP             | 11 736  |                   | 193       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | 167 880 |                   | 43        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 12/2026           | DOP             | 1 195   |                   | 20        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | CRC             | 84 168  |                   | 180       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 01/2027           | \$              | 209     | CRC               | 105 185   | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,10                |
|              | 04/2027           |                 | 22      | MNT               | 83 849    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2027           |                 | 22      |                   | 84 310    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2028           |                 | 65      |                   | 258 414   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2028           |                 | 60      |                   | 245 042   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2029           |                 | 56      |                   | 233 051   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2029           |                 | 51      |                   | 221 061   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2030           |                 | 47      |                   | 209 070   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2030           |                 | 43      |                   | 197 211   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 04/2031           |                 | 40      |                   | 183 878   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 144     | MYR               | 578       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 03/2027           | ZAR             | 2 200   | \$                | 131       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 9       |                   | 6         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 968     |                   | 188       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             | 2 702   |                   | 397       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | EGP             | 1 494   |                   | 24        | 0                  | (6)                   | (6)                                     | (0,03)              |
|              | 07/2026           | KZT             | 5 432   |                   | 11        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 170     |                   | 42        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 411   |                   | 143       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 7       | AUD               | 10        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 28      | BRL               | 142       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 133     | CNH               | 899       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 574     | HUF               | 175 518   | 0                  | (12)                  | (12)                                    | (0,05)              |
|              | 07/2026           |                 | 160     | ILS               | 460       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 9       | INR               | 883       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 47      | MYR               | 194       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 110     | PEN               | 384       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 202     | PLN               | 737       | 0                  | (6)                   | (6)                                     | (0,03)              |
|              | 08/2026           |                 | 6       | AUD               | 9         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 31      | ILS               | 92        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 143     | NOK               | 1 412     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 8 783   | \$                | 92        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 567     |                   | 32        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 5 823   |                   | 178       | 2                  | (1)                   | 1                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 156     | IDR               | 2 855 844 | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 23      | INR               | 2 214     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 111   | MXN               | 19 302    | 0                  | (14)                  | (14)                                    | (0,06)              |
|              | 09/2026           |                 | 29      | PEN               | 100       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 395     | THB               | 12 909    | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 10/2026           |                 | 188     | BRL               | 989       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 10/2026           | UZS             | 316 467 | \$                | 25        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 12/2026           | MXN             | 676     |                   | 38        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 21      | MXN               | 367       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 02/2027           |                 | 110     | MNT               | 417 465   | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
| MBC          | 06/2027           | UZS             | 202 229 | \$                | 15        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | €               | 50      |                   | 58        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 6 529   |                   | 69        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 288     |                   | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 607     |                   | 150       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 455     |                   | 46        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir |           | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|-----------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | THB             | 2 398     | \$                | 73        | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2         | CHF               | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 14        | €                 | 12        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 67        | INR               | 6 425     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 1 816     | KRW               | 2 752 489 | 0                  | (39)                  | (39)                                    | (0,18)              |
|              | 07/2026           |                 | 128       | NOK               | 1 184     | 0                  | (9)                   | (9)                                     | (0,04)              |
|              | 08/2026           |                 | 103       | EGP               | 5 629     | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,05                |
|              | 08/2026           |                 | 46        | NOK               | 455       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | EGP             | 24 217    | \$                | 471       | 0                  | (8)                   | (8)                                     | (0,04)              |
|              | 09/2026           | \$              | 127       | INR               | 12 163    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR             | 94        | \$                | 5         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | MYR             | 1 015     |                   | 252       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
| MYI          | 07/2026           |                 | 99        |                   | 24        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 3         | ILS               | 8         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK             | 605       | €                 | 25        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 756       | \$                | 23        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 23        | AZN               | 42        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
| NSL          | 10/2027           |                 | 46        |                   | 85        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 64        | INR               | 6 196     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 33        | IDR               | 582 930   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | €               | 44        | \$                | 51        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 2 000     |                   | 13        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 18 300    |                   | 12        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             | 32 459    |                   | 67        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 364       |                   | 91        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | TWD             | 2 793     |                   | 88        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 167       | CNY               | 1 143     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 313       | EGP               | 16 579    | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,10                |
|              | 07/2026           |                 | 183       | INR               | 17 488    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 38        | KZT               | 20 416    | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 342       | MYR               | 1 399     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 100       | PEN               | 352       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | ZMW             | 573       | \$                | 27        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | EGP             | 20 065    |                   | 397       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | KZT             | 566 212   |                   | 1 124     | 0                  | (38)                  | (38)                                    | (0,18)              |
|              | 08/2026           | NGN             | 2 279 331 |                   | 1 643     | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,15                |
|              | 08/2026           | \$              | 30        | INR               | 2 851     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 755       | NGN               | 1 064 983 | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | EGP             | 16 264    | \$                | 316       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 524 569   |                   | 29        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 3 443     |                   | 105       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1         | EGP               | 55        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 102       | IDR               | 1 828 046 | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 44        | INR               | 4 210     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 67        | KZT               | 33 260    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 211       | THB               | 6 889     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 10/2026           |                 | 18        | UGX               | 67 944    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | UGX             | 15 752    | \$                | 4         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | \$              | 287       | KES               | 38 254    | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 02/2027           | NGN             | 299 228   | \$                | 202       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
| SOG          | 05/2027           | \$              | 213       | NGN               | 325 274   | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CHF             | 2         | \$                | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 36        | RON               | 189       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 487       | \$                | 568       | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,06                |
|              | 07/2026           | ¥               | 927       |                   | 6         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 226       |                   | 67        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 970     |                   | 1 521     | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 20        | BRL               | 104       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 40        | CLP               | 36 017    | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 27        | CNH               | 184       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 652       | €                 | 573       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 27        | SGD               | 35        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 573       | \$                | 653       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 3         |                   | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2         | CHF               | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 17        | EGP               | 922       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           |                 | 1 521     | SGD               | 1 966     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | CLP             | 36 017    | \$                | 40        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | EGP             | 2 288     |                   | 41        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | \$              | 3         | THB               | 97        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           |                 | 183       | KES               | 24 458    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 12/2027           |                 | 0         | CNH               | 3         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2028           |                 | 7         |                   | 46        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2029           |                 | 19        |                   | 125       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 12/2030           |                 | 33        |                   | 214       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 12/2031           |                 | 39        |                   | 252       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 12/2032           |                 | 42        |                   | 265       | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,02                |
|              | 12/2033           |                 | 44        |                   | 273       | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,02                |
|              | 12/2034           |                 | 47        |                   | 283       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,02                |
|              | 12/2035           |                 | 50        |                   | 294       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,02                |
|              | 12/2036           |                 | 53        |                   | 306       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,03                |
|              | 12/2037           |                 | 56        |                   | 315       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,03                |
|              | 12/2038           |                 | 60        |                   | 325       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,03                |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SSB                                                | 12/2039           | \$              | 63                | CNH                | 335                   | \$ 7                                    | 0,03                |
|                                                    | 12/2040           |                 | 67                |                    | 348                   | 7                                       | 0,04                |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 5                 | \$                 | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 401               | £                  | 303                   | 2                                       | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 30                | KRW                | 45 233                | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | COP             | 1 128 965         | \$                 | 296                   | 0                                       | (0,14)              |
|                                                    | 08/2026           | £               | 303               |                    | 401                   | 0                                       | (0,01)              |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 20                | COP                | 79 092                | 2                                       | 0,01                |
| UAG                                                | 09/2026           |                 | 20                | MXN                | 355                   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 27                | PLN                | 97                    | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           |                 | 51                | CLP                | 45 614                | 0                                       | (0,01)              |
|                                                    | 10/2026           | HUF             | 619               | €                  | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 11/2026           |                 | 7 130             |                    | 20                    | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 12/2026           | COP             | 1 530 016         | \$                 | 392                   | 0                                       | (0,17)              |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 565             | \$ (476)              | \$ 89                                   | 0,43                |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 95                                   | 0,46                |

| DESCRIPTION                                                             | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                         |                               |                            |                     |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>9,350 % éch. 06/08/2022 ^    | RUB 33 000                    | \$ 13                      | 0,06                |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (g) | \$ 200                        | 12                         | 0,06                |
| Total des Autres actifs financiers                                      |                               | \$ 25                      | 0,12                |
| Total des Investissements                                               |                               | \$ 19 498                  | 94,57               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                  |                               | \$ 1 119                   | 5,43                |
| Actif net                                                               |                               | \$ 20 617                  | 100,00              |

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Titre à rémunération en nature.
- (b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025) : 0,12 % :

| Description de l'émetteur                    | Date d'achat | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------|--------------|-------|--------------|---------------------|
| DrillCo Holding Lux S.A.                     | 08/06/2023   | \$ 16 | \$ 18        | 0,09                |
| Flourish Century 6,600 % échéance 04/02/2049 | 03/02/2026   | 0     | 0            | 0,00                |
|                                              |              | \$ 16 | \$ 18        | 0,09                |

Un montant en numéraire de 241 \$ (31 décembre 2025 : 215 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1                                                                              | \$ 16 986                                            | \$ 1 029                                          | \$ 18 016    |
| Fonds d'investissement                        | 1 451                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 1 451        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 6                                                    | 0                                                 | 6            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 0                                                    | 25                                                | 25           |
| Totaux                                        | \$ 1 452                                                                          | \$ 16 992                                            | \$ 1 054                                          | \$ 19 498    |

## Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 12 075                                            | \$ 482                                            | \$ 12 557        |
| Fonds d'investissement                        | 1 333                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 1 333            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 12                                                   | 1                                                 | 13               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 0                                                    | 25                                                | 25               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 333</b>                                                                   | <b>\$ 12 087</b>                                     | <b>\$ 508</b>                                     | <b>\$ 13 928</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | \$ 4                                                       | \$ 0                    | \$ 4                              | \$ (16)                                                    | \$ 0                    | \$ (16)                           |
| BPS          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 20                                                         | 0                       | 20                                |
| BRC          | 8                                                          | 0                       | 8                                 | 28                                                         | 0                       | 28                                |
| BSH          | (33)                                                       | 0                       | (33)                              | (8)                                                        | 0                       | (8)                               |
| CBK          | 15                                                         | 0                       | 15                                | (49)                                                       | 0                       | (49)                              |
| DUB          | 136                                                        | 0                       | 136                               | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| FAR          | (18)                                                       | 0                       | (18)                              | 13                                                         | 0                       | 13                                |
| GLM          | 32                                                         | 0                       | 32                                | 13                                                         | 0                       | 13                                |
| GST          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| IND          | (4)                                                        | 0                       | (4)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (38)                                                       | 0                       | (38)                              | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| MBC          | (35)                                                       | 0                       | (35)                              | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| MYC          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| MYI          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | (2)                                                        | 0                       | (2)                               |
| NSL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 17                                                         | 0                       | 17                                |
| SCX          | 16                                                         | 0                       | 16                                | 7                                                          | 0                       | 7                                 |
| SOG          | 68                                                         | 0                       | 68                                | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| SSB          | (28)                                                       | 0                       | (28)                              | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| UAG          | (40)                                                       | 0                       | (40)                              | 4                                                          | 0                       | 4                                 |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 54,30            | 57,70                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 22,22            | 16,97                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 2,14             | 3,77                 |
| Fonds d'investissement                                           | 6,34             | 8,33                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,02             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 2,68             | 3,47                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 2,64             | 1,83                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,11             | 0,15                 |
| Autres actifs                                                    | 9,55             | 7,78                 |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Argentine                         | 0,39             | 0,17                 |
| Azerbaïdjan                       | S/O              | 2,06                 |
| Brésil                            | 1,12             | 1,54                 |
| Îles Caïmans                      | 0,01             | 0,01                 |
| Chili                             | 2,41             | 2,90                 |
| Chine                             | 2,58             | 0,06                 |
| Colombie                          | 5,55             | 4,83                 |
| République tchèque                | 0,13             | 0,19                 |
| Danemark                          | S/O              | 0,00                 |
| République dominicaine            | 2,91             | 3,90                 |
| Équateur                          | S/O              | 0,24                 |
| Égypte                            | 1,79             | 2,24                 |
| Allemagne                         | 0,90             | 1,40                 |
| Ghana                             | 0,15             | 0,10                 |
| Hongrie                           | S/O              | 0,20                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Indonésie                                                                                                | 0,36             | 0,04                 |
| Irlande                                                                                                  | 1,51             | 2,22                 |
| Kazakhstan                                                                                               | 2,21             | S/O                  |
| Kenya                                                                                                    | 0,65             | S/O                  |
| Koweït                                                                                                   | 0,96             | 1,37                 |
| Luxembourg                                                                                               | 1,32             | 0,26                 |
| Malaisie                                                                                                 | 7,54             | 9,96                 |
| Mexique                                                                                                  | 4,99             | 4,01                 |
| Paraguay                                                                                                 | 0,61             | 0,63                 |
| Pérou                                                                                                    | 2,17             | 3,10                 |
| Philippines                                                                                              | 0,03             | 4,48                 |
| Pologne                                                                                                  | 2,51             | 3,09                 |
| Qatar                                                                                                    | 0,96             | 1,34                 |
| Roumanie                                                                                                 | 0,02             | 0,02                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,35             | 0,51                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 6,71             | 5,69                 |
| Supranationales                                                                                          | 6,07             | 2,24                 |
| Thaïlande                                                                                                | S/O              | 0,24                 |
| Turquie                                                                                                  | 1,14             | 2,11                 |
| Ouganda                                                                                                  | S/O              | 0,22                 |
| Ukraine                                                                                                  | S/O              | 0,11                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,97             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                                                              | 1,21             | 1,72                 |
| États-Unis                                                                                               | 4,82             | 7,20                 |
| Uruguay                                                                                                  | 0,36             | S/O                  |
| Venezuela                                                                                                | 0,51             | 0,41                 |
| Zambie                                                                                                   | 0,13             | 0,19                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 21,34            | 14,88                |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 7,04             | 9,12                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,02             | (0,01)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | S/O              | (0,01)               |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,46)           | (0,13)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,11             | 0,23                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,03             | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,11)           | (0,12)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,02)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03             | 0,05                 |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | (0,01)           | (0,02)               |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,01             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,43             | 0,12                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,12             | 0,17                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 5,43             | 4,74                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>              |                                     |                                  |                           | <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                   |                                     |                                  |                           | <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                      |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| Alice France S.A.                      |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 09/10/2027                                     |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/12/2029                                   | \$ 800                              | \$ 763                           | 0,12                      |
| 7,798 % éch. 30/04/2028                | \$ 983                              | \$ 988                           | 0,15                      | (d)(e)                                                      | € 1 000                             | \$ 1 171                         | 0,18                      | 3,500 % éch. 15/09/2030                                   | 240                                 | 227                              | 0,03                      |
| 9,048 % éch. 14/05/2029                | 1 728                               | 1 736                            | 0,27                      | 6,208 % éch. 18/01/2029                                     | \$ 500                              | 512                              | 0,08                      | 5,700 % éch. 01/07/2034                                   | 350                                 | 358                              | 0,06                      |
| Spa Holdings Oy                        |                                     |                                  |                           | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF             |                                     |                                  |                           | Howard Hughes Corp.                                       |                                     |                                  |                           |
| 8,244 % éch. 23/05/2030                | 496                                 | 495                              | 0,08                      | 3,875 % éch. 28/05/2031                                     | € 4 000                             | 4 593                            | 0,71                      | 4,375 % éch. 01/02/2031                                   | 700                                 | 662                              | 0,10                      |
|                                        |                                     | 3 219                            | 0,50                      | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                                         |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | European Core Fund                                          |                                     |                                  |                           | 3,973 % éch. 22/05/2030                                   | 200                                 | 195                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 0,900 % éch. 12/10/2029                                     | 500                                 | 528                              | 0,08                      | 4,583 % éch. 19/06/2029                                   | 500                                 | 499                              | 0,08                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Citigroup, Inc.                                             |                                     |                                  |                           | 6,254 % éch. 09/03/2034                                   | 600                                 | 636                              | 0,10                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,976 % éch. 05/11/2030                                     | \$ 200                              | 189                              | 0,03                      | Hudson Pacific Properties LP                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | CNP Assurances S.A.                                         |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 01/11/2027                                   | 250                                 | 244                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 27/01/2029                                     | € 400                               | 435                              | 0,07                      | 5,950 % éch. 15/02/2028                                   | 150                                 | 149                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Commerzbank AG                                              |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 14/01/2032                                     | 900                                 | 1 035                            | 0,16                      | 4,125 % éch. 24/08/2033                                   | € 300                               | 347                              | 0,05                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | COPT Defense Properties LP                                  |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 15/01/2029                                     | \$ 100                              | 94                               | 0,01                      | 16/05/2031 (d)(e)                                         | \$ 200                              | 182                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | CoStar Group, Inc.                                          |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,800 % éch. 15/07/2030                                     | 900                                 | 810                              | 0,12                      | 16/05/2029 (d)(e)                                         | 700                                 | 678                              | 0,10                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | CPI Property Group S.A.                                     |                                     |                                  |                           | 5,525 % éch. 25/03/2036                                   | 500                                 | 508                              | 0,08                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 14/01/2030                                     | € 300                               | 301                              | 0,05                      | Intesa Sanpaolo SpA                                       |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/01/2028                                     | £ 300                               | 388                              | 0,06                      | 4,198 % éch. 01/06/2026                                   | 200                                 | 189                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 05/02/2033                                     | 1 300                               | 1 611                            | 0,25                      | 6,625 % éch. 31/05/2033                                   | £ 600                               | 857                              | 0,13                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole Assurances S.A.                             |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 20/06/2033                                   | \$ 1 000                            | 1 084                            | 0,17                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 06/10/2031                                     | € 200                               | 206                              | 0,03                      | JAB Holdings BV                                           |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole S.A.                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 12/06/2033                                   | € 200                               | 245                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 23/03/2035                                     | 1 100                               | 1 293                            | 0,20                      | Jones Lang LaSalle, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | (d)(e)                                                      |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/12/2028                                   | \$ 1 300                            | 1 362                            | 0,21                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Crown Castle, Inc.                                          |                                     |                                  |                           | KBC Group NV                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,100 % éch. 15/11/2029                                     | \$ 550                              | 522                              | 0,08                      | 5,796 % éch. 19/01/2029                                   | 1 250                               | 1 272                            | 0,20                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | CTP NV                                                      |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 21/06/2029                                     | € 400                               | 432                              | 0,07                      | 17/09/2031 (d)(e)                                         | € 1 000                             | 1 204                            | 0,19                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 27/09/2031                                     | 400                                 | 409                              | 0,06                      | 8,000 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Deutsche Bank AG                                            |                                     |                                  |                           | 05/09/2028 (d)(e)                                         | 200                                 | 247                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,035 % éch. 28/05/2032                                     | \$ 350                              | 319                              | 0,05                      | Kilroy Realty LP                                          |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,742 % éch. 07/01/2033                                     | 500                                 | 459                              | 0,07                      | 2,500 % éch. 15/11/2032                                   | \$ 640                              | 531                              | 0,08                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,720 % éch. 18/01/2029                                     | 500                                 | 515                              | 0,08                      | 2,650 % éch. 15/11/2033                                   | 200                                 | 163                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,079 % éch. 10/02/2034                                     | 500                                 | 540                              | 0,08                      | Kookmin Bank                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Digital Dutch Finco BV                                      |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/01/2032                                     | € 500                               | 496                              | 0,08                      | 04/11/2030 (e)                                            | 200                                 | 181                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | EQT AB                                                      |                                     |                                  |                           | Lendlease Finance Ltd.                                    |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 0,875 % éch. 14/05/2031                                     | 600                                 | 603                              | 0,09                      | 3,400 % éch. 27/10/2027                                   | AUD 1 100                           | 740                              | 0,11                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 06/04/2028                                     | 700                                 | 790                              | 0,12                      | Logicor Financing SARL                                    |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Equinix, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 17/01/2034                                   | € 500                               | 496                              | 0,08                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 15/05/2031                                     | \$ 50                               | 45                               | 0,01                      | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                      |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 15/04/2032                                     | 260                                 | 246                              | 0,04                      | 2,494 % éch. 13/10/2032                                   | \$ 700                              | 620                              | 0,10                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Equitable Financial Life Global Funding                     |                                     |                                  |                           | 5,475 % éch. 22/02/2031                                   | 800                                 | 817                              | 0,13                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 1,800 % éch. 08/03/2028                                     | 700                                 | 667                              | 0,10                      | Mizuho Financial Group, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Erste Group Bank AG                                         |                                     |                                  |                           | 2,201 % éch. 10/07/2031                                   | 800                                 | 722                              | 0,11                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/04/2031                                     | € 1 000                             | 1 243                            | 0,19                      | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | (d)(e)                                                      |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 23/05/2042                                   | 400                                 | 411                              | 0,06                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Everglades Re Ltd.                                          |                                     |                                  |                           | NE Property BV                                            |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 9,289 % éch. 22/05/2033                                     | \$ 250                              | 250                              | 0,04                      | 2,000 % éch. 20/01/2030                                   | € 200                               | 216                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                                   |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 14/07/2027                                   | 100                                 | 114                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 4,789 % éch. 03/06/2031                                     | 1 000                               | 1 001                            | 0,15                      | NN Group NV                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | First American Financial Corp.                              |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 15/08/2031                                     | 600                                 | 523                              | 0,08                      | 11/09/2034 (d)(e)                                         | 400                                 | 467                              | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC                                   |                                     |                                  |                           | Nomura Holdings, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,918 % éch. 20/03/2028                                     | 1 300                               | 1 316                            | 0,20                      | 2,172 % éch. 14/07/2028                                   | \$ 600                              | 570                              | 0,09                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,050 % éch. 05/03/2031                                     | 500                                 | 508                              | 0,08                      | Norinchukin Bank                                          |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | FS KKR Capital Corp.                                        |                                     |                                  |                           | 5,094 % éch. 16/10/2029                                   | 1 700                               | 1 712                            | 0,26                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 12/10/2028                                     | 450                                 | 424                              | 0,07                      | OneMain Finance Corp.                                     |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Globalworth Real Estate Investments Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/01/2027                                   | 826                                 | 819                              | 0,13                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/03/2030                                     | € 179                               | 209                              | 0,03                      | 7,125 % éch. 15/11/2031                                   | 1 630                               | 1 664                            | 0,26                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | PennyMac Financial Services, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,383 % éch. 21/07/2032                                     | \$ 800                              | 707                              | 0,11                      | 5,750 % éch. 15/09/2031                                   | 700                                 | 664                              | 0,10                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                         |                                     |                                  |                           | PPI Public Property Invest AB                             |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 29/04/2033                                     | € 1 900                             | 2 175                            | 0,34                      | 4,125 % éch. 21/04/2033                                   | € 900                               | 1 016                            | 0,16                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Goodman U.S. Finance Five LLC                               |                                     |                                  |                           | Prologis LP                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 04/05/2032                                     | \$ 700                              | 682                              | 0,11                      | 4,200 % éch. 15/02/2033                                   | CAD 1 900                           | 1 350                            | 0,21                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | GPT Wholesale Office Fund                                   |                                     |                                  |                           | Protective Life Global Funding                            |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,222 % éch. 05/11/2031                                     | AUD 400                             | 247                              | 0,04                      | 1,737 % éch. 21/09/2030                                   | \$ 800                              | 706                              | 0,11                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Grainger PLC                                                |                                     |                                  |                           | Rayonier LP                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 03/07/2030                                     | £ 100                               | 122                              | 0,02                      | 2,750 % éch. 17/05/2031                                   | 600                                 | 539                              | 0,08                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Hanwha Life Insurance Co. Ltd.                              |                                     |                                  |                           | Recoletos RE DAC                                          |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,379 % éch. 04/02/2032                                     | \$ 300                              | 297                              | 0,05                      | 5,289 % éch. 06/07/2032                                   | 250                                 | 250                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | HAT Holdings LLC                                            |                                     |                                  |                           | Reinsurance Group of America, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/09/2030                                     | 230                                 | 215                              | 0,03                      | 6,000 % éch. 15/09/2033                                   | 200                                 | 209                              | 0,03                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Host Hotels & Resorts LP                                    |                                     |                                  |                           | Rexford Industrial Realty LP                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 15/12/2031                                     | 100                                 | 90                               | 0,01                      | 2,150 % éch. 01/09/2031                                   | 100                                 | 87                               | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | Sagax AB                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 26/01/2031                                   | € 1 000                             | 1 127                            | 0,17                      |

| DESCRIPTION                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------|-------------------------------------|----|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|----|----------------------------------|---------------------------|
| Santander UK Group Holdings PLC  |                                     |    |                                  |                           | Fair Isaac Corp.                        |                                     |    |                                  |                           | United Rentals North America, Inc.        |                                     |    |                                  |                           |
| 3,823 % éch. 03/11/2028          | \$ 200                              | \$ | 198                              | 0,03                      | 4,000 % éch. 15/06/2028                 | \$ 610                              | \$ | 597                              | 0,09                      | 3,875 % éch. 15/02/2031                   | \$ 500                              | \$ | 473                              | 0,07                      |
| 5,694 % éch. 15/04/2031          | 620                                 |    | 636                              | 0,10                      | Flex Ltd.                               |                                     |    |                                  |                           | VeriSign, Inc.                            |                                     |    |                                  |                           |
| 6,534 % éch. 10/01/2029          | 400                                 |    | 411                              | 0,06                      | 6,000 % éch. 15/01/2028                 | 300                                 |    | 305                              | 0,05                      | 2,700 % éch. 15/06/2031                   | 650                                 |    | 584                              | 0,09                      |
| Segro Capital SARL               |                                     |    |                                  |                           | Ford Motor Co.                          |                                     |    |                                  |                           | Vilmorin & Cie S.A.                       |                                     |    |                                  |                           |
| 1,875 % éch. 23/03/2030          | € 250                               |    | 272                              | 0,04                      | 3,250 % éch. 12/02/2032                 | 80                                  |    | 71                               | 0,01                      | 1,375 % éch. 26/03/2028                   | € 300                               |    | 330                              | 0,05                      |
| Sirius Real Estate Ltd.          |                                     |    |                                  |                           | Gap, Inc.                               |                                     |    |                                  |                           | Vmed O2 UK Financing PLC                  |                                     |    |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 24/11/2028          | 200                                 |    | 221                              | 0,03                      | 3,625 % éch. 01/10/2029                 | 200                                 |    | 189                              | 0,03                      | 4,500 % éch. 15/07/2031                   | £ 200                               |    | 219                              | 0,03                      |
| Sofina S.A.                      |                                     |    |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/10/2031                 | 2 500                               |    | 2 279                            | 0,35                      | 4,750 % éch. 15/07/2031                   | \$ 2 470                            |    | 2 032                            | 0,31                      |
| 1,000 % éch. 23/09/2028          | 200                                 |    | 217                              | 0,03                      | Graphic Packaging International LLC     |                                     |    |                                  |                           | VZ Secured Financing BV                   |                                     |    |                                  |                           |
| Standard Chartered PLC           |                                     |    |                                  |                           | 2,625 % éch. 01/02/2029                 | € 400                               |    | 445                              | 0,07                      | 7,500 % éch. 15/01/2033                   | 1 380                               |    | 1 322                            | 0,20                      |
| 2,678 % éch. 29/06/2032          | \$ 500                              |    | 449                              | 0,07                      | HCA, Inc.                               |                                     |    |                                  |                           | Wabtec Transportation Netherlands BV      |                                     |    |                                  |                           |
| 3,603 % éch. 12/01/2033          | 200                                 |    | 183                              | 0,03                      | 4,500 % éch. 15/02/2027                 | \$ 500                              |    | 500                              | 0,08                      | 1,250 % éch. 03/12/2027                   | € 400                               |    | 446                              | 0,07                      |
| 6,301 % éch. 09/01/2029          | 700                                 |    | 716                              | 0,11                      | Hilton Domestic Operating Co., Inc.     |                                     |    |                                  |                           | Weir Group, Inc.                          |                                     |    |                                  |                           |
| Starwood Property Trust, Inc.    |                                     |    |                                  |                           | 3,625 % éch. 15/02/2032                 | 380                                 |    | 348                              | 0,05                      | 5,350 % éch. 06/05/2030                   | \$ 1 000                            |    | 1 009                            | 0,16                      |
| 6,125 % éch. 01/06/2031          | 1 700                               |    | 1 710                            | 0,26                      | 4,000 % éch. 01/05/2031                 | 200                                 |    | 189                              | 0,03                      | XPLR Infrastructure Operating Partners LP |                                     |    |                                  |                           |
| Sutter Re Ltd.                   |                                     |    |                                  |                           | InterContinental Hotels Group PLC       |                                     |    |                                  |                           | 7,250 % éch. 15/01/2029 (g)               | 1 000                               |    | 1 035                            | 0,16                      |
| 7,289 % éch. 07/06/2034          | 250                                 |    | 250                              | 0,04                      | 3,375 % éch. 08/10/2028                 | £ 500                               |    | 641                              | 0,10                      | Yorkshire Water Finance PLC               |                                     |    |                                  |                           |
| Torrey Pines Re Ltd.             |                                     |    |                                  |                           | International Distribution Services PLC |                                     |    |                                  |                           | 6,000 % éch. 22/07/2033                   | £ 500                               |    | 666                              | 0,10                      |
| 6,789 % éch. 07/06/2034          | 250                                 |    | 252                              | 0,04                      | 7,375 % éch. 14/09/2030                 | 600                                 |    | 841                              | 0,13                      | 6,625 % éch. 22/07/2040                   | 700                                 |    | 923                              | 0,14                      |
| UBS Group AG                     |                                     |    |                                  |                           | JDE Peet's NV                           |                                     |    |                                  |                           | ZF Europe Finance BV                      |                                     |    |                                  |                           |
| 4,375 % éch.                     |                                     |    |                                  |                           | 2,250 % éch. 24/09/2031                 | \$ 600                              |    | 520                              | 0,08                      | 4,750 % éch. 31/01/2029                   | € 400                               |    | 460                              | 0,07                      |
| 10/02/2031 (d)(e)                | 200                                 |    | 184                              | 0,03                      | 4,125 % éch. 23/01/2030                 | € 800                               |    | 933                              | 0,14                      | ZF North America Capital, Inc.            |                                     |    |                                  |                           |
| 5,959 % éch. 12/01/2034          | 400                                 |    | 417                              | 0,06                      | Lenovo Group Ltd.                       |                                     |    |                                  |                           | 6,875 % éch. 14/04/2028                   | \$ 150                              |    | 154                              | 0,02                      |
| 9,250 % éch.                     |                                     |    |                                  |                           | 3,421 % éch. 02/11/2030                 | \$ 400                              |    | 378                              | 0,06                      |                                           |                                     |    | 71 547                           | 11,03                     |
| 13/11/2028 (d)(e)                | 1 000                               |    | 1 077                            | 0,17                      | Liberty Utilities Finance GP            |                                     |    |                                  |                           |                                           |                                     |    |                                  |                           |
| UniCredit SpA                    |                                     |    |                                  |                           | 2,050 % éch. 15/09/2030                 | 300                                 |    | 269                              | 0,04                      | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS                |                                     |    |                                  |                           |
| 5,459 % éch. 30/06/2035          | 300                                 |    | 302                              | 0,05                      | Metalsa S.A. de C.V.                    |                                     |    |                                  |                           | AES Andes S.A.                            |                                     |    |                                  |                           |
| VIA Outlets BV                   |                                     |    |                                  |                           | 3,750 % éch. 04/05/2031                 | 550                                 |    | 492                              | 0,08                      | 6,300 % éch. 15/03/2029                   | 380                                 |    | 389                              | 0,06                      |
| 1,750 % éch. 15/11/2028          | € 231                               |    | 255                              | 0,04                      | MSCI, Inc.                              |                                     |    |                                  |                           | AES Corp.                                 |                                     |    |                                  |                           |
| Volkswagen Bank GmbH             |                                     |    |                                  |                           | 3,625 % éch. 01/09/2030                 | 400                                 |    | 379                              | 0,06                      | 2,450 % éch. 15/01/2031                   | 300                                 |    | 268                              | 0,04                      |
| 4,000 % éch. 26/11/2030          | 2 000                               |    | 2 307                            | 0,36                      | NetApp, Inc.                            |                                     |    |                                  |                           | 5,450 % éch. 01/06/2028                   | 700                                 |    | 708                              | 0,11                      |
| Workspace Group PLC              |                                     |    |                                  |                           | 5,500 % éch. 17/03/2032                 | 600                                 |    | 614                              | 0,09                      | 7,600 % éch. 15/01/2055                   | 545                                 |    | 560                              | 0,09                      |
| 2,250 % éch. 11/03/2028          | £ 500                               |    | 632                              | 0,10                      | 5,700 % éch. 17/03/2035                 | 600                                 |    | 614                              | 0,09                      | Anglian Water Services Financing PLC      |                                     |    |                                  |                           |
| Yardstick RE DAC                 |                                     |    |                                  |                           | Nissan Motor Co. Ltd.                   |                                     |    |                                  |                           | 4,250 % éch. 23/06/2036                   | € 1 700                             |    | 1 946                            | 0,30                      |
| 4,274 % éch. 08/07/2034          | € 250                               |    | 286                              | 0,04                      | 4,345 % éch. 17/09/2027                 | 550                                 |    | 541                              | 0,08                      | CenterPoint Energy Houston Electric LLC   |                                     |    |                                  |                           |
| ZF Finance GmbH                  |                                     |    |                                  |                           | 5,250 % éch. 17/07/2029                 | € 900                               |    | 1 046                            | 0,16                      | 5,300 % éch. 01/04/2053                   | \$ 800                              |    | 761                              | 0,12                      |
| 2,250 % éch. 03/05/2028          | 100                                 |    | 111                              | 0,02                      | NXP BV                                  |                                     |    |                                  |                           | Chile Electricity Lux MPC SARL            |                                     |    |                                  |                           |
|                                  |                                     |    | 95 435                           | 14,71                     | 2,500 % éch. 11/05/2031                 | \$ 250                              |    | 224                              | 0,03                      | 5,580 % éch. 20/10/2035                   | 782                                 |    | 795                              | 0,12                      |
|                                  |                                     |    |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/01/2033                 | 1 000                               |    | 997                              | 0,15                      | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. |                                     |    |                                  |                           |
| INDUSTRIE                        |                                     |    |                                  |                           | Pearson Funding PLC                     |                                     |    |                                  |                           | 4,250 % éch. 25/03/2027                   | 147                                 |    | 145                              | 0,02                      |
| 180 Medical, Inc.                |                                     |    |                                  |                           | 3,750 % éch. 04/06/2030                 | £ 100                               |    | 127                              | 0,02                      | Cleanway Energy Operating LLC             |                                     |    |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/10/2029          | \$ 900                              |    | 863                              | 0,13                      | Pinnacle Bidco PLC                      |                                     |    |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/01/2034                   | 1 100                               |    | 1 079                            | 0,17                      |
| Accor S.A.                       |                                     |    |                                  |                           | 8,250 % éch. 11/10/2028                 | € 250                               |    | 296                              | 0,05                      | Dhafrah Pv2 Energy Co. LLC                |                                     |    |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 29/11/2028          | € 900                               |    | 1 016                            | 0,16                      | PLS Group Ltd.                          |                                     |    |                                  |                           | 5,794 % éch. 30/06/2053                   | 1 000                               |    | 991                              | 0,15                      |
| ADT Security Corp.               |                                     |    |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/05/2031                 | \$ 2 600                            |    | 2 664                            | 0,41                      | Edison International                      |                                     |    |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/10/2033          | \$ 2 480                            |    | 2 438                            | 0,38                      | Rakuten Group, Inc.                     |                                     |    |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/03/2030                   | 1 200                               |    | 1 233                            | 0,19                      |
| Albertsons Cos., Inc.            |                                     |    |                                  |                           | 9,750 % éch. 15/04/2029                 | 2 440                               |    | 2 653                            | 0,41                      | 7,875 % éch. 15/06/2054                   | 700                                 |    | 720                              | 0,11                      |
| 5,750 % éch. 31/03/2034          | 970                                 |    | 925                              | 0,14                      | RD Michigan Property Owner LLC          |                                     |    |                                  |                           | Électricité de France S.A.                |                                     |    |                                  |                           |
| Amgen, Inc.                      |                                     |    |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                 | 10 013                              |    | 9 985                            | 1,54                      | 4,625 % éch. 07/05/2045                   | € 1 000                             |    | 1 141                            | 0,18                      |
| 5,600 % éch. 02/03/2043          | 900                                 |    | 895                              | 0,14                      | RELX Capital, Inc.                      |                                     |    |                                  |                           | ENEL Finance International NV             |                                     |    |                                  |                           |
| Arcadis NV                       |                                     |    |                                  |                           | 4,750 % éch. 20/05/2032                 | 800                                 |    | 795                              | 0,12                      | 1,625 % éch. 12/07/2026                   | \$ 300                              |    | 300                              | 0,05                      |
| 4,000 % éch. 20/05/2031          | € 1 000                             |    | 1 149                            | 0,18                      | ReNew Pvt Ltd.                          |                                     |    |                                  |                           | 2,500 % éch. 12/07/2031                   | 400                                 |    | 356                              | 0,05                      |
| 4,875 % éch. 28/02/2028          | 200                                 |    | 233                              | 0,04                      | 5,875 % éch. 05/03/2027                 | 200                                 |    | 200                              | 0,03                      | EPH Financing International A/S           |                                     |    |                                  |                           |
| B.C. Unlimited Liability Co.     |                                     |    |                                  |                           | S&P Global, Inc.                        |                                     |    |                                  |                           | 4,625 % éch. 02/07/2032                   | € 1 300                             |    | 1 517                            | 0,23                      |
| 3,875 % éch. 15/01/2028          | \$ 500                              |    | 491                              | 0,08                      | 2,950 % éch. 01/03/2029                 | 700                                 |    | 672                              | 0,10                      | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.      |                                     |    |                                  |                           |
| Bali Corp.                       |                                     |    |                                  |                           | Sartorius Finance BV                    |                                     |    |                                  |                           | 7,250 % éch. 27/09/2028                   | \$ 1 182                            |    | 1 192                            | 0,18                      |
| 3,125 % éch. 15/09/2031          | 580                                 |    | 525                              | 0,08                      | 4,875 % éch. 14/09/2035                 | € 400                               |    | 487                              | 0,08                      | Iberdrola International BV                |                                     |    |                                  |                           |
| BCP Modular Services Finance PLC |                                     |    |                                  |                           | Schaeffler AG                           |                                     |    |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/09/2033                   | 250                                 |    | 273                              | 0,04                      |
| 4,750 % éch. 30/11/2028          | € 100                               |    | 109                              | 0,02                      | 3,375 % éch. 12/10/2028                 | 200                                 |    | 228                              | 0,04                      | India Green Power Holdings                |                                     |    |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 10/07/2031          | 700                                 |    | 696                              | 0,11                      | 4,500 % éch. 28/03/2030                 | 700                                 |    | 813                              | 0,13                      | 4,000 % éch. 22/02/2027                   | 200                                 |    | 198                              | 0,03                      |
| Beignet Investor LLC             |                                     |    |                                  |                           | SK Hynix, Inc.                          |                                     |    |                                  |                           | National Grid PLC                         |                                     |    |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049          | \$ 10 480                           |    | 10 696                           | 1,65                      | 6,375 % éch. 17/01/2028                 | \$ 600                              |    | 616                              | 0,10                      | 0,250 % éch. 01/09/2028                   | € 400                               |    | 432                              | 0,07                      |
| Boise Cascade Co.                |                                     |    |                                  |                           | Sociedad Transmisora Metropolitana SpA  |                                     |    |                                  |                           | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.     |                                     |    |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 01/07/2030          | 380                                 |    | 375                              | 0,06                      | 6,385 % éch. 15/12/2055                 | 1 200                               |    | 1 226                            | 0,19                      | 1,900 % éch. 15/06/2028                   | \$ 400                              |    | 381                              | 0,06                      |
| Builders FirstSource, Inc.       |                                     |    |                                  |                           | St Marys Cement, Inc. Canada            |                                     |    |                                  |                           | 2,200 % éch. 02/12/2026                   | AUD 400                             |    | 274                              | 0,04                      |
| 4,250 % éch. 01/02/2032          | 500                                 |    | 466                              | 0,07                      | 5,750 % éch. 02/04/2034 (g)             | 400                                 |    | 411                              | 0,06                      | Nova Securitisation SARL                  |                                     |    |                                  |                           |
| CDW LLC                          |                                     |    |                                  |                           | Stellantis NV                           |                                     |    |                                  |                           | 5,750 % éch. 03/02/2031                   | \$ 1 600                            |    | 1 544                            | 0,24                      |
| 3,569 % éch. 01/12/2031          | 500                                 |    | 459                              | 0,07                      | 6,875 % éch. 16/12/2033 (d)             | € 675                               |    | 754                              | 0,12                      | Pacific Gas & Electric Co.                |                                     |    |                                  |                           |
| Cellnex Finance Co. S.A.         |                                     |    |                                  |                           | TopBuild Corp.                          |                                     |    |                                  |                           | 6,700 % éch. 01/04/2053                   | 1 300                               |    | 1 353                            | 0,21                      |
| 3,875 % éch. 07/07/2041          | 200                                 |    | 157                              | 0,02                      | 3,625 % éch. 15/03/2029                 | \$ 500                              |    | 500                              | 0,08                      | Pattern Energy Operations LP              |                                     |    |                                  |                           |
| Centene Corp.                    |                                     |    |                                  |                           | Transurban Finance Co. Pty. Ltd.        |                                     |    |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/08/2028                   | 500                                 |    | 490                              | 0,08                      |
| 2,625 % éch. 01/08/2031          | 800                                 |    | 698                              | 0,11                      | 2,450 % éch. 16/03/2031                 | 500                                 |    | 451                              | 0,07                      | PR RNO Property Owner LLC                 |                                     |    |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/10/2030          | 600                                 |    | 543                              | 0,08                      | Twilio, Inc.                            |                                     |    |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/05/2031                   | 700                                 |    | 699                              | 0,11                      |
| Chobani LLC                      |                                     |    |                                  |                           | 3,625 % éch. 15/03/2029                 | 500                                 |    | 482                              | 0,07                      |                                           |                                     |    |                                  |                           |
| 7,625 % éch. 01/07/2029          | 700                                 |    | 723                              | 0,11                      |                                         |                                     |    |                                  |                           |                                           |                                     |    |                                  |                           |
| Coty, Inc.                       |                                     |    |                                  |                           |                                         |                                     |    |                                  |                           |                                           |                                     |    |                                  |                           |
| 5,600 % éch. 15/01/2031          | 1 710                               |    | 1 665                            | 0,26                      |                                         |                                     |    |                                  |                           |                                           |                                     |    |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| Severn Trent Utilities Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                | \$ 370                              | \$ 361                           | 0,06                      | 5,840 % éch. 25/05/2031                               | \$ 47                                                | \$ 32                            | 0,01                      |      |
| 2,750 % éch. 05/12/2031                                        | £ 1 100                             | \$ 1 293                         | 0,20                      | 4,500 % éch. 15/04/2027                                                                | 4 700                               | 4 717                            | 0,73                      | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                                      |                                  |                           |      |
| 3,875 % éch. 04/08/2035                                        | € 900                               | 1 025                            | 0,16                      |                                                                                        |                                     | 63 330                           | 9,76                      | 4,763 % éch. 25/10/2034                               | 516                                                  | 537                              | 0,08                      |      |
| Southern California Edison Co.                                 |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |                                                       | 9 634                                                | 1,49                             |                           |      |
| 2,500 % éch. 01/06/2031                                        | \$ 400                              | 357                              | 0,06                      | 1211 Avenue of the Americas Trust                                                      | 1 895                               | 1 811                            | 0,28                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES             |                                                      |                                  |                           |      |
| 3,650 % éch. 01/06/2051                                        | 200                                 | 138                              | 0,02                      | 245 Park Avenue Trust                                                                  |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                   |                                                      |                                  |                           |      |
| Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 3,779 % éch. 05/06/2037                                                                | 1 250                               | 1 230                            | 0,19                      | 4,071 % éch. 25/01/2037                               | 3 671                                                | 1 770                            | 0,27                      |      |
| 6,750 % éch. 24/04/2033                                        | 241                                 | 244                              | 0,04                      | 280 Park Avenue Mortgage Trust                                                         |                                     |                                  |                           | AUTRES TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                     |                                                      |                                  |                           |      |
| TDC Net A/S                                                    |                                     |                                  |                           | 4,992 % éch. 15/09/2034                                                                | 2 297                               | 2 291                            | 0,35                      | Arbour CLO DAC                                        |                                                      |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 09/08/2032                                        | € 1 200                             | 1 424                            | 0,22                      | Banc of America Funding Trust                                                          | 46                                  | 42                               | 0,01                      | 3,433 % éch. 15/11/2037                               | € 2 900                                              | 3 320                            | 0,51                      |      |
| 5,056 % éch. 31/05/2028                                        | 300                                 | 354                              | 0,05                      | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust                                          | 9 045                               | 1                                | 0,00                      | 3,883 % éch. 15/08/2038                               | 1 800                                                | 2 061                            | 0,32                      |      |
| 5,618 % éch. 06/02/2030                                        | 2 700                               | 3 266                            | 0,50                      | 0,749 % éch. 10/08/2033 (a)                                                            | 105                                 | 95                               | 0,01                      | Ares European CLO DAC                                 |                                                      |                                  |                           |      |
| TerraForm Power Operating LLC                                  |                                     |                                  |                           | 4,216 % éch. 10/08/2033                                                                | 1 600                               | 1 541                            | 0,24                      | 3,512 % éch. 15/07/2037                               | 3 300                                                | 3 773                            | 0,58                      |      |
| 5,000 % éch. 31/01/2028                                        | \$ 230                              | 229                              | 0,04                      | 4,498 % éch. 10/08/2035                                                                | 2 190                               | 1 863                            | 0,29                      | 3,840 % éch. 17/04/2032                               | 1 200                                                | 1 376                            | 0,21                      |      |
| United Utilities Water Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 4,715 % éch. 10/08/2033                                                                | 2 190                               | 1 863                            | 0,29                      | Bauhinia Ltd.                                         |                                                      |                                  |                           |      |
| 3,750 % éch. 23/05/2034                                        | € 700                               | 800                              | 0,12                      | 5,122 % éch. 10/08/2035                                                                | 550                                 | 516                              | 0,08                      | 4,919 % éch. 19/10/2045                               | \$ 2 472                                             | 2 468                            | 0,38                      |      |
| Verizon Communications, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | Bear Stearns ALT-A Trust                                                               |                                     | 617                              | 572                       | 0,09                                                  | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.             |                                  |                           |      |
| 2,850 % éch. 03/09/2041                                        | \$ 300                              | 214                              | 0,03                      | 4,083 % éch. 25/06/2046                                                                |                                     |                                  |                           | 4,941 % éch. 11/04/2045                               | 1 753                                                | 1 750                            | 0,27                      |      |
| 5,050 % éch. 09/05/2033                                        | 1 500                               | 1 511                            | 0,23                      | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                                  | 1 049                               | 898                              | 0,14                      | 5,026 % éch. 11/04/2043                               | 2 194                                                | 2 194                            | 0,34                      |      |
| Vodafone Group PLC                                             |                                     |                                  |                           | EMF-UK PLC                                                                             |                                     |                                  |                           | Blackrock DLF CLO LLC                                 |                                                      |                                  |                           |      |
| 5,125 % éch. 04/06/2081                                        | 113                                 | 88                               | 0,01                      | 4,846 % éch. 13/03/2046                                                                | £ 1 421                             | 1 890                            | 0,29                      | 5,253 % éch. 25/07/2034                               | 1 000                                                | 1 000                            | 0,15                      |      |
|                                                                |                                     | 30 688                           | 4,73                      | Great Hall Mortgages PLC                                                               |                                     |                                  |                           | Capital Four CLO DAC                                  |                                                      |                                  |                           |      |
| Total des Obligations et billets privés                        |                                     | 197 670                          | 30,47                     | 4,126 % éch. 18/06/2038                                                                | 537                                 | 711                              | 0,11                      | 3,415 % éch. 25/10/2038                               | € 4 500                                              | 5 151                            | 0,79                      |      |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                              |                                     |                                  |                           | MortgageIT Trust                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,854 % éch. 15/04/2038                               | 2 900                                                | 3 320                            | 0,51                      |      |
| Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/08/2035                                                                | \$ 169                              | 170                              | 0,03                      | Crosthwaite Park CLO DAC                              |                                                      |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 01/08/2059                                        | 2 351                               | 2 117                            | 0,33                      | Residential Accredit Loans, Inc. Trust                                                 | 53                                  | 48                               | 0,01                      | 4,001 % éch. 15/03/2034                               | 1 000                                                | 1 145                            | 0,18                      |      |
| 4,000 % éch. 01/11/2059                                        | 99                                  | 92                               | 0,02                      | 4,143 % éch. 25/12/2036                                                                |                                     |                                  |                           | CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC                |                                                      |                                  |                           |      |
| Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust                                    | 34                                  | 30                               | 0,00                      | 3,823 % éch. 15/08/2033                               | 2 300                                                | 2 635                            | 0,41                      |      |
| 5,500 % éch. 20/07/2053 -<br>20/08/2053                        | 3 025                               | 3 062                            | 0,47                      | 5,351 % éch. 25/04/2037                                                                |                                     |                                  |                           | Fair Oaks Loan Funding DAC                            |                                                      |                                  |                           |      |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                                         | 16                                  | 17                               | 0,00                      | 3,854 % éch. 15/04/2034                               | 1 800                                                | 2 063                            | 0,32                      |      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056                                        | 2 500                               | 2 465                            | 0,38                      | Trinity Square PLC                                                                     |                                     |                                  |                           | Iskandar Enterprise LLC                               |                                                      |                                  |                           |      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | 5,047 % éch. 15/07/2059                                                                | £ 1 900                             | 2 525                            | 0,39                      | 5,049 % éch. 17/04/2056                               | \$ 900                                               | 896                              | 0,14                      |      |
| 3,000 % éch. 01/07/2052                                        | 399                                 | 349                              | 0,05                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                          |                                     | 62                               | 0,01                      | Margay CLO DAC                                        |                                                      |                                  |                           |      |
| 4,000 % éch. 01/05/2053 -<br>01/05/2054                        | 21 339                              | 20 003                           | 3,08                      | 3,966 % éch. 25/11/2036                                                                | \$ 68                               |                                  |                           | 3,439 % éch. 15/07/2037                               | € 2 300                                              | 2 632                            | 0,40                      |      |
| 4,500 % éch. 01/07/2052 -<br>01/05/2054                        | 12 545                              | 12 072                           | 1,86                      | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                                                  |                                     | 2 800                            | 0,42                      | Mosaic Solar Loans LLC                                |                                                      |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 01/08/2053 -<br>01/04/2054                        | 27 047                              | 26 721                           | 4,12                      | 5,761 % éch. 15/09/2040                                                                |                                     |                                  |                           | 4,450 % éch. 20/06/2042                               | \$ 254                                               | 249                              | 0,04                      |      |
| 5,500 % éch. 01/06/2053 -<br>01/12/2053                        | 25 132                              | 25 376                           | 3,91                      | Worldwide Plaza Trust                                                                  |                                     | 1 795                            | 113                       | 0,02                                                  | MV Credit Euro CLO DAC                               |                                  |                           |      |
| 6,000 % éch. 01/01/2055                                        | 3 635                               | 3 721                            | 0,57                      | 3,715 % éch. 10/11/2036                                                                |                                     |                                  | 19 190                    | 2,96                                                  | 3,583 % éch. 15/02/2038                              | € 4 400                          | 5 034                     | 0,78 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | North Westerly ESG CLO DAC                            |                                                      |                                  |                           |      |
| 2,000 % éch. 01/08/2056                                        | 500                                 | 399                              | 0,06                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                                    |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 15/05/2034                               | 625                                                  | 677                              | 0,10                      |      |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 8 200                               | 7 147                            | 1,10                      | Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates             |                                     |                                  |                           | OCF Euro CLO DAC                                      |                                                      |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 01/07/2056                                        | 5 500                               | 4 991                            | 0,77                      | 4,813 % éch. 25/05/2035                                                                | 1 275                               | 1 204                            | 0,19                      | 3,513 % éch. 15/04/2037                               | 1 700                                                | 1 944                            | 0,30                      |      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056                                        | 3 300                               | 3 162                            | 0,49                      | Argent Securities Trust                                                                |                                     | 1 880                            | 531                       | 0,08                                                  | Palmer Square European Loan Funding DAC              |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056                                        | 48 800                              | 47 957                           | 7,39                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                                                                |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 15/08/2033                               | 1 400                                                | 1 605                            | 0,25                      |      |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                        | 4 900                               | 4 909                            | 0,76                      | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                             |                                     | 1 287                            | 1 291                     | 0,20                                                  | Plenti PL & Green ABS Trust                          |                                  |                           |      |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 58 300                              | 59 360                           | 9,15                      | 4,263 % éch. 25/08/2036                                                                | 1 287                               | 1 291                            | 0,20                      | 5,276 % éch. 11/07/2037                               | AUD 1 860                                            | 1 287                            | 0,20                      |      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 57 260                              | 59 234                           | 9,13                      | BNC Mortgage Loan Trust                                                                |                                     | 88                               | 59                        | 0,01                                                  | 5,486 % éch. 11/04/2036                              | 592                              | 411                       | 0,06 |
|                                                                |                                     | 283 137                          | 43,64                     | 4,045 % éch. 25/10/2036                                                                |                                     |                                  |                           | 5,506 % éch. 11/11/2036                               | 1 682                                                | 1 167                            | 0,18                      |      |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC                                      |                                                      |                                  |                           |      |
| Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                                    |                                     |                                  |                           | 3,904 % éch. 15/07/2038                               | € 1 000                                              | 1 146                            | 0,18                      |      |
| 4,250 % éch. 15/08/2054                                        | 700                                 | 625                              | 0,09                      | Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates             |                                     |                                  |                           | Toro European CLO DAC                                 |                                                      |                                  |                           |      |
| 4,500 % éch. 15/11/2054                                        | 3 600                               | 3 352                            | 0,52                      | 4,813 % éch. 25/05/2035                                                                | 1 275                               | 1 204                            | 0,19                      | 3,950 % éch. 12/01/2032                               | 1 900                                                | 2 178                            | 0,33                      |      |
| 4,625 % éch. 15/11/2045                                        | 2 090                               | 2 007                            | 0,31                      | Argent Securities Trust                                                                |                                     | 1 880                            | 531                       | 0,08                                                  | 4,154 % éch. 15/04/2037                              | 1 400                            | 1 603                     | 0,25 |
| 4,625 % éch. 15/02/2046                                        | 400                                 | 384                              | 0,06                      | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                             |                                     | 1 287                            | 1 291                     | 0,20                                                  |                                                      |                                  | 53 085                    | 8,18 |
| 4,750 % éch. 15/02/2056                                        | 5 900                               | 5 733                            | 0,88                      | 4,263 % éch. 25/08/2036                                                                | 1 287                               | 1 291                            | 0,20                      | PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE               |                                                      |                                  |                           |      |
| 4,875 % éch. 15/08/2045                                        | 312                                 | 310                              | 0,05                      | BNC Mortgage Loan Trust                                                                |                                     | 88                               | 59                        | 0,01                                                  | First Franklin Mortgage Loan Trust                   |                                  |                           |      |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)     |                                     |                                  |                           | 4,045 % éch. 25/10/2036                                                                |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/03/2036                               | \$ 1 261                                             | 1 228                            | 0,19                      |      |
| 0,125 % éch. 15/07/2031                                        | 1 540                               | 1 414                            | 0,22                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                                      |                                     | 54                               | 50                        | 0,01                                                  | 4,513 % éch. 25/12/2035                              | 707                              | 686                       | 0,10 |
| 0,125 % éch. 15/01/2032                                        | 7 446                               | 6 743                            | 1,04                      | 4,043 % éch. 25/06/2047                                                                |                                     |                                  |                           | Lehman XS Trust                                       |                                                      |                                  |                           |      |
| 0,750 % éch. 15/02/2045                                        | 226                                 | 161                              | 0,02                      | 4,283 % éch. 25/12/2036                                                                | 210                                 | 200                              | 0,03                      | 4,083 % éch. 25/02/2037                               | 321                                                  | 321                              | 0,05                      |      |
| 1,000 % éch. 15/02/2046                                        | 576                                 | 423                              | 0,07                      | GSAMP Trust                                                                            |                                     | 1 546                            | 834                       | 0,13                                                  |                                                      |                                  | 2 235                     | 0,34 |
| 1,375 % éch. 15/07/2033                                        | 5 700                               | 5 470                            | 0,84                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                                                                | 1 546                               | 834                              | 0,13                      |                                                       |                                                      | 66 724                           | 10,28                     |      |
| 1,375 % éch. 15/02/2044                                        | 900                                 | 735                              | 0,11                      | 4,663 % éch. 25/11/2035                                                                | 58                                  | 57                               | 0,01                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                                      |                                  |                           |      |
| 1,500 % éch. 15/02/2053                                        | 672                                 | 511                              | 0,08                      | Long Beach Mortgage Loan Trust                                                         |                                     | 408                              | 283                       | 0,04                                                  | Obligation internationale du gouvernement australien |                                  |                           |      |
| 1,875 % éch. 15/07/2034                                        | 15 066                              | 14 854                           | 2,29                      | 4,063 % éch. 25/11/2036                                                                | 408                                 | 283                              | 0,04                      | 5,000 % éch. 21/06/2036                               | AUD 3 800                                            | 2 687                            | 0,41                      |      |
| Billets du Trésor américain                                    |                                     |                                  |                           | 4,073 % éch. 25/08/2036                                                                | 2 224                               | 1 172                            | 0,18                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien   |                                                      |                                  |                           |      |
| 2,375 % éch. 31/03/2029                                        | 2 100                               | 2 003                            | 0,31                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                                 |                                     | 302                              | 289                       | 0,04                                                  | 6,125 % éch. 15/03/2034                              | \$ 800                           | 805                       | 0,12 |
| 3,750 % éch. 30/04/2027                                        | 800                                 | 798                              | 0,12                      | 4,438 % éch. 25/09/2035                                                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement chilien     |                                                      |                                  |                           |      |
| 3,875 % éch. 30/09/2029                                        | 2 400                               | 2 379                            | 0,37                      | Soundview Home Loan Trust                                                              |                                     | 379                              | 367                       | 0,06                                                  | 2,750 % éch. 31/01/2027                              | 300                              | 297                       | 0,05 |
| 4,000 % éch. 31/07/2032                                        | 10 500                              | 10 350                           | 1,59                      | 4,263 % éch. 25/10/2036                                                                | 379                                 | 367                              | 0,06                      | 3,500 % éch. 31/01/2034                               | 300                                                  | 273                              | 0,04                      |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Structured Asset Investment Loan Trust                                                 |                                     | 1 405                            | 1 339                     | 0,21                                                  |                                                      |                                  |                           |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 25/05/2035                                                                | 1 405                               | 1 339                            | 0,21                      |                                                       |                                                      |                                  |                           |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                                  |                                     | 1 348                            | 1 389                     | 0,21                                                  |                                                      |                                  |                           |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,198 % éch. 25/07/2036                                                                | 1 348                               | 1 389                            | 0,21                      |                                                       |                                                      |                                  |                           |      |

| DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>5,625 % éch. 19/02/2036   | € 4 500                             | \$ 5 116                         | 0,79                      | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>2,250 % éch. 12/08/2036       | € 870                               | \$ 794                           | 0,12                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>7,000 % éch. | ZAR 2 500                           | \$ 147                           | 0,02                      |
| TES colombien                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch.                                                                        |                                     |                                  |                           | 28/02/2031                                                             |                                     |                                  |                           |
| 11,750 % éch. 24/01/2035 COP                                                     | 5 471 800                           | 1 559                            | 0,24                      | 24/08/2034 (c)                                                                      | MXN 5 871                           | 323                              | 0,05                      | 8,875 % éch.                                                           |                                     |                                  |                           |
| 12,000 % éch. 13/03/2058                                                         | 4 879 000                           | 1 399                            | 0,22                      | 4,490 % éch. 25/05/2032                                                             | € 1 400                             | 1 629                            | 0,25                      | 28/02/2035                                                             | 162 025                             | 10 245                           | 1,58                      |
| 12,500 % éch. 27/02/2030                                                         | 30 932 900                          | 9 029                            | 1,39                      | 4,875 % éch. 16/05/2036                                                             | 1 500                               | 1 719                            | 0,27                      |                                                                        |                                     | 56 543                           | 8,71                      |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain<br>5,500 % éch. 21/11/2030 | € 500                               | 602                              | 0,09                      | 5,625 % éch. 09/02/2034                                                             | \$ 600                              | 591                              | 0,09                      |                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035       | PEN 15 200                          | 4 692                            | 0,72                      | ACTIONS                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 30/04/2029                                                          | \$ 500                              | 504                              | 0,08                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                                                             | 12 200                              | 4 008                            | 0,62                      | ACTIONS ORDINAIRES                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                                          | 600                                 | 610                              | 0,09                      | Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033         | \$ 2 200                            | 2 212                            | 0,34                      | SERVICES FINANCIERS                                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois<br>4,000 % éch. 25/07/2029    | € 1 300                             | 1 523                            | 0,23                      | Obligation internationale de la République d'Ouzbékistan<br>5,375 % éch. 29/05/2027 | € 400                               | 464                              | 0,07                      | MNSN Holdings,<br>Inc. (b)(f)                                          | 681                                 | 57                               | 0,01                      |
| 4,875 % éch. 22/03/2040                                                          | 700                                 | 839                              | 0,13                      | Obligation internationale du gouvernement roumain<br>1,750 % éch. 13/07/2030        | 600                                 | 623                              | 0,10                      | TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION                                          |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,100 % éch. 20/09/2054    | ¥ 51 100                            | 217                              | 0,03                      | 5,500 % éch. 18/09/2028                                                             | 350                                 | 416                              | 0,06                      | NVIDIA Corp.                                                           | 3 382                               | 677                              | 0,10                      |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                                                          | 21 900                              | 98                               | 0,02                      | 6,375 % éch. 18/09/2033                                                             | 350                                 | 427                              | 0,07                      |                                                                        |                                     | 734                              | 0,11                      |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                                                          | 65 000                              | 296                              | 0,05                      | Obligation internationale du gouvernement serbe<br>1,000 % éch. 23/09/2028          | 400                                 | 432                              | 0,07                      | TITRES PRIVILÉGIÉS                                                     |                                     |                                  |                           |
| 2,700 % éch. 20/09/2045                                                          | 64 150                              | 347                              | 0,05                      |                                                                                     |                                     |                                  |                           | SVB Financial Trust<br>11,000 % éch.                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                                                          | 88 000                              | 475                              | 0,07                      |                                                                                     |                                     |                                  |                           | 07/11/2032                                                             | 776                                 | 357                              | 0,06                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                     |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                                           | \$ 690 904                          | 106,49                           |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                           | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des contrats<br>de mise en<br>pension à<br>recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BPS                                   | 3,690 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 39 200               | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,875 % échéance 15/07/2035 | \$ (39 809)         | \$ 39 200                                      | \$ 39 204                                                                      | 6,04                   |
|                                       | 3,700           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 85 900                  | Ginnie Mae 5,500 % échéance 20/11/2052                                                | (88 858)            | 85 900                                         | 85 909                                                                         | 13,24                  |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                                       | \$ (128 667)        | \$ 125 100                                     | \$ 125 113                                                                     | 19,28                  |

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026              | 177                   | \$ 186                                  | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Long  | 09/2026              | 3                     | 2                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Long  | 09/2026              | 7                     | 10                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 418                   | (63)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 342                   | 66                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 1 275                 | 786                                     | 0,12                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026              | 153                   | (216)                                   | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026              | 29                    | (79)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 469                   | 1 387                                   | 0,21                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 104                   | 250                                     | 0,04                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 2 329                                | 0,36                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                      |                       | \$ 2 329                                | 0,36                   |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

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

| Entité de référence            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| British Telecommunications PLC | 1,000 %                 | 20/06/2028         | € 200                               | \$ 0                                    | 0,00                   |
| British Telecommunications PLC | 1,000                   | 20/12/2028         | 900                                 | 5                                       | 0,00                   |
|                                |                         |                    |                                     | \$ 5                                    | 0,00                   |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans | 5,000 %                 | 20/06/2030         | \$ 98                               | \$ 1                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 4 704                               | 108                                     | 0,02                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/06/2031         | 13 662                              | 292                                     | 0,04                   |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2030         | 5 100                               | (3)                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 14 550                              | 54                                      | 0,01                   |
|                                |                         |                    |                                     | \$ 452                                  | 0,07                   |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 26 300          | \$ (501)                          | (0,08)              |
| À recevoir                       | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,700     | 28/03/2034      | 100               | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,930     | 06/01/2035      | 100               | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      | 17 400            | 112                               | 0,02                |
| À payer                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,320     | 20/10/2033      | 100               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 15/12/2026      | ¥ 330 000         | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 16/06/2028      | 890 000           | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 15/12/2028      | 1 690 000         | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 15/06/2032      | 226 300           | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500     | 15/03/2042      | 101 000           | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,700     | 18/09/2029      | 860 000           | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/09/2034      | 440 000           | 60                                | 0,01                |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 17/06/2031      | 2 729 500         | (14)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,500     | 16/06/2028      | \$ 150            | (11)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,750     | 16/06/2031      | 100               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 16/06/2051      | 40                | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,350     | 20/01/2027      | 200               | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,360     | 15/02/2027      | 550               | (36)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,420     | 24/02/2027      | 400               | (26)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,450     | 17/02/2027      | 500               | (32)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,450     | 16/07/2031      | 50                | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 12/01/2029      | 110               | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,785     | 12/08/2051      | 50                | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,815     | 24/01/2052      | 50                | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,867     | 26/01/2052      | 50                | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 21/12/2027      | 2 820             | (84)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 21/12/2029      | 2 600             | (61)                              | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 15/12/2051      | 200               | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,430     | 30/09/2027      | 460               | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,450     | 04/10/2027      | 460               | (9)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,537     | 24/07/2053      | 100               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,750     | 21/06/2053      | 3 200             | 230                               | 0,03                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2027      | 37 000            | 411                               | 0,06                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      | 9 300             | (78)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 16/09/2028      | 8 900             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030      | 64 100            | (1 087)                           | (0,17)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 21/06/2030      | 1 570             | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 21/06/2028      | 420               | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2035      | 27 100            | 556                               | 0,09                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2055      | 800               | (26)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,350     | 14/12/2032      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,370     | 12/07/2053      | 200               | (16)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,375     | 15/10/2034      | 200               | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,385     | 17/10/2034      | 200               | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,395     | 17/10/2034      | 300               | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,400     | 17/10/2034      | 100               | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,446     | 23/10/2034      | 200               | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,450     | 11/10/2034      | 200               | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,463     | 23/10/2034      | 200               | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,465     | 30/10/2034      | 400               | (14)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,481     | 29/10/2034      | 200               | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,495     | 30/10/2034      | 200               | (6)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/12/2027      | 11 200            | (149)                             | (0,02)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2028      | 111 700           | (1 449)                           | (0,22)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2031      | 23 200            | (497)                             | (0,08)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 22/05/2033      | 21 620            | 48                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/06/2033      | 66 500            | 1 609                             | 0,25                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2033      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055      | 9 400             | 409                               | 0,06                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,515     | 06/11/2034      | 1 300             | (40)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 300               | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,555     | 05/03/2054      | 100               | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,564     | 31/01/2033      | 220               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,594     | 09/01/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,600     | 17/01/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,610     | 12/12/2032      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,620     | 31/01/2034      | 100               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,648     | 08/01/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,650     | 05/03/2034      | 200               | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,655     | 24/01/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,665     | 24/01/2034      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,670     | 08/01/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,684     | 03/01/2034      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,685     | 24/01/2034      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 06/06/2033      | 12 640            | 71                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 05/03/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,710     | 05/02/2034      | 200               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,725     | 07/02/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,735     | 23/01/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,738     | 23/01/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 %   | 17/09/2027      | \$ 13 200         | \$ (135)                          | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 13/12/2027      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/12/2028      | 4 800             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 5 000             | (76)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 12 100            | 60                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      | 44 500            | (812)                             | (0,13)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 32 700            | 866                               | 0,13                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 9 400             | (144)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/03/2033      | 41 130            | 674                               | 0,10                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 02/01/2034      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 3 100             | 65                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 07/05/2035      | 600               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 6 200             | 159                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2055      | 3 100             | 113                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,755     | 15/02/2036      | 580               | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,783     | 07/02/2034      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810     | 02/01/2034      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830     | 12/10/2053      | 100               | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,840     | 08/01/2035      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842     | 04/03/2030      | 600               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842     | 26/12/2033      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 08/01/2035      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854     | 29/12/2033      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 21/02/2034      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,865     | 20/11/2034      | 700               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,866     | 14/11/2034      | 700               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 05/03/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 17/10/2053      | 100               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,874     | 05/03/2035      | 300               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 16/10/2053      | 100               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,884     | 25/03/2035      | 300               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,890     | 03/03/2035      | 150               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,896     | 08/01/2035      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 10/04/2034      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 15/04/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 08/01/2035      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,905     | 12/03/2035      | 300               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,908     | 04/03/2035      | 300               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,930     | 24/03/2035      | 600               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,933     | 06/01/2035      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 22/02/2029      | 600               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 19/12/2033      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 16/04/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 27/02/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 15/01/2035      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,975     | 21/03/2035      | 500               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 24 100            | 844                               | 0,13                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 500               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 26/02/2035      | 350               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 15/02/2036      | 230               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 31 600            | (465)                             | (0,07)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2056      | 12 400            | (307)                             | (0,05)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 30/12/2034      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 15/11/2053      | 220               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 15/12/2033      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,052     | 15/02/2056      | 90                | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,059     | 15/02/2056      | 90                | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,066     | 15/02/2046      | 90                | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,071     | 15/01/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,076     | 15/02/2046      | 270               | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 17/04/2034      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,082     | 15/11/2053      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,083     | 15/11/2053      | 110               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 22/04/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 30/04/2034      | 600               | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 22/01/2035      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,100     | 21/01/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,130     | 03/05/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 22/04/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 22/11/2033      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,832     | 04/01/2027      | BRL 4 000         | (65)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,256    | 04/01/2027      | 38 700            | (532)                             | (0,08)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,354    | 02/01/2029      | 134 275           | (492)                             | (0,08)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 14,684    | 02/01/2031      | 14 600            | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | BBR NZD à 3 mois              | 4,750     | 19/06/2029      | NZD 1 900         | 28                                | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 20/03/2034      | AUD 4 000         | (27)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 18/06/2035      | 11 000            | (393)                             | (0,06)              |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 1,000     | 13/05/2027      | € 700             | 30                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 1,000     | 18/05/2027      | 400               | 17                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,220     | 08/01/2035      | 100               | (5)                               | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250 %   | 16/09/2028      | € 11 300          | \$ 116                            | 0,02                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,280     | 04/03/2030      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,300     | 25/09/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,350     | 29/04/2030      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,360     | 07/10/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,380     | 31/12/2034      | 100               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,390     | 01/10/2034      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 09/04/2030      | 300               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 12/02/2035      | 200               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,410     | 05/11/2034      | 400               | (9)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,420     | 07/03/2035      | 200               | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,450     | 05/05/2035      | 200               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,460     | 01/04/2035      | 200               | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 6 200             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,510     | 09/04/2035      | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 27/03/2035      | 200               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 09/04/2035      | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,547     | 09/03/2033      | 400               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,550     | 16/04/2035      | 200               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,580     | 29/08/2034      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,590     | 19/08/2034      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,610     | 24/03/2035      | 200               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,650     | 14/08/2029      | 200               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,650     | 08/01/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,670     | 03/04/2034      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,680     | 07/08/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,700     | 13/08/2029      | 100               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,710     | 06/08/2034      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 05/03/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 8 900             | (22)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 03/01/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 04/03/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 16/04/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 29/04/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,780     | 02/05/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,818     | 26/06/2029      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,827     | 06/05/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,860     | 24/04/2029      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,880     | 19/12/2028      | 200               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,890     | 22/12/2033      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,910     | 29/12/2033      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,920     | 13/12/2028      | 300               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,950     | 29/12/2028      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,950     | 12/06/2029      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,970     | 15/12/2033      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,990     | 08/12/2033      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 7 950             | 18                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,063     | 06/12/2033      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,128     | 04/12/2033      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,148     | 20/11/2033      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,179     | 29/11/2028      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,250     | 06/11/2033      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,255     | 22/11/2028      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,270     | 08/11/2028      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,270     | 21/08/2033      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,280     | 22/11/2033      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,300     | 03/10/2033      | 400               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,305     | 27/11/2033      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,370     | 09/10/2028      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,450     | 20/10/2028      | 200               | 1                                 | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (1 145)                        | (0,18)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (688)                          | (0,11)              |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.



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

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

## OPTIONS ACHETÉES

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,110 %         | 26/07/2032        | 200                              | \$ 33  | \$ 9         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,110           | 26/07/2032        | 300                              | 49     | 97           | 0,01                |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,400           | 20/07/2027        | 200                              | 26     | 1            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,400           | 20/07/2027        | 200                              | 26     | 60           | 0,01                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 134 | \$ 167       | 0,02                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                    | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 1 000                         | \$ (44)                | \$ 48                            | \$ 4         | 0,00                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 620                            | \$ 140                 | \$ (8)                           | \$ 132       | 0,02                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 42 5-Year 35-100% Index   | 5,000                | 20/12/2029      | 96                               | 19                     | (2)                              | 17           | 0,00                |
|              | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 560                              | 128                    | (9)                              | 119          | 0,02                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 110                              | 25                     | (1)                              | 24           | 0,01                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 640                              | 147                    | (11)                             | 136          | 0,02                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.14 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | \$ 1 600                         | 0                      | 8                                | 8            | 0,00                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 459                 | \$ (23)                          | \$ 436       | 0,07                |

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

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

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À payer            | Nvidia Corp. | 3 382                        | 5,620 %       | \$ 651            | 29/07/2026      | \$ 0                   | \$ (25)                          | \$ (25)      | 0,00                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 2 124             | \$ 1 519           | \$ 47                 | \$ 47                                  | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 19                | 15                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 13                | CAD 19             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 19                | \$ 13              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | \$              | 602               | ¥ 95 755           | 0                     | (13)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 8 076             | \$ 2 384           | 23                    | 23                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | €               | 1 909             | 2 177              | 0                     | (5)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 755               | £ 573              | 5                     | 5                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 52                | INR 4 992          | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 036             | ¥ 323 663          | 0                     | (44)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 21                | KWD 7              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 2 214             | \$ 135             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 486               | BRL 2 473          | 0                     | (12)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 53                | INR 5 080          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 06/2027           |                 | 17                | KWD 5              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2029           | KWD             | 9                 | \$ 30              | 2                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 05/2030           |                 | 53                | 184                | 9                     | 9                                      | 0,00                |
|              | 06/2031           |                 | 25                | 85                 | 2                     | 2                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ZAR             | 10 936            | 673                | 7                     | 7                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 429               | PEN 1 462          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 42 610 641        | \$ 12 175          | 30                    | 30                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 1 462             | 428                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4                 | PEN 12             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 4 222             | \$ 1 208           | 0                     | (22)                                   | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | INR             | \$                | 88                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 432                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | INR               | 5 685              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | NOK               | 92                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 314                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
| FAR          | 09/2026           | \$              | INR               | 8 396              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | \$                | 18 069             | 236                   | 236                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | ¥               |                   | 15 090             | 67                    | 67                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | ¥                 | 39 812             | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | \$                | 439                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | \$              | ¥                 | 2 435 150          | 0                     | (68)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | PEN             | \$                | 4 889              | 75                    | 75                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 31 233             | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | \$                | 4                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | CAD               | 1 795              | 4                     | 4                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | ZAR             | \$                | 1 086              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             |                   | 1 261              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | BRL               | 45 569             | 0                     | (193)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           |                 | INR               | 4 068              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | BRL               | 5 412              | 0                     | (21)                                    | 0,00                |
| MBC          | 09/2026           |                 | INR               | 37 139             | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | \$                | 6 555              | 185                   | 185                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | NOK             |                   | 24                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | £                 | 553                | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | NOK               | 233                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 09/2026           |                 | INR               | 7 847              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | MXN               | 160 786            | 0                     | (111)                                   | (0,02)              |
|              | 12/2026           | MXN             | \$                | 36                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             |                   | 27                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               |                   | 6 146              | 80                    | 80                                      | 0,01                |
| NSL          | 07/2026           | INR             |                   | 89                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 6 270              | 18                    | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 412                | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | INR               | 13 176             | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ¥                 | 701 803            | 0                     | (97)                                    | (0,01)              |
| SCX          | 07/2026           |                 | NOK               | 219                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | \$                | 4 324              | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | INR               | 28 234             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 240                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | £                 | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | INR               | 13 299             | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | \$                | 4 840              | 84                    | 84                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | INR               | 17 438             | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 |                   | 10 103             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | \$                | 104 007            | 2 073                 | 2 073                                   | 0,32                |
| SSB          | 07/2026           | \$              | AUD               | 5 087              | 14                    | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 98 212             | 571                   | 571                                     | 0,09                |
|              | 07/2026           |                 | ¥                 | 1 280 808          | 0                     | (182)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | SGD               | 19                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | \$                | 3 508              | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | €               |                   | 111 868            | 0                     | (570)                                   | (0,09)              |
|              | 08/2026           | SGD             |                   | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             |                   | 1 338              | 38                    | 38                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | CAD               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 1 909              | 6                     | 6                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           |                 | £                 | 12 311             | 66                    | 66                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD             | \$                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               |                   | 2 179              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               |                   | 16 273             | 0                     | (66)                                    | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 667           | \$ (1 479)            | \$ 2 188                                | 0,34                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et R en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | \$                | 15 055             | 0                     | (72)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 19 913             | 0                     | (385)                                   | (0,06)              |
|              | 08/2026           |                 |                   | 21 835             | 73                    | 73                                      | 0,01                |
| BPS          | 07/2026           |                 |                   | 439                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | \$                | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | \$              | AUD               | 2 160              | 0                     | (46)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | AUD             | \$                | 7 816              | 18                    | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | AUD               | 20 654             | 0                     | (425)                                   | (0,06)              |
|              | 08/2026           |                 |                   | 11 694             | 2                     | (16)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | \$                | 13 273             | 127                   | 127                                     | 0,02                |
| MBC          | 08/2026           | \$              | AUD               | 18 975             | 0                     | (126)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | AUD             | \$                | 7 903              | 0                     | (49)                                    | (0,01)              |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | \$ 250          | AUD 349           | \$ 0               | \$ (8)                | \$ (8)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 22          | \$ 15             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 898        | AUD 11 477        | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | AUD 435         | \$ 300            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 496        | AUD 4 914         | 0                  | (92)                  | (92)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 300             | 435               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 11 398          | 16 010            | 0                  | (307)                 | (307)                                   | (0,05)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 271             | \$ (1 529)            | \$ (1 258)                              | (0,19)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 5             | \$ 5              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 300             | 343               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 43 917       | € 37 697          | 0                  | (819)                 | (819)                                   | (0,13)              |
| CBK          | 08/2026           | € 373           | \$ 425            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 29              | 34                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 783          | € 671             | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 34 986        | \$ 39 901         | 0                  | (98)                  | (98)                                    | (0,02)              |
| MBC          | 08/2026           | \$ 39 955       | € 34 986          | 98                 | 0                     | 98                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | € 39 527        | \$ 44 952         | 41                 | (280)                 | (239)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 682          | € 588             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 40            | \$ 46             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | \$ 42 388       | € 37 270          | 279                | 0                     | 279                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | 41 127          | 35 350            | 0                  | (712)                 | (712)                                   | (0,11)              |
| SOG          | 07/2026           | € 37 270        | \$ 42 394         | 0                  | (216)                 | (216)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 43 895       | € 37 628          | 0                  | (874)                 | (874)                                   | (0,13)              |
| SSB          | 08/2026           | 42 452          | 37 270            | 216                | 0                     | 216                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | 207             | 182               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 182           | \$ 208            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 636             | \$ (3 027)            | \$ (2 391)                              | (0,37)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 33 923       | £ 25 268          | \$ 0               | \$ (386)              | \$ (386)                                | (0,06)              |
| BPS          | 07/2026           | £ 20 691        | \$ 27 288         | 0                  | (175)                 | (175)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 36 352       | £ 27 127          | 0                  | (349)                 | (349)                                   | (0,05)              |
| CBK          | 08/2026           | 27 287          | 20 691            | 175                | 0                     | 175                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | 677             | 512               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 36 040          | 26 801            | 0                  | (469)                 | (469)                                   | (0,07)              |
| NSL          | 07/2026           | £ 4 938         | \$ 6 499          | 0                  | (55)                  | (55)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 6 498        | £ 4 938           | 56                 | 0                     | 56                                      | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | £ 29 379        | \$ 38 891         | 0                  | (102)                 | (102)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 31 867       | £ 24 077          | 88                 | 0                     | 88                                      | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | £ 23 934        | \$ 31 617         | 0                  | (150)                 | (150)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 31 617       | £ 23 934          | 150                | 0                     | 150                                     | 0,02                |
| SSB          | 07/2026           | £ 253           | \$ 334            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 334          | £ 253             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 473             | \$ (1 687)            | \$ (1 214)                              | (0,19)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 38 930       | NOK 360 490       | \$ 0               | \$ (2 501)            | \$ (2 501)                              | (0,38)              |
| BPS          | 07/2026           | NOK 2 775       | \$ 292            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 24           | NOK 234           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | NOK 2 012       | \$ 212            | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 39 020       | NOK 361 280       | 0                  | (2 511)               | (2 511)                                 | (0,39)              |
| FAR          | 07/2026           | 22              | 219               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NOK 354 367     | \$ 35 659         | 1                  | (153)                 | (152)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$ 36 928       | NOK 342 300       | 0                  | (2 336)               | (2 336)                                 | (0,36)              |
| MYI          | 08/2026           | 36 935          | 367 208           | 157                | 0                     | 157                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | NOK 1 976       | \$ 208            | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | \$ 122          | NOK 1 160         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 403       | \$ 152            | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 196             | \$ (7 506)            | \$ (7 310)                              | (1,13)              |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de Capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de Capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |            |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------------|--------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 72 126            | SEK                | 667 026               | \$ 0                                    | \$ (3 206)          | \$ (3 206) | (0,49) |
| BPS          | 07/2026           |                 | 164               |                    | 1 578                 | 0                                       | (1)                 | (1)        | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           |                 | 78 005            |                    | 720 766               | 0                                       | (3 532)             | (3 532)    | (0,54) |
|              | 08/2026           |                 | 33 575            |                    | 326 607               | 233                                     | 0                   | 233        | 0,03   |
| FAR          | 07/2026           | SEK             | 431 387           | \$                 | 44 457                | 0                                       | (117)               | (117)      | (0,02) |
|              | 08/2026           | \$              | 44 457            | SEK                | 430 622               | 117                                     | 0                   | 117        | 0,02   |
| MBC          | 07/2026           | SEK             | 652 190           | \$                 | 66 993                | 1                                       | (396)               | (395)      | (0,06) |
|              | 07/2026           | \$              | 78 761            | SEK                | 732 489               | 18                                      | (3 094)             | (3 076)    | (0,47) |
|              | 08/2026           |                 | 66 941            |                    | 650 533               | 397                                     | 0                   | 397        | 0,06   |
| MYI          | 07/2026           |                 | 19                |                    | 178                   | 0                                       | 0                   | 0          | 0,00   |
| NSL          | 08/2026           |                 | 73 284            |                    | 712 004               | 416                                     | 0                   | 416        | 0,06   |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 1 182                                | \$ (10 346)         | \$ (9 164) | (1,41) |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |       | Devise à recevoir |       | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------|-------------------|-------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 685   | SGD               | 873   | \$ 0               | \$ (10)               | \$ (10)                                 | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD             | 285   | \$                | 220   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 088 | SGD               | 1 389 | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 220   |                   | 284   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD             | 2     | \$                | 2     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 14    | SGD               | 18    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SGD             | 220   | \$                | 170   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 764   | SGD               | 975   | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 170   |                   | 220   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD             | 717   | \$                | 553   | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 281 | SGD               | 1 635 | 0                  | (17)                  | (17)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 553   |                   | 716   | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           |                 | 16    |                   | 21    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           |                 | 2     |                   | 3     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD             | 154   | \$                | 119   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 119   | SGD               | 154   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD             | 3 539 | \$                | 2 732 | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 101   | SGD               | 130   | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 732 |                   | 3 531 | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | SGD             | 2     | \$                | 1     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |       |                   |       | \$ 5               | \$ (58)               | \$ (53)                                 | (0,01)              |

|                                                    |              |         |
|----------------------------------------------------|--------------|---------|
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | \$ (18 620)  | (2,87)  |
| Total des Investissements                          | \$ 799 025   | 123,15  |
| Autres actifs et passifs à court terme             | \$ (150 225) | (23,15) |
| Actif net                                          | \$ 648 800   | 100,00  |

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

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

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Le titre n'a pas généré de revenu au cours des douze derniers mois.
- (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (e) Titre convertible conditionnel.
- (f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,01 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|--------------|-------|--------------|---------------------|
| MNSN Holdings, Inc.       | 13/09/2024   | \$ 11 | \$ 57        | 0,01                |

- (g) Des titres d'une juste valeur globale de 1 446 \$ (31 décembre 2025 : 3 845 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 15 136 \$ (31 décembre 2025 : 9 224 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 22 510 \$ (31 décembre 2025 : 380 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 734                                                                            | \$ 677 755                                           | \$ 12 415                                         | \$ 690 904        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 125 100                                              | 0                                                 | 125 100           |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 448                                                                               | (17 427)                                             | 0                                                 | (16 979)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 182</b>                                                                   | <b>\$ 785 428</b>                                    | <b>\$ 12 415</b>                                  | <b>\$ 799 025</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 553 092                                           | \$ 7 268                                          | \$ 560 360        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 81 300                                               | 0                                                 | 81 300            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 58                                                                                | 7 685                                                | 0                                                 | 7 743             |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (10 733)                                             | 0                                                 | (10 733)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 58</b>                                                                      | <b>\$ 631 344</b>                                    | <b>\$ 7 268</b>                                   | <b>\$ 638 670</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| MSC                                           | 3,100 %        | 22/06/2026        | 31/07/2026         | \$ (802)         | \$ (803)                                 | (0,12)              |
| SCX                                           | 3,500          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (387)            | (389)                                    | (0,06)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (1 192)</b>                        | <b>(0,18)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (733)                                                   | \$ 960                  | \$ 227                            | \$ 1 252                                                   | \$ (1 360)              | \$ (108)                          |
| BOA          | (5 579)                                                    | 5 910                   | 331                               | 620                                                        | (680)                   | (60)                              |
| BPS          | (1 064)                                                    | 1 430                   | 366                               | 347                                                        | (400)                   | (53)                              |
| BRC          | 7                                                          | 0                       | 7                                 | 1 520                                                      | (1 650)                 | (130)                             |
| CBK          | (5 781)                                                    | 6 530                   | 749                               | 248                                                        | (310)                   | (62)                              |
| DUB          | (49)                                                       | 0                       | (49)                              | (27)                                                       | 0                       | (27)                              |
| FAR          | (630)                                                      | 780                     | 150                               | (475)                                                      | 370                     | (105)                             |
| GLM          | (110)                                                      | 0                       | (110)                             | 80                                                         | 0                       | 80                                |
| IND          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 232                                                        | (300)                   | (68)                              |
| JPM          | 203                                                        | (190)                   | 13                                | 143                                                        | 0                       | 143                               |
| MBC          | (5 406)                                                    | 5 880                   | 474                               | 1 513                                                      | (1 820)                 | (307)                             |
| MYC          | 65                                                         | 0                       | 65                                | 74                                                         | 0                       | 74                                |
| MYI          | 11                                                         | (10)                    | 1                                 | 6                                                          | 10                      | 16                                |
| NSL          | 419                                                        | (10)                    | 409                               | 680                                                        | (840)                   | (160)                             |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 10                                                         | 0                       | 10                                |
| SCX          | (629)                                                      | 750                     | 121                               | 195                                                        | (260)                   | (65)                              |
| SOG          | 925                                                        | (970)                   | (45)                              | 943                                                        | (1 070)                 | (127)                             |
| SSB          | 38                                                         | (10)                    | 28                                | 74                                                         | 0                       | 74                                |
| UAG          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (53)                                                       | 0                       | (53)                              |
| WST          | (307)                                                      | 270                     | (37)                              | 591                                                        | (590)                   | 1                                 |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 24,30            | 22,26                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 42,97            | 40,55                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,09             | 0,11                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 12,20            | 9,13                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,26             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,70             | 0,47                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,69             | 1,16                 |
| Autres actifs                                                    | 18,79            | 26,30                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,50             | 0,10                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 30,47            | 29,74                |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 43,64            | 44,86                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 9,76             | 11,62                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 2,96             | 5,12                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 10,28            | 11,28                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 8,71             | 3,99                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 0,11             | 0,01                 |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,06             | 0,07                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 19,28            | 15,49                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,36             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,07             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,18)           | (0,03)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,02             | 0,03                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,07             | 0,09                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,34             | (0,40)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (3,30)           | 1,80                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | S/O              | (2,05)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (23,15)          | (21,71)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

Rapport semestriel | 30 juni 2026 455

# Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,736 % éch. 25/07/2036                                   | \$ 203                              | € 139                            | 0,01                      | Residential Asset Securitization Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,357 % éch. 25/07/2036                              | \$ 26                               | € 22                             | 0,00                      |
| 6,420 % éch. 25/10/2035                                   | 16                                  | 13                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/02/2036                                    | \$ 1 099                            | € 602                            | 0,04                      | 4,603 % éch. 25/10/2047                              | 658                                 | 563                              | 0,04                      |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust              |                                     |                                  |                           | Resloc UK PLC                                              |                                     |                                  |                           | Ellington Loan Acquisition Trust                     |                                     |                                  |                           |
| 3,918 % éch. 26/12/2046                                   | 46                                  | 32                               | 0,00                      | 2,561 % éch. 15/12/2043                                    | € 473                               | 465                              | 0,03                      | 4,813 % éch. 25/05/2037                              | 1 639                               | 1 410                            | 0,09                      |
| Canada Square Funding PLC                                 |                                     |                                  |                           | RMAC PLC                                                   |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 4,597 % éch. 17/01/2059                                   | £ 3 242                             | 3 765                            | 0,24                      | 4,947 % éch. 15/02/2047                                    | £ 2 298                             | 2 669                            | 0,17                      | 4,033 % éch. 25/07/2036                              | 58                                  | 47                               | 0,00                      |
| Chase Mortgage Finance Trust                              |                                     |                                  |                           | RMAC Securities PLC                                        |                                     |                                  |                           | Long Beach Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 4,569 % éch. 25/01/2036                                   | \$ 1 330                            | 1 082                            | 0,07                      | 4,016 % éch. 12/06/2044                                    | 36                                  | 41                               | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/05/2036                              | 1 817                               | 828                              | 0,05                      |
| 6,000 % éch. 25/05/2037                                   | 88                                  | 32                               | 0,00                      | 4,036 % éch. 12/06/2044                                    | 616                                 | 703                              | 0,05                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                              | 4 384                               | 1 793                            | 0,12                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Structured Asset Mortgage Investments Trust                |                                     |                                  |                           | MASTR Asset-Backed Securities Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 4,669 % éch. 25/08/2035                                   | 152                                 | 124                              | 0,01                      | 4,143 % éch. 25/06/2036                                    | \$ 25                               | 22                               | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/10/2036                              | 2 804                               | 775                              | 0,05                      |
| 6,028 % éch. 25/03/2034                                   | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,254 % éch. 19/07/2035                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               |                                     |                                  |                           |
| 6,040 % éch. 25/11/2035                                   | 10                                  | 8                                | 0,00                      | 4,454 % éch. 19/12/2034                                    | 37                                  | 30                               | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/07/2036                              | 264                                 | 209                              | 0,01                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through |                                     |                                  |                           | 4,454 % éch. 19/02/2035                                    | 45                                  | 38                               | 0,00                      | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                |                                     |                                  |                           |
| Certificates                                              |                                     |                                  |                           | 5,148 % éch. 25/02/2036                                    | 134                                 | 101                              | 0,01                      | 3,903 % éch. 25/12/2036                              | 2 418                               | 999                              | 0,06                      |
| 4,405 % éch. 25/09/2035                                   | 346                                 | 291                              | 0,02                      | Towd Point Mortgage Funding PLC                            |                                     |                                  |                           | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Alternative Loan Trust                        |                                     |                                  |                           | 4,584 % éch. 20/04/2051                                    | £ 3 132                             | 3 637                            | 0,23                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                              | 303                                 | 249                              | 0,02                      |
| 4,173 % éch. 25/06/2037                                   | 18                                  | 16                               | 0,00                      | Twin Bridges PLC                                           |                                     |                                  |                           | NovaStar Mortgage Funding Trust                      |                                     |                                  |                           |
| 4,183 % éch. 25/07/2046                                   | 88                                  | 72                               | 0,01                      | 4,407 % éch. 12/09/2055                                    | 2 470                               | 2 867                            | 0,18                      | 3,963 % éch. 25/09/2037                              | 232                                 | 201                              | 0,01                      |
| 4,213 % éch. 25/09/2035                                   | 1 155                               | 601                              | 0,04                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust              |                                     |                                  |                           | Soundview Home Loan Trust                            |                                     |                                  |                           |
| 4,418 % éch. 20/11/2035                                   | 199                                 | 166                              | 0,01                      | 3,781 % éch. 25/05/2037                                    | \$ 458                              | 362                              | 0,02                      | 4,263 % éch. 25/10/2036                              | 3 136                               | 2 651                            | 0,17                      |
| 4,744 % éch. 25/12/2035                                   | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 25/06/2035                                   | 3                                   | 2                                | 0,00                      | 4,494 % éch. 25/02/2047                                    | 2 069                               | 1 739                            | 0,11                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/03/2036                                   | 184                                 | 68                               | 0,01                      | Wells Fargo Alternative Loan Trust                         |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/08/2037                                   | 283                                 | 119                              | 0,01                      | 6,312 % éch. 25/07/2037                                    | 17                                  | 14                               | 0,00                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust         |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,549 % éch. 25/04/2035                                   | 74                                  | 41                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,961 % éch. 20/05/2036                                   | 35                                  | 30                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,343 % éch. 25/04/2035                                   | 72                                  | 61                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,403 % éch. 25/03/2035                                   | 112                                 | 92                               | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,503 % éch. 25/02/2035                                   | 107                                 | 87                               | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust             |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,143 % éch. 25/08/2047                                   | 2 668                               | 2 039                            | 0,13                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Dilosk RMBS DAC                                           |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,204 % éch. 20/10/2062                                   | € 2 631                             | 2 637                            | 0,17                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Domi BV                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,914 % éch. 16/04/2057                                   | 5 834                               | 5 841                            | 0,37                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Dutch Property Finance BV                                 |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,913 % éch. 28/10/2059                                   | 752                                 | 752                              | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Elstree PLC                                               |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,475 % éch. 21/10/2065                                   | £ 1 169                             | 1 355                            | 0,09                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| EMF-UK PLC                                                |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,846 % éch. 13/03/2046                                   | 1 831                               | 2 129                            | 0,14                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust       |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,336 % éch. 25/03/2035                                   | \$ 24                               | 11                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| GSR Mortgage Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,479 % éch. 25/01/2036                                   | 2                                   | 2                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| HarborView Mortgage Loan Trust                            |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,612 % éch. 19/05/2033                                   | 2                                   | 1                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Harbour PLC                                               |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,797 % éch. 28/10/2054                                   | £ 3 782                             | 4 405                            | 0,28                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Hops Hill PLC                                             |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,464 % éch. 21/06/2056                                   | 6 931                               | 8 026                            | 0,51                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,734 % éch. 21/12/2055                                   | 4 120                               | 4 796                            | 0,30                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,034 % éch. 27/11/2054                                   | 2 264                               | 2 632                            | 0,17                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                               |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 25/11/2035                                   | \$ 60                               | 51                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,143 % éch. 25/09/2046                                   | 437                                 | 363                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Mansard Mortgages PLC                                     |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,516 % éch. 15/12/2049                                   | £ 283                               | 329                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| MASTR Asset Securitization Trust                          |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                   | \$ 84                               | 39                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Newgate Funding PLC                                       |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,866 % éch. 15/12/2050                                   | £ 173                               | 199                              | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Pierpont BTL PLC                                          |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,846 % éch. 21/09/2054                                   | 2 998                               | 3 483                            | 0,22                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Polaris PLC                                               |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,505 % éch. 25/08/2068                                   | 6 838                               | 7 932                            | 0,50                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                          |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch.                                              |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 30/12/2057 (b)                                            | AUD 28 500                          | 17 214                           | 1,09                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust                    |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/03/2047                                   | \$ 856                              | 715                              | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/07/2036                                   | 1 154                               | 298                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/06/2046                                   | 322                                 | 56                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/05/2037                                   | 35                                  | 26                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/06/2037                                   | 248                                 | 177                              | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------|
| Rockford Tower Europe CLO DAC                        |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement français    |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,121 % éch. 24/01/2035                              | 1 000                               | 1 000                            | 0,06                      | 0,750 % éch. 25/05/2052                               | 2 900                               | 1 292                            | 0,08                      | 02/07/2035 (h)                                     | 9 300                               | 9 278                            | 0,59                   |
| 3,489 % éch. 29/08/2036                              | 2 800                               | 2 803                            | 0,18                      | 1,500 % éch. 25/05/2050 (h)                           | 31 800                              | 18 558                           | 1,18                      | 3,275 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| RRE Loan Management DAC                              |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 25/02/2029 (h)                           | 40 800                              | 40 804                           | 2,59                      | 12/03/2036                                         | 18 600                              | 18 652                           | 1,18                   |
| 3,494 % éch. 15/12/2039                              | 1 400                               | 1 401                            | 0,09                      | 3,000 % éch. 25/05/2033                               | 4 000                               | 3 940                            | 0,25                      | 3,500 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| SC Germany S.A., Compartiment Consumer               |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 25/05/2055                               | 800                                 | 648                              | 0,04                      | 14/04/2055                                         | 5 900                               | 5 422                            | 0,34                   |
| 2,849 % éch. 15/09/2037                              | 1 934                               | 1 937                            | 0,12                      | 3,750 % éch. 25/05/2056 (h)                           | 3 100                               | 2 747                            | 0,17                      | Obligation internationale du gouvernement espagnol |                                     |                                  |                        |
| Secucor Finance DAC                                  |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 25/05/2057 (h)                           | 2 300                               | 2 275                            | 0,14                      | 0,100 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,116 % éch. 20/09/2036                              | 8 100                               | 8 139                            | 0,52                      | 5,500 % éch. 25/04/2029 (h)                           | 20 900                              | 22 443                           | 1,42                      | 30/04/2031                                         | 300                                 | 264                              | 0,02                   |
| SLM Student Loan Trust                               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement hongrois    |                                     |                                  |                           | 0,600 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 2,565 % éch. 25/10/2039                              | 597                                 | 559                              | 0,03                      | 5,500 % éch. 26/03/2036                               | 2 900                               | 2 550                            | 0,16                      | 31/10/2029                                         | 16 600                              | 15 520                           | 0,98                   |
| Tikehau CLO DAC                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement irlandais   |                                     |                                  |                           | 0,850 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,404 % éch. 15/10/2038                              | 2 000                               | 2 003                            | 0,13                      | 2,600 % éch. 18/10/2034                               | 1 300                               | 1 271                            | 0,08                      | 30/07/2037                                         | 1 100                               | 841                              | 0,05                   |
| Toro European CLO DAC                                |                                     |                                  |                           | 3,100 % éch. 18/06/2036                               | 1 000                               | 1 005                            | 0,06                      | 1,900 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,070 % éch. 12/01/2032                              | 2 016                               | 2 018                            | 0,13                      | 3,150 % éch. 18/10/2055                               | 4 700                               | 4 314                            | 0,27                      | 31/10/2052                                         | 1 700                               | 1 130                            | 0,07                   |
| 3,155 % éch. 25/07/2034                              | 2 155                               | 2 157                            | 0,14                      | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                     |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
|                                                      |                                     | 104 487                          | 6,62                      | 0,100 % éch. 15/05/2033 (d)                           | 9 058                               | 8 311                            | 0,53                      | 31/01/2030                                         | 9 600                               | 9 596                            | 0,61                   |
| PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE              |                                     |                                  |                           | 1,100 % éch. 15/08/2031 (d)                           | 42 033                              | 42 001                           | 2,66                      | 3,150 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| Lehman XS Trust                                      |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 15/09/2032 (d)                           | 16 573                              | 16 673                           | 1,06                      | 30/04/2033                                         | 3 254                               | 3 283                            | 0,21                   |
| 6,500 % éch. 25/06/2046                              | \$ 1 898                            | 1 445                            | 0,09                      | 2,550 % éch. 15/05/2056 (d)                           | 5 230                               | 5 412                            | 0,34                      | 31/10/2035 (h)                                     | 13 900                              | 13 844                           | 0,88                   |
|                                                      |                                     | 197 455                          | 12,52                     | 2,800 % éch. 01/03/2067                               | 16 500                              | 11 771                           | 0,75                      | 3,250 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                     |                                  |                           | 2,850 % éch. 01/02/2031                               | 22 100                              | 21 979                           | 1,39                      | 30/04/2034                                         | 1 475                               | 1 488                            | 0,09                   |
| Adif Alta Velocidad                                  |                                     |                                  |                           | 2,950 % éch. 01/07/2030                               | 7 900                               | 7 913                            | 0,50                      | 3,400 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,125 % éch. 31/01/2030                              | € 1 900                             | 1 911                            | 0,12                      | 3,150 % éch. 15/11/2031 (h)                           | 27 600                              | 27 729                           | 1,76                      | 31/10/2036                                         | 32 600                              | 32 748                           | 2,08                   |
| 3,625 % éch. 30/04/2035                              | 4 600                               | 4 647                            | 0,30                      | 3,450 % éch. 15/07/2031                               | 32 200                              | 32 847                           | 2,08                      | 3,450 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| Obligation internationale du gouvernement australien |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/02/2031                               | 38 000                              | 38 850                           | 2,46                      | 30/07/2043                                         | 11 400                              | 10 934                           | 0,69                   |
| 1,500 % éch. 21/06/2031                              | AUD 42 700                          | 22 562                           | 1,43                      | 3,587 % éch. 15/10/2031                               | 13 500                              | 13 981                           | 0,89                      | 3,450 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| Obligation internationale du gouvernement autrichien |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 01/10/2035                               | 3 500                               | 3 520                            | 0,22                      | 30/07/2066                                         | 10 000                              | 8 826                            | 0,56                   |
| 2,100 % éch. 20/09/2117                              | € 8 300                             | 4 923                            | 0,31                      | 3,700 % éch. 15/06/2030                               | 7 800                               | 8 030                            | 0,51                      | 3,500 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 2,900 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 3,800 % éch. 01/07/2036                               | 2 100                               | 2 135                            | 0,14                      | 31/05/2029                                         | 11 300                              | 11 566                           | 0,73                   |
| 20/02/2033 (h)                                       | 6 500                               | 6 504                            | 0,41                      | 4,000 % éch. 15/11/2030 (h)                           | 14 700                              | 15 327                           | 0,97                      | 3,500 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,200 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 01/05/2033 (h)                           | 13 302                              | 14 250                           | 0,90                      | 31/01/2041                                         | 1 500                               | 1 471                            | 0,09                   |
| 20/02/2036 (h)                                       | 9 000                               | 9 061                            | 0,58                      | 4,650 % éch. 01/10/2055                               | 11 000                              | 11 451                           | 0,73                      | 3,900 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,800 % éch. 26/01/2062                              | 6 900                               | 6 997                            | 0,44                      | Obligation internationale du gouvernement japonais    |                                     |                                  |                           | 30/07/2039                                         | 100                                 | 103                              | 0,01                   |
| 4,150 % éch. 15/03/2037                              | 15 600                              | 16 952                           | 1,08                      | 1,800 % éch. 20/03/2054                               | 97 000                              | 335                              | 0,02                      | 4,000 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| Communauté autonome de Catalogne                     |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 20/06/2054                               | 113 000                             | 431                              | 0,03                      | 31/10/2054                                         | 4 800                               | 4 789                            | 0,30                   |
| 4,220 % éch. 26/04/2035                              | 1 600                               | 1 666                            | 0,11                      | 2,300 % éch. 20/12/2054                               | 113 000                             | 440                              | 0,03                      | 4,700 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| Obligation internationale du gouvernement belge      |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2055                               | 228 400                             | 911                              | 0,06                      | 30/07/2041                                         | 6 200                               | 6 936                            | 0,44                   |
| 2,150 % éch. 22/06/2066                              | 6 000                               | 3 546                            | 0,23                      | 3,200 % éch. 20/09/2055                               | 422 600                             | 1 997                            | 0,13                      | 4,900 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 3,400 % éch. 22/06/2036                              | 23 000                              | 22 936                           | 1,45                      | 3,400 % éch. 20/12/2055                               | 730 000                             | 3 586                            | 0,23                      | 30/07/2040                                         | 6 400                               | 7 304                            | 0,46                   |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA                        |                                     |                                  |                           | Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap                |                                     |                                  |                           | Treasury Corp. of Victoria                         |                                     |                                  |                        |
| 4,375 % éch. 01/10/2030                              | \$ 4 400                            | 3 796                            | 0,24                      | 3,500 % éch. 22/06/2045                               | € 4 800                             | 4 383                            | 0,28                      | 2,000 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| Obligation internationale du gouvernement colombien  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement néerlandais |                                     |                                  |                           | 17/09/2035                                         | AUD 25 100                          | 11 558                           | 0,73                   |
| 6,125 % éch. 21/01/2031                              | 1 200                               | 1 061                            | 0,07                      | 2,500 % éch. 15/07/2035 (h)                           | 25 100                              | 24 277                           | 1,54                      | Bon du Trésor britannique                          |                                     |                                  |                        |
| 6,500 % éch. 21/01/2033                              | 2 200                               | 1 957                            | 0,12                      | New South Wales Treasury Corp.                        |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 6,500 % éch. 26/11/2038                              | € 1 200                             | 1 264                            | 0,08                      | 4,750 % éch. 20/09/2035                               | AUD 6 100                           | 3 566                            | 0,23                      | 31/07/2053                                         | £ 3 000                             | 1 528                            | 0,10                   |
| Fonds européen de stabilité financière               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais    |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 2,875 % éch. 13/02/2034                              | 24 300                              | 24 053                           | 1,53                      | 5,125 % éch. 18/09/2034                               | \$ 8 800                            | 7 744                            | 0,49                      | 22/10/2031                                         | 24 100                              | 27 531                           | 1,75                   |
| Union européenne                                     |                                     |                                  |                           | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT                     |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch.                                       |                                     |                                  |                        |
| 0,450 % éch. 04/07/2041                              | 8 600                               | 5 467                            | 0,35                      | 3,375 % éch. 15/06/2040                               | € 7 100                             | 6 966                            | 0,44                      | 07/03/2031                                         | 34 700                              | 39 984                           | 2,54                   |
| 0,450 % éch. 02/05/2046                              | 930                                 | 508                              | 0,03                      | 3,875 % éch. 15/02/2030                               | 18 800                              | 19 600                           | 1,24                      |                                                    |                                     | 990 704                          | 62,81                  |
| 0,750 % éch. 04/01/2047                              | 1 600                               | 928                              | 0,06                      | Queensland Treasury Corp.                             |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                       | € 1 866 721                         | 118,35                           |                        |
| 2,500 % éch. 04/10/2052                              | 2 100                               | 1 595                            | 0,10                      | 2,000 % éch. 22/08/2033                               | AUD 4 000                           | 1 988                            | 0,13                      | ACTIONS                                            |                                     |                                  |                        |
| 2,625 % éch. 04/02/2048                              | 2 000                               | 1 635                            | 0,10                      | 4,500 % éch. 22/08/2035                               | 5 000                               | 2 866                            | 0,18                      | FONDS D'INVESTISSEMENT                             |                                     |                                  |                        |
| 3,250 % éch. 04/07/2034                              | 10 300                              | 10 428                           | 0,66                      | République d'Allemagne                                |                                     |                                  |                           | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE                           |                                     |                                  |                        |
| 3,250 % éch. 12/12/2036                              | 3 100                               | 3 085                            | 0,20                      | 0,000 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds                             |                                     |                                  |                        |
| 3,250 % éch. 04/02/2050                              | 29 600                              | 26 469                           | 1,68                      | 15/08/2050 (c)(i)                                     | € 700                               | 312                              | 0,02                      | PIMCO Advantage                                    |                                     |                                  |                        |
| 3,375 % éch. 12/12/2035 (h)                          | 3 200                               | 3 246                            | 0,21                      | Obligation internationale du gouvernement roumain     |                                     |                                  |                           | Euro Government                                    |                                     |                                  |                        |
| 3,375 % éch. 04/10/2039 (h)                          | 5 800                               | 5 690                            | 0,36                      | 2,000 % éch. 28/01/2032                               | 8 800                               | 7 639                            | 0,48                      | Bond UCITS ETF (f)                                 | 648 658                             | 16 248                           | 1,03                   |
| 3,375 % éch. 04/11/2042                              | 1 550                               | 1 483                            | 0,09                      | 3,750 % éch. 07/02/2034                               | 4 500                               | 4 072                            | 0,26                      | PIMCO ETFs plc - Fonds                             |                                     |                                  |                        |
| 3,375 % éch. 05/10/2054                              | 500                                 | 447                              | 0,03                      | 5,625 % éch. 22/02/2036                               | 4 000                               | 4 033                            | 0,26                      | PIMCO Advantage                                    |                                     |                                  |                        |
| 3,625 % éch. 12/12/2040                              | 10 100                              | 10 080                           | 0,64                      | 5,625 % éch. 30/05/2037 (h)                           | 1 900                               | 1 875                            | 0,12                      | Global Government                                  |                                     |                                  |                        |
| 4,000 % éch. 12/10/2055                              | 19 600                              | 19 536                           | 1,24                      | 6,375 % éch. 30/01/2034                               | \$ 6 400                            | 5 674                            | 0,36                      | Bond UCITS ETF (f)                                 | 70 000                              | 1 741                            | 0,11                   |
| Obligation internationale du gouvernement finlandais |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 11/07/2039                               | € 900                               | 955                              | 0,06                      | PIMCO ETFs plc - Fonds                             |                                     |                                  |                        |
| 2,625 % éch. 04/07/2042                              | 6 800                               | 6 026                            | 0,38                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien    |                                     |                                  |                           | PIMCO Euro Short                                   |                                     |                                  |                        |
| 2,750 % éch. 15/04/2038                              | 8 100                               | 7 634                            | 0,48                      | 3,250 % éch. 22/10/2030                               | \$ 3 400                            | 2 801                            | 0,18                      | Maturity UCITS ETF (f)                             | 288 353                             | 30 966                           | 1,96                   |
| 2,950 % éch. 15/04/2055                              | 5 000                               | 4 262                            | 0,27                      | 5,000 % éch. 16/01/2034                               | 10 500                              | 9 196                            | 0,58                      | Total des Fonds d'investissement                   | € 48 955                            | 3,10                             |                        |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 13/01/2031                               | 2 000                               | 1 786                            | 0,11                      |                                                    |                                     |                                  |                        |
|                                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement slovène     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                        |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 1,175 % éch. 13/02/2062                               | € 3 310                             | 1 594                            | 0,10                      |                                                    |                                     |                                  |                        |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 10/03/2034                               | 700                                 | 699                              | 0,04                      |                                                    |                                     |                                  |                        |



## Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| COM                                   | 2,270 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | € 7 000              | Bpifrance SACA 1,000 % échéance 25/05/2027 | € (7 288)        | € 7 000                                  | € 7 000                                                            | 0,44                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                            | € (7 288)        | € 7 000                                  | € 7 000                                                            | 0,44                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026           | 224                | € (207)                           | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Long  | 09/2026           | 701                | 455                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 359                | 307                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026           | 1 256              | 1 607                             | 0,10                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 243                | (484)                             | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Long  | 09/2026           | 19                 | 7                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026           | 3 236              | 250                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 14                 | (1)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 1 119              | 720                               | 0,04                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026           | 1 452              | (1 635)                           | (0,10)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 12                 | 25                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 350                | 403                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Court | 09/2026           | 47                 | (54)                              | 0,00                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | € 1 393                           | 0,09                |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                   | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor septembre 2026 | € 97,625        | 14/09/2026        | 1 052              | € (246) | € (46)       | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé    |                 |                   |                    |         | € 1 347      | 0,09                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice iTraxx Europe Main 44 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | € 19 800                         | € 23                              | 0,00                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 87 670                           | 265                               | 0,02                |
|                                            |                      |                 |                                  | € 288                             | 0,02                |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000 %   | 16/09/2036      | £ 5 300           | € 30                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/03/2036      | ¥ 3 459 200       | 668                               | 0,04                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,865     | 13/02/2054      | \$ 300            | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2027      | 36 600            | (521)                             | (0,03)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 226 480           | 3 535                             | 0,22                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 16 600            | 670                               | 0,04                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 5 300             | 216                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 75 330            | (241)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 23 100            | 301                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 8 200             | (222)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 12 000            | 195                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,075     | 15/11/2053      | 10 886            | 135                               | 0,01                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | € 6 920           | 31                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 28 400            | 156                               | 0,01                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2076      | 3 500             | (28)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                           | 2,364     | 10/05/2028      | \$ 20 400         | 17                                | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | € 4 939                           | 0,31                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | € 5 227                           | 0,33                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et qu'un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant égal au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou

(ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

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

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

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

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

#### OPTIONS VENDUES

##### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,440 %         | 25/01/2027        | 6 200                            | € (52)    | € (8)        | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,440           | 25/01/2027        | 6 200                            | (52)      | (43)         | 0,00                |
| CBK          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 188 700                          | (589)     | (721)        | (0,05)              |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,350           | 07/01/2027        | 22 100                           | (194)     | (23)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,350           | 07/01/2027        | 22 100                           | (194)     | (183)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,500           | 14/01/2027        | 40 200                           | (358)     | (69)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500           | 14/01/2027        | 40 200                           | (358)     | (246)        | (0,02)              |
| GST          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 62 300                           | (184)     | (238)        | (0,01)              |
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 27/08/2026        | 19 100                           | (95)      | (78)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 19 100                           | (95)      | (26)         | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | € (2 171) | € (1 635)    | (0,10)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer |             | Devise<br>à recevoir |           | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|-------------|----------------------|-----------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| AZD          | 07/2026              | CNH                | 1 828       | \$                   | 271       | € 1                   | € 0                      | € 1                                           | 0,00                   |
| BOA          | 07/2026              | SGD                | 2 884       |                      | 2 262     | 28                    | 0                        | 28                                            | 0,00                   |
|              | 07/2026              | BRL                | 209         |                      | 40        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | DKK                | 72 680      | €                    | 9 730     | 7                     | 0                        | 7                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 1 757       | £                    | 1 519     | 7                     | 0                        | 7                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | KRW                | 177 001     | \$                   | 116       | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | NOK                | 208         |                      | 22        | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | SGD                | 30 236      |                      | 23 676    | 262                   | 0                        | 262                                           | 0,02                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 1 500       | CNH                  | 10 143    | 0                     | (5)                      | (5)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 34          | INR                  | 3 252     | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 152         | PLN                  | 575       | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
| BPS          | 08/2026              | ILS                | 2 989       | \$                   | 1 005     | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$                 | 22 346      | BRL                  | 114 156   | 0                     | (404)                    | (404)                                         | (0,03)                 |
|              | 09/2026              | INR                | 3 274       | \$                   | 34        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | MXN                | 3 386       |                      | 191       | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 573         | INR                  | 54 420    | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 01/2027              | DKK                | 18 597      | €                    | 2 499     | 6                     | 0                        | 6                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | AUD                | 42          |                      | 25        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | BRL                | 4 589       | \$                   | 887       | 2                     | (2)                      | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CHF                | 1 730       | €                    | 1 878     | 2                     | 0                        | 2                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CNH                | 11 606      | \$                   | 1 715     | 5                     | 0                        | 5                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CNY                | 440         |                      | 65        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 934         |                      | 1 080     | 10                    | 0                        | 10                                            | 0,00                   |
|              | 07/2026              | £                  | 863         | €                    | 997       | 0                     | (5)                      | (5)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | IDR                | 171 208 173 | \$                   | 9 554     | 7                     | (5)                      | 2                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | ILS                | 4 063       |                      | 1 378     | 12                    | 0                        | 12                                            | 0,00                   |
|              | 07/2026              | INR                | 323 086     |                      | 3 364     | 0                     | (43)                     | (43)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              | KRW                | 757 392     |                      | 497       | 7                     | 0                        | 7                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | NOK                | 2 190       | €                    | 195       | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | THB                | 44 800      | \$                   | 1 366     | 16                    | (2)                      | 14                                            | 0,00                   |
|              | 07/2026              | TRY                | 35 665      |                      | 750       | 0                     | (7)                      | (7)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 207         | BRL                  | 1 044     | 0                     | (5)                      | (5)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 33          | CZK                  | 691       | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 9 208       | INR                  | 872 987   | 16                    | (15)                     | 1                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 2 235       | KRW                  | 3 427 422 | 0                     | (18)                     | (18)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 6 198       | TRY                  | 296 400   | 71                    | 0                        | 71                                            | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 34          | TWD                  | 1 060     | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 456         | ZAR                  | 7 487     | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | €                  | 25          | AUD                  | 42        | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | ILS                | 580         | \$                   | 194       | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$                 | 1 333       | BRL                  | 6 791     | 0                     | (28)                     | (28)                                          | 0,00                   |
| 09/2026      | IDR                  | 19 430 009         | \$          | 1 070                | 0         | (6)                   | (6)                      | 0,00                                          |                        |
| 09/2026      | THB                  | 40 371             |             | 1 245                | 19        | 0                     | 19                       | 0,00                                          |                        |
| 09/2026      | \$                   | 5 516              | IDR         | 97 882 808           | 6         | (85)                  | (79)                     | (0,01)                                        |                        |
| 09/2026      |                      | 592                | INR         | 56 276               | 0         | (2)                   | (2)                      | 0,00                                          |                        |
| 09/2026      |                      | 249                | THB         | 8 171                | 0         | (2)                   | (2)                      | 0,00                                          |                        |
| 12/2026      |                      | 681                | IDR         | 12 398 845           | 2         | 0                     | 2                        | 0,00                                          |                        |
| 01/2027      | DKK                  | 7 303              | €           | 981                  | 2         | 0                     | 2                        | 0,00                                          |                        |

## Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

|              | Mois         | Devise   |            | Devise     |            | Plus-value | (Moins-value) | Plus-value/   |         |
|--------------|--------------|----------|------------|------------|------------|------------|---------------|---------------|---------|
| Contrepartie | de règlement | à livrer |            | à recevoir |            | latente    | latente       | (moins-value) | En % de |
| BRC          | 07/2026      | AUD      | 33 358     | €          | 20 422     | €          | 208           | €             | 208     |
|              | 07/2026      | €        | 1 286      | NZD        | 2 588      |            | 1             | €             | 1       |
|              | 07/2026      |          | 2 609      | \$         | 3 045      |            | 54            |               | 54      |
|              | 07/2026      | ILS      | 4 963      |            | 1 677      |            | 9             |               | 9       |
|              | 07/2026      | NOK      | 5 112      | €          | 456        |            | 4             |               | 4       |
|              | 07/2026      | TRY      | 21 812     | \$         | 459        |            | 0             | (3)           | (3)     |
|              | 07/2026      | \$       | 2 276      | ZAR        | 36 974     |            | 0             | (21)          | (21)    |
|              | 08/2026      | CAD      | 9 001      | €          | 5 548      |            | 0             | (1)           | (1)     |
|              | 08/2026      | €        | 60         | NOK        | 678        |            | 0             |               | 0       |
| CBK          | 07/2026      | CHF      | 1 689      | €          | 1 855      |            | 24            | 0             | 24      |
|              | 07/2026      | €        | 11 244     | £          | 9 759      |            | 86            | 0             | 86      |
|              | 07/2026      |          | 613        | NOK        | 6 637      |            | 0             | (26)          | (26)    |
|              | 07/2026      |          | 5 318      | \$         | 6 195      |            | 100           | 0             | 100     |
|              | 07/2026      | ILS      | 15 584     |            | 5 360      |            | 112           | 0             | 112     |
|              | 07/2026      | INR      | 177 195    |            | 1 878      |            | 5             | 0             | 5       |
|              | 07/2026      | \$       | 1 870      | IDR        | 33 548 986 |            | 3             | 0             | 3       |
|              | 07/2026      |          | 1 829      | INR        | 177 195    |            | 38            | 0             | 38      |
|              | 07/2026      |          | 247        | KRW        | 373 378    |            | 0             | (5)           | (5)     |
|              | 07/2026      |          | 1 816      | PLN        | 6 706      |            | 0             | (28)          | (28)    |
|              | 07/2026      |          | 12         | TWD        | 380        |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 08/2026      | ILS      | 6 647      | \$         | 2 289      |            | 49            | 0             | 49      |
|              | 08/2026      | \$       | 485        | ILS        | 1 440      |            | 0             | (1)           | (1)     |
|              | 09/2026      | IDR      | 71 191 201 | \$         | 3 944      |            | 0             | (2)           | (2)     |
|              | 09/2026      | INR      | 22 102     |            | 230        |            | 0             | (2)           | (2)     |
|              | 09/2026      | THB      | 47 685     |            | 1 440      |            | 0             | (4)           | (4)     |
|              | 09/2026      | \$       | 1 375      | IDR        | 24 521 090 |            | 0             | (14)          | (14)    |
|              | 09/2026      |          | 10         | INR        | 975        |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 09/2026      |          | 674        | MXN        | 12 060     |            | 10            | 0             | 10      |
|              | 12/2026      |          | 2 074      | IDR        | 37 699 548 |            | 2             | 0             | 2       |
|              | 01/2027      | DKK      | 11 500     | €          | 1 545      |            | 4             | 0             | 4       |
| DUB          | 07/2026      | IDR      | 4 497 863  | \$         | 251        |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 07/2026      | INR      | 68 107     |            | 721        |            | 2             | 0             | 2       |
|              | 07/2026      | NOK      | 515        |            | 55         |            | 3             | 0             | 3       |
|              | 07/2026      | SGD      | 3 464      |            | 2 716      |            | 33            | 0             | 33      |
|              | 07/2026      | \$       | 3 337      | CNH        | 22 699     |            | 6             | 0             | 6       |
|              | 07/2026      |          | 36         | CZK        | 747        |            | 0             | (1)           | (1)     |
|              | 07/2026      |          | 481        | INR        | 46 424     |            | 7             | 0             | 7       |
|              | 07/2026      |          | 885        | PLN        | 3 284      |            | 0             | (10)          | (10)    |
|              | 07/2026      |          | 1 062      | ZAR        | 17 193     |            | 0             | (13)          | (13)    |
|              | 08/2026      | CNH      | 22 649     | \$         | 3 337      |            | 0             | (6)           | (6)     |
|              | 09/2026      | IDR      | 43 204 023 |            | 2 398      |            | 3             | 0             | 3       |
|              | 09/2026      | \$       | 844        | IDR        | 15 325 036 |            | 5             | 0             | 5       |
|              | 09/2026      |          | 721        | INR        | 68 568     |            | 0             | (2)           | (2)     |
| GLM          | 07/2026      | KRW      | 713 525    | \$         | 462        |            | 1             | 0             | 1       |
|              | 07/2026      | \$       | 3 611      | BRL        | 18 883     |            | 68            | (35)          | 33      |
|              | 07/2026      |          | 1 784      | IDR        | 31 988 572 |            | 4             | 0             | 4       |
|              | 07/2026      |          | 462        | KRW        | 713 423    |            | 0             | (1)           | (1)     |
|              | 07/2026      |          | 599        | TRY        | 28 434     |            | 7             | 0             | 7       |
|              | 07/2026      |          | 1 488      | ZAR        | 24 490     |            | 3             | 0             | 3       |
|              | 08/2026      |          | 2 168      | BRL        | 11 080     |            | 0             | (39)          | (39)    |
|              | 08/2026      |          | 470        | INR        | 45 058     |            | 4             | 0             | 4       |
|              | 09/2026      | IDR      | 32 175 901 | \$         | 1 784      |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 09/2026      | THB      | 119 493    |            | 3 703      |            | 73            | 0             | 73      |
|              | 09/2026      | \$       | 2 887      | BRL        | 14 860     |            | 0             | (51)          | (51)    |
|              | 09/2026      |          | 3 936      | IDR        | 70 675 553 |            | 7             | (23)          | (16)    |
|              | 09/2026      |          | 4 014      | INR        | 386 746    |            | 39            | 0             | 39      |
|              | 09/2026      |          | 5 288      | MXN        | 92 733     |            | 0             | (12)          | (12)    |
| JPM          | 07/2026      | BRL      | 17 025     | \$         | 3 308      |            | 17            | 0             | 17      |
|              | 07/2026      | DKK      | 8 252      | €          | 1 105      |            | 1             | 0             | 1       |
|              | 07/2026      | €        | 5 654      | CHF        | 5 213      |            | 0             | (1)           | (1)     |
|              | 07/2026      |          | 3 975      | DKK        | 29 715     |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 07/2026      |          | 1 308      | NOK        | 14 085     |            | 0             | (63)          | (63)    |
|              | 07/2026      |          | 113        | SEK        | 1 251      |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 07/2026      | ILS      | 12 727     | \$         | 4 262      |            | 0             | (9)           | (9)     |
|              | 07/2026      | INR      | 113 470    |            | 1 203      |            | 3             | 0             | 3       |
|              | 07/2026      | ¥        | 62 664     | €          | 339        |            | 2             | 0             | 2       |
|              | 07/2026      | KRW      | 220 484    | \$         | 142        |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 07/2026      | NOK      | 13 344     | €          | 1 201      |            | 21            | 0             | 21      |
|              | 07/2026      | NZD      | 20 922     |            | 10 705     |            | 295           | 0             | 295     |
|              | 07/2026      | \$       | 4 410      |            | 3 795      |            | 0             | (62)          | (62)    |
|              | 07/2026      |          | 274        | IDR        | 4 919 077  |            | 1             | 0             | 1       |
|              | 07/2026      |          | 1 929      | ILS        | 5 462      |            | 0             | (83)          | (83)    |
|              | 07/2026      |          | 1 202      | INR        | 113 470    |            | 0             | (3)           | (3)     |
|              | 07/2026      |          | 215        | KRW        | 330 028    |            | 0             | (2)           | (2)     |
|              | 07/2026      |          | 148        | NOK        | 1 461      |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 07/2026      |          | 9 616      | PLN        | 35 061     |            | 1             | (253)         | (252)   |
|              | 07/2026      |          | 991        | THB        | 33 127     |            | 6             | 0             | 6       |
|              | 08/2026      | CHF      | 5 213      | €          | 5 667      |            | 1             | 0             | 1       |
|              | 08/2026      | DKK      | 29 704     |            | 3 975      |            | 0             | 0             | 0       |
|              | 08/2026      | €        | 85         | ¥          | 15 642     |            | 0             | (1)           | (1)     |
|              | 08/2026      |          | 766        | NOK        | 8 665      |            | 0             | (2)           | (2)     |
|              | 08/2026      | ILS      | 12 322     | \$         | 4 231      |            | 80            | 0             | 80      |

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| MBC          | 08/2026              | NOK                | 1 461                | \$ 148                | € 0                      | € 0                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | SEK                | 1 250                | € 113                 | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | IDR                | 4 946 413            | \$ 274                | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | INR                | 114 267              | 1 202                 | 2                        | 2                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | MXN                | 8 545                | 485                   | 1                        | (2)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | THB                | 94 998               | 2 910                 | 37                       | (9)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 3 054                | INR 291 351           | 2                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              |                    | 20 624               | MXN 358 492           | 0                        | (207)                                         | (0,01)                 |
|              | 10/2026              |                    | 3 308                | BRL 17 400            | 0                        | (17)                                          | 0,00                   |
|              | 12/2026              | MXN                | 1 268                | \$ 72                 | 1                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 12/2026              | \$                 | 1 491                | MXN 26 312            | 0                        | (4)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | DKK                | 18 317               | € 2 452               | 1                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 887                  | AUD 1 445             | 0                        | (11)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              | £                  | 7 242                | € 8 345               | 0                        | (63)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              | IDR                | 439 130              | \$ 25                 | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | INR                | 68 376               | 724                   | 2                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | KRW                | 3 046 602            | 2 010                 | 37                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | NOK                | 1 225                | 132                   | 7                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | NZD                | 7 014                | € 3 570               | 80                       | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 600                  | CHF 470               | 0                        | (15)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 4 205                | € 3 699               | 21                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 1 116                | INR 107 606           | 16                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 47                   | NOK 471               | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | NOK                | 471                  | \$ 47                 | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
| MYI          | 09/2026              | THB                | 27 495               | 823                   | 0                        | (8)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 3 013                | INR 288 228           | 12                       | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CHF                | 1 298                | € 1 419               | 11                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 1 062                | AUD 1 749             | 0                        | (3)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 65 159               | £ 56 261              | 154                      | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              |                    | 7 220                | \$ 8 399              | 126                      | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              | NZD                | 1 137                | € 577                 | 12                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | SEK                | 1 275                | 118                   | 3                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 3 363                | 2 911                 | 0                        | (30)                                          | 0,00                   |
|              | 08/2026              | £                  | 50 115               | 57 980                | 0                        | (119)                                         | (0,01)                 |
| NSL          | 07/2026              | \$                 | 1 661                | IDR 29 609 267        | 0                        | (4)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 1 129                | INR 108 606           | 15                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | IDR                | 29 775 322           | \$ 1 661              | 9                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 841                  | IDR 14 970 655        | 0                        | (10)                                          | 0,00                   |
| RYL<br>SCX   | 07/2026              | €                  | 1 202                | \$ 1 401              | 23                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | AUD                | 44 997               | € 27 531              | 264                      | 0                                             | 0,02                   |
|              | 07/2026              | CAD                | 26 456               | 16 424                | 114                      | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              | CNY                | 1 031                | \$ 151                | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
| SOG          | 07/2026              | €                  | 45 479               | AUD 75 203            | 91                       | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              |                    | 4 225                | DKK 31 580            | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | ¥                  | 403 333              | € 2 181               | 11                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 636                  | IDR 11 409 557        | 1                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 1 486                | INR 142 410           | 15                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | AUD                | 75 352               | € 45 479              | 0                        | (96)                                          | (0,01)                 |
|              | 08/2026              | DKK                | 31 567               | 4 225                 | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | €                  | 815                  | ¥ 149 976             | 0                        | (7)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$                 | 1 168                | INR 111 916           | 8                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | IDR                | 34 002 199           | \$ 1 884              | 0                        | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 09/2026              | THB                | 42 537               | 1 317                 | 25                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | \$                 | 2 145                | IDR 38 504 640        | 3                        | (12)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CHF                | 10 214               | € 11 168              | 93                       | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              |                    | 470                  | \$ 581                | 0                        | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | CNH                | 19 420               | 2 871                 | 9                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 7 609                | CAD 12 323            | 0                        | (12)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 70 182               | £ 60 544              | 103                      | 0                                             | 0,01                   |
|              | 07/2026              |                    | 181 890              | \$ 206 909            | 0                        | (915)                                         | (0,06)                 |
|              | 07/2026              | £                  | 129 984              | € 149 856             | 0                        | (1 042)                                       | (0,07)                 |
|              | 07/2026              | SGD                | 54                   | \$ 42                 | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 222 257              | € 190 528             | 0                        | (3 871)                                       | (0,25)                 |
|              | 07/2026              |                    | 28 292               | SGD 36 638            | 30                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | CAD                | 12 322               | € 7 609               | 12                       | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | £                  | 60 627               | 70 182                | 0                        | (104)                                         | (0,01)                 |
|              | 08/2026              | SGD                | 36 556               | \$ 28 292             | 0                        | (31)                                          | 0,00                   |
| SSB          | 08/2026              | \$                 | 581                  | CHF 468               | 2                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              |                    | 207 190              | € 181 890             | 912                      | 0                                             | 0,06                   |
|              | 08/2026              |                    | 42                   | SGD 54                | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 10 545               | CHF 9 718             | 0                        | (8)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 1 120                | ¥ 205 900             | 0                        | (12)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              |                    | 1 760                | \$ 2 000              | 0                        | (10)                                          | 0,00                   |
|              | 08/2026              | CHF                | 9 718                | € 10 569              | 8                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | €                  | 4 549                | DKK 34 006            | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
| UAG          | 07/2026              |                    | 1 433                | ¥ 265 100             | 0                        | (6)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | ¥                  | 1 723                | € 9                   | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$                 | 846                  | PLN 3 091             | 0                        | (21)                                          | 0,00                   |
|              | 08/2026              | DKK                | 33 992               | € 4 549               | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | €                  | 9                    | ¥ 1 723               | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | MXN                | 3 649                | \$ 208                | 1                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 09/2026              | THB                | 5 447                | 166                   | 1                        | 0                                             | 0,00                   |
|              |                      |                    |                      | € 4 171               | € (8 070)                | € (3 899)                                     | (0,25)                 |

## Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |           |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|-----------|--------|
| CBK          | 07/2026              | €                  | 22 625               | CHF                   | 20 595                   | € 0                                           | € (294)                | € (294)   | (0,02) |
| JPM          | 07/2026              | CHF                | 93 650               | €                     | 101 570                  | 24                                            | 0                      | 24        | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 46 379               | CHF                   | 42 127                   | 0                                             | (700)                  | (700)     | (0,04) |
|              | 08/2026              |                    | 101 799              |                       | 93 650                   | 0                                             | (23)                   | (23)      | 0,00   |
| MBC          | 07/2026              |                    | 101 744              |                       | 92 909                   | 0                                             | (1 002)                | (1 002)   | (0,06) |
| MYI          | 07/2026              | CHF                | 54                   | €                     | 59                       | 0                                             | 0                      | 0         | 0,00   |
|              | 07/2026              | €                  | 10                   | CHF                   | 9                        | 0                                             | 0                      | 0         | 0,00   |
| SOG          | 07/2026              |                    | 128 017              |                       | 116 968                  | 0                                             | (1 186)                | (1 186)   | (0,08) |
| SSB          | 07/2026              | CHF                | 62 011               | €                     | 67 290                   | 51                                            | 0                      | 51        | 0,00   |
|              | 08/2026              | €                  | 67 441               | CHF                   | 62 011                   | 0                                             | (49)                   | (49)      | 0,00   |
| UAG          | 07/2026              |                    | 558                  |                       | 516                      | 1                                             | 0                      | 1         | 0,00   |
|              |                      |                    |                      |                       |                          | € 76                                          | € (3 254)              | € (3 178) | (0,20) |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ (8 712) (0,55)

| DESCRIPTION                            | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>        |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim             | \$ 9 500                      | € 2 929                    | 0,19                |
| Total des Autres actifs financiers     |                               | € 2 929                    | 0,19                |
| Total des Investissements              |                               | € 1 923 467                | 121,95              |
| Autres actifs et passifs à court terme |                               | € (346 168)                | (21,95)             |
| Actif net                              |                               | € 1 577 299                | 100,00              |

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

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

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

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

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 211 329 € (31 décembre 2025 : 190 147 €) et un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2025 : 352 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 312 € (31 décembre 2025 : 303 €) et un montant en numéraire de 8 954 € (31 décembre 2025 : 1 030 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 883 € (31 décembre 2025 : 0 €) et un montant en numéraire de 797 € (31 décembre 2025 : 0 €) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 25 701 € (31 décembre 2025 : 22 274 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 1 845 280                                          | € 21 441                                          | € 1 866 721  |
| Fonds d'investissement                        | 48 955                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 48 955       |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 7 000                                                | 0                                                 | 7 000        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 834                                                                             | (3 972)                                              | 0                                                 | (2 138)      |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 2 929                                                | 0                                                 | 2 929        |
| Totaux                                        | € 50 789                                                                          | € 1 851 237                                          | € 21 441                                          | € 1 923 467  |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur       |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 135                                                                             | € 1 871 097                                          | € 21 183                                          | € 1 892 415        |
| Fonds d'investissement                        | 3 754                                                                             | 65 386                                               | 0                                                 | 69 140             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 18 500                                               | 0                                                 | 18 500             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (3 427)                                                                           | 7 261                                                | 0                                                 | 3 834              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 2 386                                                | 0                                                 | 2 386              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 462</b>                                                                      | <b>€ 1 964 630</b>                                   | <b>€ 21 183</b>                                   | <b>€ 1 986 275</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 0,750 %        | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (485)         | € (426)                                  | (0,03)              |
|                                               | 2,300          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | € (27 469)       | (27 505)                                 | (1,74)              |
| BRC                                           | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (787)            | (788)                                    | (0,05)              |
|                                               | 2,070          | 06/05/2026        | 10/07/2026         | (2 811)          | (2 820)                                  | (0,18)              |
|                                               | 2,070          | 15/05/2026        | 10/07/2026         | (19 857)         | (19 910)                                 | (1,26)              |
|                                               | 2,280          | 16/06/2026        | 29/07/2026         | (5 764)          | (5 770)                                  | (0,37)              |
|                                               | 2,290          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (13 893)         | (13 911)                                 | (0,88)              |
|                                               | 2,310          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (29 360)         | (29 399)                                 | (1,86)              |
| COM                                           | 2,150          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (9 478)          | (9 485)                                  | (0,60)              |
|                                               | 2,180          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (3 304)          | (3 305)                                  | (0,21)              |
|                                               | 2,260          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (15 035)         | (15 055)                                 | (0,95)              |
| JML                                           | 2,060          | 06/05/2026        | 10/07/2026         | (33 099)         | (33 205)                                 | (2,11)              |
|                                               | 2,270          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (40 712)         | (40 766)                                 | (2,59)              |
| MEI                                           | 2,280          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (9 025)          | (9 037)                                  | (0,57)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>€ (211 382)</b>                       | <b>(13,40)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | € 29                                                       | € 0                     | € 29                              | € S/O                                                      | € S/O                   | € S/O                             |
| BOA          | (124)                                                      | 103                     | (21)                              | 80                                                         | (260)                   | (180)                             |
| BPS          | (48)                                                       | 0                       | (48)                              | 282                                                        | (260)                   | 22                                |
| BRC          | 200                                                        | (320)                   | (120)                             | 168                                                        | 0                       | 168                               |
| CBK          | (664)                                                      | 830                     | 166                               | 38                                                         | 280                     | 318                               |
| DUB          | 27                                                         | 0                       | 27                                | 245                                                        | 0                       | 245                               |
| GLM          | (476)                                                      | (680)                   | (1 156)                           | (247)                                                      | (750)                   | (997)                             |
| GST          | (238)                                                      | 231                     | (7)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (946)                                                      | 941                     | (5)                               | (628)                                                      | 510                     | (118)                             |
| MBC          | (926)                                                      | 869                     | (57)                              | (45)                                                       | 0                       | (45)                              |
| MYI          | 154                                                        | 0                       | 154                               | 11                                                         | 0                       | 11                                |
| NSL          | 10                                                         | 0                       | 10                                | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (104)                                                      | 0                       | (104)                             |
| RYL          | 23                                                         | 0                       | 23                                | 536                                                        | (570)                   | (34)                              |
| SCX          | 416                                                        | (580)                   | (164)                             | (644)                                                      | 543                     | (101)                             |
| SOG          | (6 105)                                                    | 6 292                   | 187                               | 2 608                                                      | (3 460)                 | (852)                             |
| USB          | (20)                                                       | 0                       | (20)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | (24)                                                       | 0                       | (24)                              | 68                                                         | 0                       | 68                                |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 64,31            | 59,27                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 18,41            | 20,69                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,69             | 1,66                 |
| Fonds d'investissement                                           | 2,21             | 2,98                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,32             | 0,80                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,17             | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,28             | 0,27                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,19             | 0,30                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,13             | 0,10                 |
| Autres actifs                                                    | 12,29            | 13,87                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                       | 0,28             | 0,32                 |
| Obligations et billets privés                                                                         | 17,77            | 25,74                |
| Agences du gouvernement américain                                                                     | 13,85            | 14,52                |
| Obligations du Trésor américain                                                                       | 4,17             | 2,85                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux               | 6,95             | 10,19                |
| Titres adossés à des actifs                                                                           | 12,52            | 15,46                |
| Émissions souveraines                                                                                 | 62,81            | 45,46                |
| Titres privilégiés                                                                                    | S/O              | 0,01                 |
| Instruments à court terme                                                                             | S/O              | 1,24                 |
| Fonds d'investissement                                                                                | 3,10             | 4,23                 |
| Contrats de mise en pension                                                                           | 0,44             | 1,13                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | 0,09             | (0,20)               |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | 0,00             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                              |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                      | 0,02             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                               | 0,31             | 0,28                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                              |                  |                      |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                           | (0,10)           | (0,08)               |
| Contrats de change à terme                                                                            | (0,25)           | 0,21                 |
| Contrats de change à terme couverts                                                                   | (0,20)           | 0,01                 |
| Autres actifs financiers                                                                              | 0,19             | 0,15                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                | (21,95)          | (21,53)              |
| Actif net                                                                                             | 100,00           | 100,00               |



| DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)     | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |       |       |      |
|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------|-------|-------|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                        |                                     |                                  |                           | Citycon Treasury BV                                   | 6,500 % éch. 08/03/2029             | € 600                            | € 614                     | 0,12                    | Jyske Realkredit A/S                 | 0,500 % éch. 01/10/2043              | DKK 0                     | € 0   | 0,00  |      |
| BANQUE ET FINANCE                                                    |                                     |                                  |                           | Commerzbank AG                                        | 6,500 % éch. 06/12/2032             | 1 000                            | 1 037                     | 0,20                    | 1,000 % éch. 01/10/2050              | 0                                    | 0                         | 0     | 0,00  |      |
| 365 bank A/S                                                         |                                     |                                  |                           | Commonwealth Bank of Australia                        | 4,266 % éch. 04/06/2034             | 1 700                            | 1 738                     | 0,33                    | 1,000 % éch. 01/10/2053              | 0                                    | 0                         | 0     | 0,00  |      |
| 7,125 % éch. 04/07/2028                                              | € 1 300                             | € 1 347                          | 0,26                      | Covea Cooperations SACA                               | 4,500 % éch. 10/06/2056             | 400                              | 404                       | 0,08                    | 1,500 % éch. 01/10/2037              | 0                                    | 0                         | 0     | 0,00  |      |
| ABN AMRO Bank NV                                                     |                                     |                                  |                           | CPI Property Group S.A.                               | 6,875 % éch. 05/02/2033             | £ 900                            | 975                       | 0,19                    | 1,500 % éch. 01/10/2050              | 0                                    | 0                         | 0     | 0,00  |      |
| 3,000 % éch. 22/09/2032                                              | 1 200                               | 1 181                            | 0,22                      | Crédit Agricole S.A.                                  | 4,250 % éch. 11/07/2029             | € 1 500                          | 1 532                     | 0,29                    | Komerční Banka A/S                   | € 3,250 % éch. 10/10/2031            | 500                       | 504   | 0,10  |      |
| Akelius Residential Property AB                                      |                                     |                                  |                           | Crédit Mutuel Home Loan SFH S.A.                      | 2,625 % éch. 06/06/2030             | 1 100                            | 1 087                     | 0,21                    | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau      | 0,000 % éch. 15/09/2028 (c)          | 1 300                     | 1 228 | 0,23  |      |
| 3,950 % éch. 25/03/2031                                              | 2 000                               | 2 002                            | 0,38                      | CTP NV                                                | 3,625 % éch. 13/04/2032             | 1 400                            | 1 385                     | 0,26                    | 2,500 % éch. 09/10/2030              | 600                                  | 595                       | 0,11  |       |      |
| Amvest RCF Custodian BV                                              |                                     |                                  |                           | Danske Bank A/S                                       | 4,750 % éch. 21/06/2030             | 700                              | 731                       | 0,14                    | 2,750 % éch. 15/05/2030              | 3 800                                | 3 807                     | 0,72  |       |      |
| 3,750 % éch. 11/06/2031                                              | 600                                 | 602                              | 0,11                      | Deutsche Bank AG                                      | 5,000 % éch. 05/09/2030             | 800                              | 838                       | 0,16                    | 2,875 % éch. 30/06/2031              | 1 000                                | 1 005                     | 0,19  |       |      |
| ARGAN S.A.                                                           |                                     |                                  |                           | Deutsche Boerse AG                                    | 3,250 % éch. 24/03/2031             | 600                              | 605                       | 0,11                    | 3,125 % éch. 07/06/2030              | 1 000                                | 1 015                     | 0,19  |       |      |
| 3,779 % éch. 30/10/2029                                              | 600                                 | 604                              | 0,11                      | DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH | 4,875 % éch. 21/08/2030             | 1 100                            | 1 124                     | 0,21                    | Landwirtschaftliche Rentenbank       | 2,625 % éch. 08/07/2032              | 1 500                     | 1 480 | 0,28  |      |
| Aviva PLC                                                            |                                     |                                  |                           | ELM BV for Swiss Prime Site AG                        | 3,125 % éch. 01/10/2031             | 600                              | 587                       | 0,11                    | Lloyds Bank GmbH                     | 2,875 % éch. 09/09/2032              | 1 000                     | 991   | 0,19  |      |
| 7,750 % éch. 30/09/2032 (e)(g)                                       | £ 600                               | 733                              | 0,14                      | Equinix Europe Financing Corp. LLC                    | 3,250 % éch. 19/05/2029             | 700                              | 700                       | 0,13                    | Lloyds Banking Group PLC             | 2,906 % éch. 04/03/2028              | 1 100                     | 1 103 | 0,21  |      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                                         |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/03/2031                               | 100                                 | 99                               | 0,02                      | 2,906 % éch. 04/03/2028 | 8,500 % éch. 27/09/2027              | £ 900                                | 1 082                     | 0,21  |       |      |
| 2,528 % éch. 18/11/2027                                              | \$ 76                               | 64                               | 0,01                      | Erste Group Bank AG                                   | 3,375 % éch. 13/05/2031             | 900                              | 903                       | 0,17                    | (e)(g)                               |                                      |                           |       |       |      |
| Balder Finland Oyj                                                   | € 800                               | 792                              | 0,15                      | Banque européenne d'investissement                    | 0,050 % éch. 13/10/2034             | 5 900                            | 4 661                     | 0,89                    | Lseg Netherlands BV                  | € 3,000 % éch. 06/11/2031            | 900                       | 884   | 0,17  |      |
| 1,000 % éch. 18/01/2027                                              |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 20/01/2032                               | 1 900                               | 1 654                            | 0,31                      | 3,000 % éch. 06/11/2031 | Lumo Kodit Oyj                       | € 4,000 % éch. 20/05/2030            | 800                       | 805   | 0,15  |      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                                  |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 17/02/2031                               | 500                                 | 495                              | 0,09                      | 4,000 % éch. 20/05/2030 | Mapfre S.A.                          | 4,500 % éch. 09/06/2037              | 100                       | 102   | 0,02  |      |
| 3,625 % éch. 27/11/2030                                              | 1 400                               | 1 415                            | 0,27                      | Fastighets AB Balder                                  | 3,625 % éch. 25/08/2031             | 1 200                            | 1 180                     | 0,22                    | 4,500 % éch. 09/06/2037              | mBank S.A.                           | 3,771 % éch. 03/03/2032   | 400   | 400   | 0,08 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 19/02/2032                               | 200                                 | 199                              | 0,04                      | 3,771 % éch. 03/03/2032 | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 3,856 % éch. 22/04/2034              | 600                       | 606   | 0,12  |      |
| 8,375 % éch. 21/06/2028 (e)(g)                                       | 1 000                               | 1 081                            | 0,21                      | First Abu Dhabi Bank PJSC                             | 3,530 % éch. 24/12/2029             | 1 700                            | 1 708                     | 0,32                    | 3,856 % éch. 22/04/2034              | Mizuho Financial Group, Inc.         | 3,210 % éch. 16/05/2032   | 3 200 | 3 167 | 0,60 |
| Banco di Desio e della Brianza SpA                                   |                                     |                                  |                           | 3,530 % éch. 24/12/2029                               | 1 700                               | 1 708                            | 0,32                      | 3,210 % éch. 16/05/2032 | Morgan Stanley                       | 3,149 % éch. 07/11/2031              | 1 200                     | 1 185 | 0,23  |      |
| 4,000 % éch. 13/03/2028                                              | 1 400                               | 1 426                            | 0,27                      | Ford Motor Credit Co. LLC                             | 3,622 % éch. 27/07/2028             | 1 000                            | 1 002                     | 0,19                    | 3,149 % éch. 07/11/2031              | 3,521 % éch. 22/05/2031              | 1 800                     | 1 808 | 0,34  |      |
| Banco Santander S.A.                                                 |                                     |                                  |                           | 4,970 % éch. 06/04/2029                               | \$ 1 300                            | 1 126                            | 0,21                      | 3,521 % éch. 22/05/2031 | 3,790 % éch. 21/03/2030              | 2 300                                | 2 333                     | 0,44  |       |      |
| 3,875 % éch. 22/04/2029                                              | 1 900                               | 1 938                            | 0,37                      | Galderma Finance Europe BV                            | 3,375 % éch. 17/03/2031             | € 400                            | 399                       | 0,08                    | 3,790 % éch. 21/03/2030              | National Australia Bank Ltd.         | 2,723 % éch. 27/08/2030   | 500   | 496   | 0,09 |
| 4,875 % éch. 18/10/2031                                              | 1 000                               | 1 070                            | 0,20                      | 3,375 % éch. 17/03/2031                               | € 400                               | 399                              | 0,08                      | 2,723 % éch. 27/08/2030 | Nationwide Building Society          | 3,750 % éch. 22/08/2028              | 500                       | 508   | 0,10  |      |
| 5,750 % éch. 23/08/2033                                              | 600                                 | 625                              | 0,12                      | 3,500 % éch. 20/03/2030                               | 1 200                               | 1 207                            | 0,23                      | 3,750 % éch. 22/08/2028 | 5,750 % éch. 20/06/2027              | 5,750 % éch. 20/06/2027              | £ 900                     | 1 046 | 0,20  |      |
| Bank of Ireland Group PLC                                            |                                     |                                  |                           | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                   | 3,875 % éch. 29/04/2033             | 1 000                            | 1 001                     | 0,19                    | (e)(g)                               |                                      |                           |       |       |      |
| 6,750 % éch. 01/03/2033                                              | 1 000                               | 1 046                            | 0,20                      | 3,875 % éch. 29/04/2033                               | 1 000                               | 1 001                            | 0,19                      | 5,125 % éch. 12/05/2027 | NatWest Group PLC                    | 5,125 % éch. 12/05/2027              | 900                       | 1 042 | 0,20  |      |
| Bank of Queensland Ltd.                                              |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 03/05/2030                               | 700                                 | 720                              | 0,14                      | (e)(g)                  | 7,300 % éch. 19/11/2034              | (e)(g)                               | \$ 1 000                  | 914   | 0,17  |      |
| 2,732 % éch. 18/06/2030                                              | 900                                 | 888                              | 0,17                      | Grainger PLC                                          | 3,375 % éch. 24/04/2028             | £ 800                            | 902                       | 0,17                    | 7,300 % éch. 19/11/2034              | NE Property BV                       | € 3,375 % éch. 14/07/2027 | € 356 | 356   | 0,07 |
| Bankinter S.A.                                                       |                                     |                                  |                           | GSG Bidco Ltd.                                        | 4,700 % éch. 15/06/2031             | € 2 800                          | 2 777                     | 0,53                    | 3,375 % éch. 14/07/2027              | New Immo Holding S.A.                | 6,000 % éch. 22/03/2029   | 1 000 | 1 030 | 0,20 |
| 3,625 % éch. 04/02/2033                                              | 400                                 | 400                              | 0,08                      | HLD Europe S.C.A.                                     | 4,250 % éch. 24/03/2032             | 1 000                            | 1 007                     | 0,19                    | 6,000 % éch. 22/03/2029              | NIBC Bank NV                         | 2,750 % éch. 26/03/2029   | 900   | 898   | 0,17 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.                              |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 24/03/2032                               | 1 000                               | 1 007                            | 0,19                      | 2,750 % éch. 26/03/2029 | NN Group NV                          | 6,000 % éch. 03/11/2043              | 450                       | 501   | 0,10  |      |
| 0,625 % éch. 19/11/2027                                              | 4 700                               | 4 560                            | 0,87                      | HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH                    | 3,875 % éch. 05/06/2030             | 700                              | 712                       | 0,14                    | 6,000 % éch. 03/11/2043              | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | 0,500 % éch. 01/10/2043   | DKK 0 | 0     | 0,00 |
| 3,500 % éch. 15/05/2031                                              | 300                                 | 302                              | 0,06                      | 3,875 % éch. 05/06/2030                               | 700                                 | 712                              | 0,14                      | 0,500 % éch. 01/10/2043 | 0,500 % éch. 01/10/2043              | 0,500 % éch. 01/10/2043              | 0                         | 0     | 0,00  |      |
| Barclays PLC                                                         |                                     |                                  |                           | Iccrea Banca SpA                                      | 2,625 % éch. 07/11/2031             | 600                              | 592                       | 0,11                    | 1,000 % éch. 01/10/2050              | 1,000 % éch. 01/10/2050              | 1,000 % éch. 01/10/2050   | 0     | 0     | 0,00 |
| 4,506 % éch. 31/01/2033                                              | 1 300                               | 1 356                            | 0,26                      | ING Bank NV                                           | 3,125 % éch. 08/04/2031             | 600                              | 605                       | 0,11                    | 1,000 % éch. 01/10/2053              | 1,000 % éch. 01/10/2053              | 1,000 % éch. 01/10/2053   | 0     | 0     | 0,00 |
| 4,918 % éch. 08/08/2030                                              | 900                                 | 941                              | 0,18                      | 3,125 % éch. 08/04/2031                               | 600                                 | 605                              | 0,11                      | 1,500 % éch. 01/10/2037 | 1,500 % éch. 01/10/2037              | 1,500 % éch. 01/10/2037              | 111                       | 14    | 0,00  |      |
| BGC Group, Inc.                                                      |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                                          | 3,125 % éch. 08/04/2031             | 600                              | 605                       | 0,11                    | 1,500 % éch. 01/10/2050              | 1,500 % éch. 01/10/2050              | 1,500 % éch. 01/10/2050   | 0     | 0     | 0,00 |
| 6,150 % éch. 02/04/2030                                              | \$ 900                              | 804                              | 0,15                      | 3,125 % éch. 08/04/2031                               | 600                                 | 605                              | 0,11                      | 2,500 % éch. 01/10/2047 | 2,500 % éch. 01/10/2047              | 2,500 % éch. 01/10/2047              | 0                         | 0     | 0,00  |      |
| Blue Owl Capital Corp.                                               |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                                          | 3,125 % éch. 10/02/2032             | 300                              | 296                       | 0,06                    |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 6,450 % éch. 15/09/2028                                              | 1 200                               | 1 063                            | 0,20                      | 3,125 % éch. 10/02/2032                               | 300                                 | 296                              | 0,06                      |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| BNP Paribas S.A.                                                     |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 03/09/2030                               | 900                                 | 907                              | 0,17                      |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 2,750 % éch. 25/07/2028                                              | € 2 900                             | 2 894                            | 0,55                      | 4,250 % éch. 26/08/2035                               | 500                                 | 509                              | 0,10                      |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 9,250 % éch. 17/11/2027 (e)(g)                                       | \$ 900                              | 825                              | 0,16                      | Association internationale de développement           | 1,750 % éch. 05/05/2037             | 4 300                            | 3 714                     | 0,71                    |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| BPCE S.A.                                                            |                                     |                                  |                           | Intesa Sanpaolo Assicurazioni SpA                     | 2,375 % éch. 22/12/2030             | 1 000                            | 946                       | 0,18                    |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 2,125 % éch. 13/10/2046                                              | € 1 000                             | 901                              | 0,17                      | JAB Holdings BV                                       | 4,750 % éch. 29/06/2032             | 700                              | 742                       | 0,14                    |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 3,875 % éch. 03/01/2034                                              | 3 400                               | 3 410                            | 0,65                      | 4,750 % éch. 29/06/2032                               | 700                                 | 742                              | 0,14                      |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 4,000 % éch. 16/01/2037                                              | 100                                 | 100                              | 0,02                      | JPMorgan Chase & Co.                                  | 4,457 % éch. 13/11/2031             | 3 200                            | 3 345                     | 0,64                    |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 4,760 % éch. 13/01/2032                                              | \$ 850                              | 733                              | 0,14                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| CA Immobilien Anlagen AG                                             |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 3,500 % éch. 07/07/2029 (a)                                          | € 600                               | 597                              | 0,11                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| CaixaBank S.A.                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 5,875 % éch. 09/10/2027 (e)(g)                                       | 2 000                               | 2 049                            | 0,39                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| Carmila S.A.                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 3,750 % éch. 13/01/2033                                              | 900                                 | 887                              | 0,17                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 3,500 % éch. 22/09/2032                                              | 900                                 | 881                              | 0,17                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 3,875 % éch. 28/05/2031                                              | 400                                 | 402                              | 0,08                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| Core Fund                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 0,500 % éch. 27/01/2028                                              | 400                                 | 384                              | 0,07                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 0,900 % éch. 12/10/2029                                              | 900                                 | 832                              | 0,16                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| CCF Holding S.A.S.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 5,000 % éch. 27/05/2035                                              | 1 000                               | 1 015                            | 0,19                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| CI Financial Corp.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 4,625 % éch. 12/12/2031                                              | 1 600                               | 1 622                            | 0,31                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| Citadel Finance LLC                                                  |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 4,750 % éch. 14/02/2029                                              | \$ 700                              | 603                              | 0,11                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| Citigroup, Inc.                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
| 3,750 % éch. 14/05/2032                                              | € 1 800                             | 1 826                            | 0,35                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           |       |       |      |
|                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                      |                                      |                           | </    |       |      |

# Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| PKO Bank Hipoteczny S.A.<br>2,500 % éch. 12/06/2029                     | € 900                               | € 889                            | 0,17                      | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                                                 | \$ 860                              | € 768                            | 0,15                      | Motability Operations Group PLC<br>3,500 % éch. 17/07/2031            | € 400                               | € 400                            | 0,08                      |
| PPI Public Property Invest AB<br>3,875 % éch. 16/10/2031                | 300                                 | 297                              | 0,06                      | Booking Holdings, Inc.<br>3,500 % éch. 11/05/2030                                                               | € 300                               | 302                              | 0,06                      | 3,625 % éch. 22/01/2033                                               | 100                                 | 99                               | 0,02                      |
| 4,125 % éch. 21/04/2033                                                 | 1 800                               | 1 777                            | 0,34                      | Brenntag Finance BV<br>3,375 % éch. 02/10/2031                                                                  | 900                                 | 890                              | 0,17                      | Mundys SpA<br>3,700 % éch. 29/09/2031                                 | 900                                 | 887                              | 0,17                      |
| Prologis Euro Finance LLC<br>3,250 % éch. 22/09/2032                    | 600                                 | 592                              | 0,11                      | 3,875 % éch. 24/04/2032                                                                                         | 200                                 | 203                              | 0,04                      | National Grid Electricity Transmission PLC<br>0,823 % éch. 07/07/2032 | 400                                 | 343                              | 0,07                      |
| QNB Finance Ltd.<br>4,679 % éch. 27/04/2029                             | \$ 2 100                            | 1 846                            | 0,35                      | BT Finance PLC<br>3,375 % éch. 17/11/2032                                                                       | 1 200                               | 1 187                            | 0,23                      | Netflix, Inc.<br>3,875 % éch. 15/11/2029                              | 1 600                               | 1 641                            | 0,31                      |
| RCI Banque S.A.<br>5,500 % éch. 09/10/2034                              | € 900                               | 934                              | 0,18                      | Burberry Group PLC<br>5,750 % éch. 20/06/2030                                                                   | £ 1 200                             | 1 407                            | 0,27                      | Novartis Finance S.A.<br>3,100 % éch. 13/01/2032                      | 2 300                               | 2 298                            | 0,44                      |
| Realkredit Danmark A/S<br>2,500 % éch. 01/04/2036                       | DKK 2                               | 0                                | 0,00                      | Carnival UK Ltd.<br>4,125 % éch. 15/07/2031                                                                     | € 1 200                             | 1 209                            | 0,23                      | Novonesis Novozymes<br>3,250 % éch. 19/03/2030                        | 800                                 | 803                              | 0,15                      |
| 2,500 % éch. 01/04/2047                                                 | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Cencora, Inc.<br>3,625 % éch. 22/05/2032                                                                        | 1 100                               | 1 104                            | 0,21                      | 3,625 % éch. 19/03/2033                                               | 500                                 | 504                              | 0,10                      |
| Sagax AB<br>3,375 % éch. 26/01/2031                                     | € 800                               | 789                              | 0,15                      | Chanel Ceres PLC<br>0,500 % éch. 31/07/2026                                                                     | 2 400                               | 2 395                            | 0,46                      | NTT Finance Corp.<br>2,906 % éch. 16/03/2029                          | 2 700                               | 2 682                            | 0,51                      |
| 4,000 % éch. 13/03/2032                                                 | 100                                 | 101                              | 0,02                      | Davide Campari-Milano NV<br>4,250 % éch. 17/06/2033                                                             | 1 500                               | 1 527                            | 0,29                      | 3,559 % éch. 01/11/2031 (a)                                           | 600                                 | 602                              | 0,11                      |
| Sagax Euro MTN NL BV<br>1,000 % éch. 17/05/2029                         | 700                                 | 656                              | 0,12                      | El Corte Ingles S.A.<br>3,500 % éch. 24/07/2033                                                                 | 400                                 | 393                              | 0,07                      | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045             | \$ 1 500                            | 1 308                            | 0,25                      |
| Santander UK Group Holdings PLC<br>3,649 % éch. 16/02/2034              | 200                                 | 198                              | 0,04                      | Eni SpA<br>0,625 % éch. 14/06/2028                                                                              | 1 600                               | 1 531                            | 0,29                      | REWE International Finance BV<br>2,750 % éch. 03/07/2028              | € 1 500                             | 1 491                            | 0,28                      |
| SELP Finance SARL<br>3,875 % éch. 21/04/2031                            | 1 100                               | 1 110                            | 0,21                      | Flora Food Management BV<br>6,875 % éch. 02/07/2029                                                             | 700                                 | 685                              | 0,13                      | Robert Bosch GmbH<br>3,625 % éch. 02/06/2030                          | 1 400                               | 1 419                            | 0,27                      |
| 2,500 % éch. 29/06/2033                                                 | 1 400                               | 1 407                            | 0,27                      | Flutter Treasury DAC<br>4,000 % éch. 04/06/2031                                                                 | 1 500                               | 1 479                            | 0,28                      | 4,000 % éch. 21/03/2036                                               | 2 200                               | 2 210                            | 0,42                      |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>3,318 % éch. 07/10/2031        | 500                                 | 501                              | 0,10                      | Fresenius SE & Co. KGaA<br>2,750 % éch. 15/09/2029                                                              | 700                                 | 691                              | 0,13                      | Sandoz Finance BV<br>4,220 % éch. 17/04/2030                          | 1 100                               | 1 135                            | 0,22                      |
| TAG Immobilien AG<br>3,625 % éch. 03/03/2032                            | 400                                 | 396                              | 0,08                      | Gatwick Funding Ltd.<br>3,875 % éch. 24/06/2035                                                                 | 800                                 | 795                              | 0,15                      | Sartorius Finance BV<br>4,375 % éch. 14/09/2029                       | 600                                 | 619                              | 0,12                      |
| 4,250 % éch. 04/03/2030                                                 | 1 200                               | 1 227                            | 0,23                      | Global Payments, Inc.<br>4,875 % éch. 17/03/2031                                                                | 100                                 | 103                              | 0,02                      | 4,500 % éch. 14/09/2032                                               | 900                                 | 939                              | 0,18                      |
| Tatra Banka A/S<br>2,750 % éch. 10/02/2031                              | 300                                 | 297                              | 0,06                      | H Lundbeck A/S<br>0,875 % éch. 14/10/2027                                                                       | 1 500                               | 1 460                            | 0,28                      | SEB S.A.<br>3,625 % éch. 24/06/2030                                   | 2 100                               | 2 066                            | 0,39                      |
| Toronto-Dominion Bank<br>3,641 % éch. 22/10/2031                        | 1 900                               | 1 917                            | 0,36                      | Heathrow Funding Ltd.<br>1,875 % éch. 14/03/2036                                                                | 1 000                               | 867                              | 0,16                      | SGS Finance BV<br>3,125 % éch. 10/09/2030                             | 2 100                               | 2 089                            | 0,40                      |
| TP ICAP Finance PLC<br>4,250 % éch. 18/11/2028                          | £ 1 100                             | 1 204                            | 0,23                      | Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement S.A.S.<br>0,625 % éch. 16/09/2028                      | 900                                 | 860                              | 0,16                      | Silfin NV<br>5,125 % éch. 17/07/2030                                  | 1 900                               | 1 993                            | 0,38                      |
| TSB Bank PLC<br>3,319 % éch. 05/03/2029                                 | € 600                               | 605                              | 0,12                      | IDS Financing PLC<br>3,250 % éch. 01/10/2029                                                                    | 600                                 | 594                              | 0,11                      | Smiths Group PLC<br>3,625 % éch. 13/11/2033                           | 1 000                               | 987                              | 0,19                      |
| UBS Group AG<br>0,875 % éch. 03/11/2031                                 | 400                                 | 352                              | 0,07                      | IHG Finance LLC<br>3,375 % éch. 10/09/2030                                                                      | 1 400                               | 1 393                            | 0,27                      | SNF Group SACA<br>2,625 % éch. 01/02/2029                             | 300                                 | 294                              | 0,06                      |
| UBS Switzerland AG<br>2,783 % éch. 09/09/2030                           | 1 100                               | 1 089                            | 0,21                      | IHO Verwaltungs GmbH<br>5,625 % éch. 15/05/2031                                                                 | 100                                 | 104                              | 0,02                      | Spirit Airlines Pass-Through Trust<br>4,100 % éch. 01/10/2029         | \$ 47                               | 40                               | 0,01                      |
| UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S<br>2,875 % éch. 25/03/2029 | 600                                 | 599                              | 0,11                      | IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature)<br>6,750 % éch. 15/11/2029 (b) | 900                                 | 943                              | 0,18                      | Stellantis NV<br>6,250 % éch. 16/03/2031 (e)                          | € 2 000                             | 1 963                            | 0,37                      |
| UNIQA Insurance Group AG<br>4,500 % éch. 13/05/2046                     | 200                                 | 201                              | 0,04                      | IMCD NV<br>4,875 % éch. 18/09/2028                                                                              | 1 500                               | 1 545                            | 0,29                      | Suez SACA<br>1,875 % éch. 24/05/2027                                  | 1 200                               | 1 188                            | 0,23                      |
| Volkswagen Bank GmbH<br>3,125 % éch. 02/10/2029                         | 500                                 | 496                              | 0,09                      | Imerys S.A.<br>4,000 % éch. 21/11/2032                                                                          | 1 600                               | 1 595                            | 0,30                      | Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.<br>3,965 % éch. 28/04/2034       | 800                                 | 808                              | 0,15                      |
| Volkswagen Financial Services AG<br>3,875 % éch. 19/11/2031             | 1 900                               | 1 910                            | 0,36                      | Indigo Group S.A.S.<br>3,750 % éch. 24/04/2032                                                                  | 1 300                               | 1 310                            | 0,25                      | T-Mobile USA, Inc.<br>3,150 % éch. 11/02/2032                         | 2 900                               | 2 862                            | 0,54                      |
| Wells Fargo & Co.<br>0,000 % éch. 23/07/2029                            | 1 600                               | 1 587                            | 0,30                      | Informa PLC<br>3,375 % éch. 09/06/2031                                                                          | 1 000                               | 992                              | 0,19                      | TDF Infrastructure S.A.S.<br>1,750 % éch. 01/12/2029                  | 800                                 | 752                              | 0,14                      |
| 3,900 % éch. 22/07/2032                                                 | 1 800                               | 1 835                            | 0,35                      | 3,750 % éch. 29/04/2032                                                                                         | 2 400                               | 2 405                            | 0,46                      | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,125 % éch. 01/06/2031 | 500                                 | 504                              | 0,10                      |
| Westpac Banking Corp.<br>2,585 % éch. 14/05/2030                        | 300                                 | 296                              | 0,06                      | InterContinental Hotels Group PLC<br>2,125 % éch. 15/05/2027                                                    | 600                                 | 596                              | 0,11                      | Toyota Motor Corp.<br>3,230 % éch. 29/03/2030                         | 800                                 | 801                              | 0,15                      |
|                                                                         |                                     | 161 206                          | 30,69                     | JDE Peet's NV<br>0,500 % éch. 16/01/2029                                                                        | 1 750                               | 1 628                            | 0,31                      | Ubisoft Entertainment S.A.<br>0,878 % éch. 24/11/2027                 | 300                                 | 265                              | 0,05                      |
| <b>INDUSTRIE</b>                                                        |                                     |                                  |                           | John Lewis PLC<br>4,250 % éch. 18/12/2034                                                                       | £ 950                               | 935                              | 0,18                      | UCB S.A.<br>4,250 % éch. 20/03/2030                                   | 1 400                               | 1 433                            | 0,27                      |
| Aeroporti di Roma SpA<br>3,625 % éch. 15/06/2032                        | 900                                 | 899                              | 0,17                      | Lindt PLC<br>3,200 % éch. 13/05/2030                                                                            | € 800                               | 803                              | 0,15                      | Universal Music Group NV<br>3,750 % éch. 30/06/2032                   | 3 000                               | 3 042                            | 0,58                      |
| Altrad Investment Authority S.A.S.<br>3,704 % éch. 23/06/2029           | 400                                 | 400                              | 0,08                      | Lottomatica Group SpA<br>4,625 % éch. 30/04/2032                                                                | 200                                 | 202                              | 0,04                      | 4,000 % éch. 13/06/2031                                               | 300                                 | 309                              | 0,06                      |
| 4,429 % éch. 23/06/2032                                                 | 1 500                               | 1 509                            | 0,29                      | Magnum Icc Finance BV<br>3,250 % éch. 26/11/2031                                                                | 1 100                               | 1 088                            | 0,21                      | Veralto Corp.<br>4,150 % éch. 19/09/2031                              | 500                                 | 514                              | 0,10                      |
| Amazon.com, Inc.<br>3,350 % éch. 16/03/2032                             | 700                                 | 701                              | 0,13                      | Maple Parent Holdings Corp.<br>3,881 % éch. 26/03/2030                                                          | 700                                 | 706                              | 0,13                      | Verisure Holding AB<br>4,125 % éch. 02/01/2032 (a)                    | 1 600                               | 1 613                            | 0,31                      |
| Amprion GmbH<br>3,625 % éch. 21/05/2031                                 | 1 900                               | 1 924                            | 0,37                      | 4,224 % éch. 26/03/2032                                                                                         | 400                                 | 405                              | 0,08                      | Viatris, Inc.<br>4,250 % éch. 17/06/2033                              | 400                                 | 404                              | 0,08                      |
| Anglo American Capital PLC<br>4,125 % éch. 15/03/2032                   | 1 400                               | 1 438                            | 0,27                      | 4,728 % éch. 26/03/2035                                                                                         | 600                                 | 617                              | 0,12                      | Vilmorin & Cie S.A.<br>1,375 % éch. 26/03/2028                        | 900                                 | 865                              | 0,16                      |
| APA Infrastructure Ltd.<br>0,750 % éch. 15/03/2029                      | 1 100                               | 1 032                            | 0,20                      | Mitchells & Butlers Finance PLC<br>4,350 % éch. 15/12/2030                                                      | \$ 188                              | 158                              | 0,03                      | Vmed O2 UK Financing PLC<br>4,000 % éch. 31/01/2029                   | £ 400                               | 439                              | 0,08                      |
| Barry Callebaut Services NV<br>3,750 % éch. 19/02/2028                  | 300                                 | 302                              | 0,06                      | 6,013 % éch. 15/12/2030                                                                                         | £ 55                                | 64                               | 0,01                      | 5,625 % éch. 15/04/2032                                               | € 2 800                             | 2 468                            | 0,47                      |
| Becton Dickinson & Co.<br>3,828 % éch. 07/06/2032                       | 700                                 | 712                              | 0,14                      |                                                                                                                 |                                     |                                  |                           | Volkswagen International Finance NV<br>4,250 % éch. 15/02/2028        | 1 800                               | 1 832                            | 0,35                      |
|                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                                 |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/05/2030                                               | 1 600                               | 1 651                            | 0,31                      |

[Voir les notes annexes](#)

468 PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                             | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 10 ans | (1,000) %              | 20/06/2036         | € 76 400                            | € (263)                                 | (0,05)                 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000 %                 | 20/12/2030         | \$ 33 170                           | € 103                                   | 0,02                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 83 810                              | 294                                     | 0,06                   |
| Indice iTraxx Europe Main 44 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2030         | € 38 050                            | 114                                     | 0,02                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 216 350                             | 951                                     | 0,18                   |
|                                            |                         |                    |                                     | € 1 462                                 | 0,28                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir         | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %      | 18/03/2028         | £ 12 240             | € (114)                                 | (0,02)                 |
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2031         | 16 400               | (408)                                   | (0,08)                 |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 18/03/2036         | 26 600               | 366                                     | 0,07                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 16/09/2036         | 5 900                | (11)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,750        | 16/06/2031         | \$ 4 530             | (380)                                   | (0,07)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750        | 15/06/2052         | 3 400                | (34)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 19/03/2030         | 58 700               | (911)                                   | (0,17)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 18/12/2054         | 2 900                | 433                                     | 0,08                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 17/09/2055         | 19 000               | 433                                     | 0,08                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750        | 17/06/2036         | 18 200               | 331                                     | 0,06                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000        | 17/06/2056         | 16 700               | 166                                     | 0,03                   |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,033       | 02/01/2029         | BRL 84 400           | (371)                                   | (0,07)                 |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,354       | 02/01/2029         | 58 800               | (205)                                   | (0,04)                 |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,515       | 04/01/2027         | 22 600               | 4                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000        | 01/06/2034         | CAD 3 400            | (7)                                     | 0,00                   |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,750        | 19/03/2030         | AUD 18 800           | (408)                                   | (0,08)                 |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,380        | 31/12/2034         | € 1 600              | (35)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,410        | 05/11/2034         | 1 490                | (28)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,460        | 13/03/2035         | 900                  | (25)                                    | 0,00                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,460        | 01/04/2035         | 900                  | (27)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,520        | 27/03/2035         | 900                  | (22)                                    | 0,00                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,610        | 24/03/2035         | 900                  | (15)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000        | 16/09/2056         | 2 670                | (2)                                     | 0,00                   |
|                                                    |                                   |              |                    |                      | € (1 270)                               | (0,25)                 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |              |                    |                      | € (38)                                  | (0,01)                 |

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

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

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

<sup>(4)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| AZD          | 07/2026              | CNH 203            | \$ 30                | € 0                   | € 0                      | € 0                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | SGD 385            | 302                  | 4                     | 0                        | 4                                             | 0,00                   |
| BOA          | 07/2026              | BRL 52             | 10                   | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | DKK 375            | € 50                 | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | KRW 17 478         | \$ 11                | 0                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |
|              | 07/2026              | SGD 4 039          | 3 163                | 35                    | 0                        | 35                                            | 0,01                   |
|              | 07/2026              | \$ 192             | CNH 1 298            | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 07/2026              | 1 678              | € 1 439              | 0                     | (28)                     | (28)                                          | (0,01)                 |



# Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$ 32           | PLN 121           | € 0                | € 0                   | € 0                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 551         | \$ 185            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 705         | 40                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$16            | INR 1 504         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 678         | \$ 131            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 289         | € 314             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 1 465       | \$ 217            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 2 600         | 2 971             | 2                  | (3)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 26 619 022  | 1 484             | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 722         | 245               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 41 300      | 430               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 270 395     | 177               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 2 032       | 1 572             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 6 704       | 204               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 9 132       | 192               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 796        | BRL 9 274         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 225           | € 1 056           | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 853           | HUF 566 003       | 0                  | (31)                  | (31)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 320             | IDR 5 701 903     | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 559           | INR 242 397       | 3                  | (5)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 403             | KRW 618 991       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 39              | TWD 1 244         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 3 435       | \$ 209            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 79            | 90                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 119         | 40                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 252          | BRL 1 285         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 2 643 936   | \$ 146            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 287       | 163               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 796          | IDR 14 114 195    | 1                  | (13)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 96              | INR 9 121         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 30              | THB 987           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 97              | IDR 1 766 504     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | AUD 453         | € 277             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 876         | \$ 296            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 719         | € 63              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 11          | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 617        | TRY 125 367       | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR 28 197      | \$ 1 727          | 9                  | (1)                   | 8                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 2 972       | € 1 832           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 63            | NOK 720           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 220         | € 242             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 107           | NOK 1 160         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 494           | € 570             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 806         | \$ 277            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 28 345      | 300               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 238          | IDR 4 263 079     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 293             | INR 28 345        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 30              | KRW 44 805        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 386             | PLN 1 425         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14              | TWD 446           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 937         | \$ 320            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 1 132 641   | 308               | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 9 861 480   | 546               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 2 888       | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 8 065       | 243               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 155          | IDR 2 767 177     | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 114             | MXN 2 032         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1               | PEN 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 6 506       | \$ 1 879          | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | 1 771           | 518               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 779             | 223               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 309          | IDR 5 611 140     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | IDR 539 734     | \$ 30             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 10 953      | 116               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 463         | 363               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 695          | CNH 4 729         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 77              | INR 7 466         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 177             | PLN 655           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 7 888       | \$ 487            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 4 718       | 695               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 5 637 299   | 313               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 129          | IDR 2 348 977     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 09/2026           | 116             | INR 11 027        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 91          | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 40          | 28                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 97 302      | 63                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 233          | IDR 4 182 836     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 63              | KRW 97 289        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 869             | PLN 3 241         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 3 649       | \$ 221            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 637        | BRL 23 668        | 0                  | (87)                  | (87)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 28              | CAD 40            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 08/2026           | \$ 76           | INR 7 303         | € 1                | € 0                   | € 1                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 4 207 331   | \$ 233            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 14 020      | \$ 434            | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 546          | BRL 2 811         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 535             | IDR 9 618 983     | 1                  | (3)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 477             | INR 45 904        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 100             | MXN 1 742         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 11 734      | \$ 2 280          | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 1 900       | 280               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 43          | € 6               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 985           | CHF 908           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 20              | DKK 150           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 174             | £ 150             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 194             | ¥ 35 793          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 126           | \$ 5 827          | 0                  | (29)                  | (29)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ILS 2 252       | 754               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 8 279       | 88                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 36 822        | € 200             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 30 068      | \$ 19             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 3 566       | € 316             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 3 381       | 1 730             | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | SEK 554         | 50                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 35           | IDR 621 774       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 88              | INR 8 279         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19              | KRW 30 064        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 945             | PLN 3 448         | 1                  | (25)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 131             | THB 4 369         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 908         | € 987             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 150         | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 200           | ¥ 36 822          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 316             | NOK 3 572         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 50              | SEK 554           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 4 821       | \$ 1 631          | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 625 229     | 35                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 9 734       | 102               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 560         | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 33 272      | 1 015             | 8                  | (1)                   | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 148          | INR 14 088        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 4 870           | MXN 84 784        | 0                  | (43)                  | (43)                                    | (0,01)              |
|              | 10/2026           | 2 280           | BRL 11 992        | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | MXN 198         | \$ 11             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$251           | MXN 4 433         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | CHF 1 188       | € 1 301           | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 84          | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 560           | £ 486             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 289             | NOK 3 205         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 726           | \$ 2 000          | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 57 458      | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 10 997      | 116               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 300 818     | 198               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 1 847       | € 923             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 556          | BRL 2 885         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 180             | INR 17 306        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 405       | \$ 162            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 487          | INR 46 628        | 3                  | (1)                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 164         | € 179             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 6 651         | £ 5 741           | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 935             | ¥ 173 000         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 52              | SEK 565           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 261         | € 131             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 5 649         | 6 535             | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 217          | IDR 3 871 716     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 182             | INR 17 467        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 174           | TRY 55 172        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 3 893 430   | \$ 217            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 95           | IDR 1 689 428     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 616         | € 377             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | CAD 7 143       | 4 434             | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 647           | AUD 1 069         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 62              | CAD 100           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 21              | DKK 160           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 041           | ¥ 192 855         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 353 046       | € 1 916           | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 80           | IDR 1 442 168     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 239             | INR 22 903        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 071       | € 647             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 159         | 21                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 919         | ¥ 353 046         | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 189          | INR 18 139        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 4 389 787   | \$ 243            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 4 980       | 154               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |



## Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG                                                | 09/2026           | \$ 286          | IDR 5 133 885     | € 0                | € (1)                 | € (1)                                   | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CNH 2 461       | \$ 364            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 2 513         | CAD 4 069         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 7 911           | £ 6 824           | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 25 637          | \$ 29 162         | 0                  | (130)                 | (130)                                   | (0,02)              |
|                                                    | 07/2026           | £ 13 834        | € 15 949          | 0                  | (111)                 | (111)                                   | (0,02)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 36 878       | 31 721            | 6                  | (542)                 | (536)                                   | (0,10)              |
|                                                    | 07/2026           | 5 343           | SGD 6 921         | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | CAD 4 069       | € 2 513           | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 5 126         | \$ 5 861          | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 6 834         | € 7 911           | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | SGD 6 905       | \$ 5 343          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 29 202       | € 25 637          | 131                | 0                     | 131                                     | 0,02                |
|                                                    | 07/2026           | CHF 840         | 908               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 1 946         | CHF 1 793         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SSB                                                | 07/2026           | \$ 30           | CAD 41            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | CHF 1 793       | € 1 950           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 873           | \$ 996            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CAD 1 706       | € 1 051           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 23            | DKK 172           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | ¥ 4 057         | € 22              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 180          | PLN 657           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | DKK 172         | € 23              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 22            | ¥ 4 057           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | MXN 521         | \$ 30             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | THB 697         | 21                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | \$ 1            | THB 17            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 12/2026           | COP 13 182 226  | \$ 3 378          | 0                  | (259)                 | (259)                                   | (0,05)              |
|                                                    |                   |                 |                   | € 536              | € (1 533)             | € (997)                                 | (0,19)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | € (997)                                 | (0,19)              |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       | € 582 696                               | 110,94              |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       | € (57 456)                              | (10,94)             |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       | € 525 240                               | 100,00              |

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

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

- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date d'achat contractuel.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 16 846 € (31 décembre 2025 : 15 326 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 850 € (31 décembre 2025 : 0 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 580 666                                            | € 0                                               | € 580 666        |
| Fonds d'investissement                        | 711                                                                               | 0                                                    | 0                                                 | 711              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 638                                                                             | (319)                                                | 0                                                 | 1 319            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 2 349</b>                                                                    | <b>€ 580 347</b>                                     | <b>€ 0</b>                                        | <b>€ 582 696</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 594 820                                            | € 0                                               | € 594 820        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 7 800                                                | 0                                                 | 7 800            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (828)                                                                             | (4 912)                                              | 0                                                 | (5 740)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ (828)</b>                                                                    | <b>€ 597 708</b>                                     | <b>€ 0</b>                                        | <b>€ 596 880</b> |

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

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

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | € 4                                                        | € 0                     | € 4                               | € S/O                                                      | € S/O                   | € S/O                             |
| BOA          | 6                                                          | 0                       | 6                                 | 16                                                         | 0                       | 16                                |
| BPS          | (75)                                                       | 0                       | (75)                              | (144)                                                      | 0                       | (144)                             |
| BRC          | 45                                                         | 0                       | 45                                | 42                                                         | 0                       | 42                                |
| CBK          | (30)                                                       | 0                       | (30)                              | (52)                                                       | 0                       | (52)                              |
| DUB          | 10                                                         | 0                       | 10                                | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| GLM          | (92)                                                       | 0                       | (92)                              | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| GST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |
| JPM          | (32)                                                       | 0                       | (32)                              | (41)                                                       | 0                       | (41)                              |
| MBC          | 47                                                         | 0                       | 47                                | (40)                                                       | 0                       | (40)                              |
| MYI          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | (92)                                                       | 0                       | (92)                              |
| NSL          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 30                                                         | 0                       | 30                                |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 6                                                          | 0                       | 6                                 |
| SCX          | 37                                                         | 0                       | 37                                | (42)                                                       | 0                       | (42)                              |
| SOG          | (651)                                                      | 600                     | (51)                              | 281                                                        | (300)                   | (19)                              |
| SSB          | (5)                                                        | 0                       | (5)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | (263)                                                      | 250                     | (13)                              | (20)                                                       | 0                       | (20)                              |

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

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 68,22            | 64,81                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 17,00            | 16,14                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,44             | 0,03                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,10             | S/O                  |
| Contrats de mise en pension                                      | S/O              | 1,06                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,41             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,48             | 0,20                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,08             | 0,10                 |
| Autres actifs                                                    | 13,27            | 17,63                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                                            | 56,37            | 57,49                |
| Obligations et billets convertibles                                                                      | 0,14             | 0,14                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 15,05            | 14,07                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 0,52             | 0,48                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 2,13             | 2,56                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 7,79             | 8,51                 |
| Émissions souveraines                                                                                    | 28,55            | 24,47                |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 0,14             | S/O                  |
| Contrats de mise en pension                                                                              | S/O              | 1,41                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,45             | (0,20)               |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,05)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,28             | 0,05                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,25)           | (0,88)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,19)           | (0,01)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (10,94)          | (8,09)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                                      | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------|---------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------------|--------|--------|------|--------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                           |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Altice France S.A.                                                                           |                                     |                                  |                           | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                                                                       |                           | Flora Food Management BV                                                              |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 6,579 % éch. 30/04/2028                                                                      | €                                   | 1 284                            | €                         | 1 289                                                                                 | 0,05                                | 6,750 % éch. 28/12/2030 (c)                                                           | \$                        | 1 492                                                                                 | €                                   | 23                               | 0,00                      | 6,875 % éch. 02/07/2029        | €                               | 1 100                   | €                                    | 1 076                                   | 0,04   |        |      |        |       |      |
| 6,579 % éch. 30/10/2028                                                                      |                                     | 13 936                           |                           | 13 975                                                                                | 0,49                                | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                           | Flutter Treasury DAC                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 04/06/2031        |                                 | 8 300                   |                                      | 8 184                                   | 0,29   |        |      |        |       |      |
| 9,079 % éch. 30/05/2031                                                                      |                                     | 75                               |                           | 76                                                                                    | 0,00                                | 7,000 % éch. 28/12/2031 (c)                                                           |                           | 2 249                                                                                 |                                     |                                  | 33                        | 0,00                           | FMC Corp.                       |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 10,548 % éch. 31/05/2031                                                                     | \$                                  | 5 321                            |                           | 4 761                                                                                 | 0,17                                | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                           | 2 116                                                                                 |                                     |                                  | 37                        | 0,00                           | 8,000 % éch. 01/06/2031         |                         | \$                                   | 400                                     | 364    | 0,01   |      |        |       |      |
| Discovery Global Holdings, Inc.                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 7,250 % éch. 28/12/2032 (c)                                                           |                           | 2 116                                                                                 |                                     |                                  | 37                        | 0,00                           | GSG Bidco Ltd.                  |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| TBD % éch. 03/06/2033                                                                        | €                                   | 32 200                           |                           | 32 297                                                                                | 1,13                                | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                           | 7 721 % éch. 28/12/2028 (c)                                                           |                                     |                                  | 506                       | 8                              | 0,00                            | 5,375 % éch. 15/06/2036 |                                      |                                         | 13 500 | 13 401 | 0,47 |        |       |      |
| Envalor Finance GmbH                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 7,721 % éch. 28/12/2028 (c)                                                           |                           | 506                                                                                   |                                     |                                  | 8                         | 0,00                           | Informa PLC                     |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 7,650 % éch. 29/03/2030                                                                      |                                     | 1 200                            |                           | 1 117                                                                                 | 0,04                                | Morgan Stanley                                                                        |                           | €                                                                                     |                                     | 3 800                            | 3 821                     | 0,13                           | 3,750 % éch. 29/04/2032         |                         |                                      | 7 400                                   | 7 416  | 0,26   |      |        |       |      |
| 9,163 % éch. 29/03/2030                                                                      | \$                                  | 2 420                            |                           | 1 849                                                                                 | 0,06                                | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                                                  |                           | DKK                                                                                   |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                           | JetBlue Pass-Through Trust      |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Project Dorchester                                                                           |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 0,500 % éch. 01/10/2043                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 2,750 % éch. 15/11/2033         |                         | \$                                   | 765                                     | 594    | 0,02   |      |        |       |      |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (j)                                                                  | €                                   | 1 000                            |                           | 1 000                                                                                 | 0,03                                | 1,000 % éch. 01/10/2050                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 4,000 % éch. 15/05/2034         |                         |                                      | 64                                      | 53     | 0,00   |      |        |       |      |
| République du Panama                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 1,000 % éch. 01/10/2053                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | Mahle GmbH                      |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 4,979 % éch. 01/04/2027                                                                      |                                     | 8 700                            |                           | 8 759                                                                                 | 0,31                                | 1,500 % éch. 01/10/2050                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 7,125 % éch. 15/07/2032 (j)     |                         | €                                    | 15 300                                  | 16 145 | 0,56   |      |        |       |      |
| Stepstone Group Midco GmbH                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 1,500 % éch. 01/10/2050                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | Maple Parent Holdings Corp.     |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 6,885 % éch. 26/04/2032                                                                      |                                     | 8 700                            |                           | 7 142                                                                                 | 0,25                                | Nykredit Realkredit A/S                                                               |                           | 0,500 % éch. 01/10/2043                                                               |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 3,881 % éch. 26/03/2030         |                         |                                      | 8 200                                   | 8 266  | 0,29   |      |        |       |      |
| Subcalidora                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 0,500 % éch. 01/10/2043                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 4,224 % éch. 26/03/2032         |                         |                                      | 7 300                                   | 7 400  | 0,26   |      |        |       |      |
| 8,041 % éch. 14/08/2029                                                                      |                                     | 1 200                            |                           | 1 193                                                                                 | 0,04                                | 1,000 % éch. 01/10/2050                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | Mitchells & Butlers Finance PLC |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Virgin Media Bristol LLC                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 1,000 % éch. 01/10/2053                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 4,316 % éch. 15/12/2030         |                         | £                                    | 206                                     | 235    | 0,01   |      |        |       |      |
| 6,967 % éch. 31/03/2031                                                                      | \$                                  | 700                              |                           | 545                                                                                   | 0,02                                | 1,500 % éch. 01/10/2037                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 4,350 % éch. 15/12/2030         |                         | £                                    | 356                                     | 301    | 0,01   |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | 74 003                                                                                | 2,59                                | 1,500 % éch. 01/10/2050                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | Nissan Motor Co. Ltd.           |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     | 2,500 % éch. 01/10/2036                                                               |                           | 0                                                                                     |                                     |                                  | 0                         | 0,00                           | 4,345 % éch. 17/09/2027         |                         |                                      | 1 200                                   | 1 033  | 0,04   |      |        |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                |                                     |                                  |                           | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                                        |                                     |                                                                                       |                           | Roadster Finance DAC                                                                  |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| BANQUE ET FINANCE                                                                            |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 05/04/2032 (e)                                                           |                                     |                                                                                       |                           | \$                                                                                    |                                     |                                  |                           | 6 500                          | 4 631                           | 0,16                    | 7,500 % éch. 30/03/2045              |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Athene Global Funding                                                                        |                                     |                                  |                           | PPI Public Property Invest AB                                                         |                                     |                                                                                       |                           | 3,250 % éch. 21/04/2029                                                               |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 4 500                                   | 4 479  | 0,16   |      |        |       |      |
| 3,204 % éch. 23/02/2027                                                                      |                                     |                                  |                           | €                                                                                     | 9 300                               | 9 319                                                                                 | 0,33                      | 4,125 % éch. 21/04/2033                                                               |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 4 500                                   | 4 442  | 0,16   |      |        |       |      |
| CA Immobilien Anlagen AG                                                                     |                                     |                                  |                           | Realcredit Danmark A/S                                                                |                                     |                                                                                       |                           | 2,500 % éch. 01/04/2036                                                               |                                     |                                  |                           | DKK                            |                                 |                         |                                      | 0                                       | 0      | 0,00   |      |        |       |      |
| 3,500 % éch. 07/07/2029 (b)                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 6 000                               | 5 974                                                                                 | 0,21                      | SELP Finance SARL                                                                     |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 5 400                                   | 5 427  | 0,19   |      |        |       |      |
| CI Financial Corp.                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 29/06/2033                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 5 400                          | 5 427                           | 0,19                    | Simon Global Development BV          |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 4,625 % éch. 12/12/2031                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 20 000                              | 20 275                                                                                | 0,71                      | Société Générale S.A.                                                                 |                                     |                                  |                           | 2,797 % éch. 19/01/2028        |                                 |                         |                                      | \$                                      |        |        |      | 10 800 | 9 356 | 0,33 |
| 7,500 % éch. 30/05/2029                                                                      |                                     |                                  |                           | \$                                                                                    | 900                                 | 825                                                                                   | 0,03                      | Sofina S.A.                                                                           |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 18 200                                  | 18 033 | 0,63   |      |        |       |      |
| Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % en numéraire ou 11,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | VICI Properties LP                                                                    |                                     |                                                                                       |                           | 3,707 % éch. 13/11/2033                                                               |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 18 200                                  | 18 033 | 0,63   |      |        |       |      |
| 10,000 % éch. 31/12/2026 (c)                                                                 |                                     |                                  |                           | €                                                                                     | 445                                 | 412                                                                                   | 0,01                      | 3,750 % éch. 15/02/2027                                                               |                                     |                                  |                           | \$                             |                                 |                         |                                      | 400                                     | 348    | 0,01   |      |        |       |      |
| Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)   |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/02/2029                                                               |                                     |                                                                                       |                           | \$                                                                                    |                                     |                                  |                           | 300                            | 255                             | 0,01                    |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 8,000 % éch. 31/12/2028 (c)                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 2 954                               | 1 536                                                                                 | 0,05                      | 4,125 % éch. 15/08/2030                                                               |                                     |                                  |                           | 1 300                          |                                 |                         |                                      | 1 092                                   | 0,04   |        |      |        |       |      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.                                                 |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/01/2028                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 300                            | 261                             | 0,01                    |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                                                                     |                                     |                                  |                           | PEN                                                                                   | 492                                 | 139                                                                                   | 0,01                      | 4,625 % éch. 01/12/2029                                                               |                                     |                                  |                           | 10 708                         |                                 |                         |                                      | 9 195                                   | 0,32   |        |      |        |       |      |
| Deutsche Bank AG                                                                             |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 01/02/2027                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 600                            | 526                             | 0,02                    |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 2,789 % éch. 18/08/2027                                                                      |                                     |                                  |                           | €                                                                                     | 9 400                               | 9 403                                                                                 | 0,33                      | Volkswagen Bank GmbH                                                                  |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 5 200                                   | 5 229  | 0,18   |      |        |       |      |
| ELM BV for Swiss Prime Site AG                                                               |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 26/11/2028                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 7 100                          | 7 163                           | 0,25                    |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 3,125 % éch. 01/10/2031                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 6 100                               | 5 973                                                                                 | 0,21                      | 4,000 % éch. 26/11/2030                                                               |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 5 200                                   | 5 229  | 0,18   |      |        |       |      |
| F&G Annuities & Life, Inc.                                                                   |                                     |                                  |                           | Wells Fargo & Co.                                                                     |                                     |                                                                                       |                           | 0,000 % éch. 23/07/2029                                                               |                                     |                                  |                           | 1 800                          |                                 |                         |                                      | 1 786                                   | 0,06   |        |      |        |       |      |
| 6,500 % éch. 04/06/2029                                                                      |                                     |                                  |                           | \$                                                                                    | 1 100                               | 984                                                                                   | 0,03                      | Yango Justice International Ltd.                                                      |                                     |                                  |                           | \$                             |                                 |                         |                                      | 12 600                                  | 11     | 0,00   |      |        |       |      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                                                                    |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^                                                             |                                     |                                                                                       |                           | \$                                                                                    |                                     |                                  |                           | 12 600                         | 11                              | 0,00                    |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 2,700 % éch. 10/08/2026                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 300                                 | 262                                                                                   | 0,01                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | 186 091                                 | 6,52   |        |      |        |       |      |
| 2,900 % éch. 16/02/2028                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 2 740                               | 2 315                                                                                 | 0,08                      | INDUSTRIE                                                                             |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | Total des Obligations et billets privés |        |        |      |        |       |      |
| 4,271 % éch. 09/01/2027                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 489                                 | 426                                                                                   | 0,02                      | Altice France S.A.                                                                    |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 7,350 % éch. 04/11/2027                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 3 000                               | 2 697                                                                                 | 0,10                      | 6,875 % éch. 15/10/2030                                                               |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| GLP Capital LP                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 26/11/2028                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 5 200                          | 5 229                           | 0,18                    | Anglian Water Services Financing PLC |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 4,000 % éch. 15/01/2030                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 5 900                               | 4 963                                                                                 | 0,17                      | 9,500 % éch. 01/11/2029                                                               |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | 4,250 % éch. 23/06/2036                 |        |        |      |        |       |      |
| 5,300 % éch. 15/01/2029                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 7 100                               | 6 243                                                                                 | 0,22                      | 12,875 % éch. 01/11/2029                                                              |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | 15 500                                  |        |        |      | 15 520 | 0,54  |      |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                                                          |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 23/06/2032                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 4 000                          | 4 024                           | 0,14                    | Edison International                 |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 3,875 % éch. 29/04/2033                                                                      |                                     |                                  |                           | €                                                                                     | 14 600                              | 14 617                                                                                | 0,51                      | Amadeus IT Group S.A.                                                                 |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | 6,250 % éch. 15/03/2030                 |        |        |      |        |       |      |
| 4,250 % éch. 03/05/2030                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 3 400                               | 3 496                                                                                 | 0,12                      | 3,750 % éch. 20/05/2031                                                               |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | \$                                      |        |        |      | 500    | 450   | 0,02 |
| HLD Europe S.C.A.                                                                            |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC                                                                  |                                     |                                                                                       |                           | 6,581 % éch. 30/05/2049                                                               |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | SW Finance PLC                          |        |        |      |        |       |      |
| 4,125 % éch. 02/04/2030                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 6 700                               | 6 766                                                                                 | 0,24                      | Booking Holdings, Inc.                                                                |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 1 800                                   | 1 813  | 0,06   |      |        |       |      |
| Intesa Sanpaolo SpA                                                                          |                                     |                                  |                           | Carvana Co.                                                                           |                                     |                                                                                       |                           | 9,000 % éch. 01/06/2030                                                               |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | 1 625 % éch. 30/03/2027                 |        |        |      |        |       |      |
| 8,248 % éch. 21/11/2033                                                                      |                                     |                                  |                           | \$                                                                                    | 2 535                               | 2 563                                                                                 | 0,09                      | 3,350 % éch. 15/04/2031                                                               |                                     |                                  |                           | \$                             |                                 |                         |                                      | 284                                     | 239    | 0,01   |      |        |       |      |
| Iridium Capital PLC                                                                          |                                     |                                  |                           | Davide Campari-Milano NV                                                              |                                     |                                                                                       |                           | 4,250 % éch. 17/06/2033                                                               |                                     |                                  |                           | €                              |                                 |                         |                                      | 19 000                                  | 19 343 | 0,68   |      |        |       |      |
| 9,250 % éch. 18/06/2029                                                                      |                                     |                                  |                           | €                                                                                     | 1 500                               | 1 630                                                                                 | 0,06                      | DISH DBS Corp.                                                                        |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      | 5,250 % éch. 01/12/2026                 |        |        |      |        |       |      |
| Jyske Realkredit A/S                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 01/12/2028                                                               |                                     |                                                                                       |                           | €                                                                                     |                                     |                                  |                           | 740                            | 15                              | 0,00                    | 5,750 % éch. 01/12/2028              |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 0,500 % éch. 01/10/2043                                                                      |                                     |                                  |                           | DKK                                                                                   | 0                                   | 0                                                                                     | 0,00                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 0                                   | 0                                                                                     | 0,00                      | 6,250 % éch. 28/12/2028 (c)                                                           |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 0                                   | 0                                                                                     | 0,00                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2037                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 0                                   | 0                                                                                     | 0,00                      | 6,500 % éch. 28/12/2029 (c)                                                           |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 0                                   | 0                                                                                     | 0,00                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 5,000 % éch. 30/11/2027                                                                      |                                     |                                  |                           | \$                                                                                    | 93                                  | 4                                                                                     | 0,00                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature)        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 6,250 % éch. 28/12/2028 (c)                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 740                                 | 15                                                                                    | 0,00                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature)        |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
| 6,500 % éch. 28/12/2029 (c)                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 1 238                               | 24                                                                                    | 0,00                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                                                                       |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                |                                 |                         |                                      |                                         |        |        |      |        |       |      |

| DESCRIPTION                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Ubisoft Entertainment S.A.<br>2,375 % éch. 15/11/2028                                             | € 3 300                             | € 3 242                          | 0,11                      | Bear Stearns ALT-A Trust<br>4,112 % éch. 25/11/2036                                             | \$ 55                               | € 20                             | 0,00                      | Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates<br>4,101 % éch. 27/06/2037 | \$ 2 212                            | € 1 727                          | 0,06                      |
|                                                                                                   |                                     | 21 932                           | 0,77                      | 4,494 % éch. 25/05/2036                                                                         | 292                                 | 116                              | 0,00                      | Dilosk RMBS DAC<br>2,733 % éch. 25/10/2064                                                | € 11 700                            | 11 686                           | 0,41                      |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                          |                                     |                                  |                           | 4,495 % éch. 25/09/2035                                                                         | 143                                 | 40                               | 0,00                      | 3,080 % éch. 24/09/2060                                                                   | 7 560                               | 7 565                            | 0,27                      |
| Freddie Mac<br>3,750 % éch. 25/09/2055                                                            | \$ 5 248                            | 4 241                            | 0,15                      | 4,563 % éch. 25/07/2035                                                                         | 250                                 | 131                              | 0,01                      | Dutch Property Finance BV<br>2,913 % éch. 28/10/2059                                      | 4 280                               | 4 283                            | 0,15                      |
| 4,750 % éch. 25/07/2056 - 25/11/2057                                                              | 11 723                              | 10 040                           | 0,35                      | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>5,750 % éch. 25/11/2034                           | 109                                 | 85                               | 0,00                      | 3,063 % éch. 28/04/2064                                                                   | 9 455                               | 9 481                            | 0,33                      |
| Ginnie Mae, TBA<br>3,000 % éch. 01/08/2056                                                        | 2 900                               | 2 250                            | 0,08                      | Chase Mortgage Finance Trust<br>4,008 % éch. 25/03/2037                                         | 14                                  | 11                               | 0,00                      | EuroMASTR PLC<br>4,066 % éch. 15/06/2040                                                  | £ 61                                | 70                               | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 01/07/2056                                                                           | 4 000                               | 3 143                            | 0,11                      | 4,040 % éch. 25/01/2036                                                                         | 125                                 | 98                               | 0,00                      | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust<br>4,073 % éch. 25/01/2036            | \$ 131                              | 54                               | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 80 700                              | 69 541                           | 2,44                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                                                         | 94                                  | 35                               | 0,00                      | 4,862 % éch. 25/04/2036                                                                   | 33                                  | 24                               | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/07/2056                                                                           | 4 500                               | 3 956                            | 0,14                      | ChaseFlex Trust<br>5,000 % éch. 25/07/2037                                                      | 68                                  | 19                               | 0,00                      | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust<br>5,701 % éch. 25/11/2037                      | 16                                  | 10                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 01/08/2056 - 01/09/2056                                                              | 56 300                              | 50 188                           | 1,76                      | ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>4,203 % éch. 25/08/2037 | 18                                  | 13                               | 0,00                      | Frontier Mortgage Funding PLC<br>4,532 % éch. 20/12/2066                                  | £ 16 400                            | 19 055                           | 0,67                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 68 200                              | 61 796                           | 2,16                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>4,093 % éch. 25/12/2034                                  | 3                                   | 2                                | 0,00                      | 5,082 % éch. 20/12/2066                                                                   | 1 000                               | 1 163                            | 0,04                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>3,000 % éch. 01/05/2052              | 1 062                               | 811                              | 0,03                      | 4,303 % éch. 25/04/2037                                                                         | 86                                  | 67                               | 0,00                      | 5,482 % éch. 20/12/2066                                                                   | 1 000                               | 1 162                            | 0,04                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA<br>3,000 % éch. 01/08/2056         | 10 700                              | 8 157                            | 0,29                      | 4,490 % éch. 25/03/2037                                                                         | 32                                  | 26                               | 0,00                      | 6,232 % éch. 20/12/2066                                                                   | 1 149                               | 1 330                            | 0,05                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 52 100                              | 42 570                           | 1,49                      | 5,500 % éch. 25/12/2035                                                                         | 106                                 | 43                               | 0,00                      | GS Mortgage Securities Corp. Trust<br>3,659 % éch. 10/01/2043                             | \$ 1 475                            | 1 208                            | 0,04                      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 31 200                              | 26 125                           | 0,91                      | 6,250 % éch. 25/11/2037                                                                         | 139                                 | 46                               | 0,00                      | GS Mortgage-Backed Securities Trust<br>3,133 % éch. 24/11/2067                            | € 12 700                            | 12 733                           | 0,45                      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 495 090                             | 425 122                          | 14,90                     | CitiMortgage Alternative Loan Trust<br>6,000 % éch. 25/01/2037                                  | 160                                 | 124                              | 0,01                      | GSC Capital Corp. Mortgage Trust<br>4,123 % éch. 25/05/2036                               | \$ 41                               | 35                               | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/07/2056 - 01/09/2056                                                              | 333 300                             | 292 025                          | 10,23                     | 6,000 % éch. 25/06/2037                                                                         | 271                                 | 213                              | 0,01                      | GSR Mortgage Loan Trust<br>5,500 % éch. 25/06/2035                                        | 65                                  | 57                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 01/08/2056 - 01/09/2056                                                              | 477 450                             | 425 208                          | 14,90                     | Commercial Mortgage Trust<br>3,140 % éch. 10/10/2036                                            | 1 494                               | 1 290                            | 0,05                      | HarborView Mortgage Loan Trust<br>4,299 % éch. 19/06/2036                                 | 81                                  | 31                               | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 289 330                             | 261 633                          | 9,17                      | 4,921 % éch. 15/09/2033                                                                         | 4 000                               | 3 317                            | 0,12                      | 5,029 % éch. 19/12/2035                                                                   | 143                                 | 57                               | 0,00                      |
| 7,000 % éch. 01/08/2056                                                                           | 5 050                               | 4 642                            | 0,16                      | Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust<br>3,557 % éch. 25/08/2037                  | 55                                  | 20                               | 0,00                      | HSI Asset Loan Obligation Trust<br>6,000 % éch. 25/06/2037                                | 36                                  | 30                               | 0,00                      |
|                                                                                                   | 1 691 448                           | 59,27                            |                           | 6,000 % éch. 25/08/2037                                                                         | 48                                  | 20                               | 0,00                      | IndyMac Mortgage Loan Trust<br>3,372 % éch. 25/06/2036                                    | 33                                  | 24                               | 0,00                      |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                            |                                     |                                  |                           | Countrywide Alternative Loan Trust<br>3,989 % éch. 25/05/2036                                   | 5                                   | 4                                | 0,00                      | 3,625 % éch. 25/11/2035                                                                   | 65                                  | 55                               | 0,00                      |
| Obligations du Trésor américain<br>4,875 % éch. 15/08/2045                                        | 1 428                               | 1 240                            | 0,04                      | 4,173 % éch. 25/06/2037                                                                         | 25                                  | 21                               | 0,00                      | 3,653 % éch. 25/06/2037                                                                   | 935                                 | 479                              | 0,02                      |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (g)<br>1,375 % éch. 15/07/2033             | 10 085                              | 8 464                            | 0,29                      | 5,500 % éch. 25/03/2035                                                                         | 3 883                               | 2 978                            | 0,11                      | 4,263 % éch. 25/09/2037                                                                   | 2 649                               | 2 329                            | 0,08                      |
| 1,500 % éch. 15/02/2053                                                                           | 3 808                               | 2 533                            | 0,09                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                                                         | 56                                  | 27                               | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/10/2036                                                                   | 9 525                               | 4 014                            | 0,14                      |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                            | 860                                 | 734                              | 0,03                      | 5,500 % éch. 25/12/2035                                                                         | 60                                  | 25                               | 0,00                      | 4,483 % éch. 25/01/2035                                                                   | 43                                  | 30                               | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     | 12 971                           | 0,45                      | 5,500 % éch. 25/02/2036                                                                         | 41                                  | 20                               | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/11/2037                                                                   | 42                                  | 14                               | 0,00                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br/>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | 5,697 % éch. 25/09/2034                                                                         | 2                                   | 1                                | 0,00                      | Jeronimo Funding DAC<br>3,415 % éch. 25/10/2064                                           | € 13 029                            | 13 092                           | 0,46                      |
| Alba PLC<br>4,126 % éch. 15/12/2038                                                               | £ 953                               | 1 047                            | 0,04                      | 5,750 % éch. 25/04/2047                                                                         | 89                                  | 39                               | 0,00                      | JPMorgan Alternative Loan Trust<br>4,243 % éch. 25/10/2036                                | \$ 1 988                            | 1 620                            | 0,06                      |
| American Home Mortgage Assets Trust<br>3,973 % éch. 25/12/2046                                    | \$ 1 024                            | 814                              | 0,03                      | 6,000 % éch. 25/03/2036                                                                         | 1 041                               | 421                              | 0,02                      | 4,269 % éch. 27/06/2037                                                                   | 131                                 | 64                               | 0,00                      |
| 4,664 % éch. 25/11/2046                                                                           | 440                                 | 88                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2036                                                                         | 217                                 | 101                              | 0,00                      | 4,638 % éch. 25/12/2036                                                                   | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| Aran Funding DAC<br>3,379 % éch. 24/12/2065                                                       | € 10 216                            | 10 233                           | 0,36                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                                                         | 55                                  | 23                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/03/2036                                                                   | 165                                 | 71                               | 0,00                      |
| Banc of America Alternative Loan Trust<br>2,877 % éch. 25/06/2037 (a)                             | \$ 171                              | 17                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                                                         | 764                                 | 260                              | 0,01                      | 6,550 % éch. 25/05/2036                                                                   | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/06/2037                                                                           | 158                                 | 102                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                                                                         | 304                                 | 128                              | 0,01                      | Jubilee Place BV<br>3,090 % éch. 17/01/2059                                               | € 3 017                             | 3 021                            | 0,11                      |
| 5,500 % éch. 25/10/2033                                                                           | 101                                 | 88                               | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/07/2036                                                                         | 1 250                               | 417                              | 0,02                      | 3,207 % éch. 17/09/2060                                                                   | 8 635                               | 8 655                            | 0,30                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2046                                                                           | 161                                 | 123                              | 0,01                      | 6,250 % éch. 25/12/2036                                                                         | 20                                  | 7                                | 0,00                      | Jupiter Mortgage PLC<br>4,747 % éch. 20/07/2055                                           | £ 1 541                             | 1 792                            | 0,06                      |
| Banc of America Funding Trust<br>4,134 % éch. 20/10/2036                                          | 54                                  | 37                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/12/2036                                                                         | 58                                  | 20                               | 0,00                      | Kinbane DAC<br>3,378 % éch. 24/08/2075                                                    | € 13 792                            | 13 816                           | 0,49                      |
| 4,183 % éch. 25/04/2037                                                                           | 47                                  | 35                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2037                                                                         | 338                                 | 124                              | 0,01                      | Lavender Trust<br>6,250 % éch. 26/10/2036                                                 | \$ 151                              | 55                               | 0,00                      |
| 4,558 % éch. 20/09/2046                                                                           | 28                                  | 23                               | 0,00                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>4,243 % éch. 25/04/2036                    | 115                                 | 93                               | 0,00                      | Lehman Mortgage Trust<br>4,264 % éch. 25/12/2035                                          | 159                                 | 20                               | 0,00                      |
| 5,065 % éch. 20/04/2035                                                                           | 39                                  | 34                               | 0,00                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust<br>4,177 % éch. 20/02/2036                    | 98                                  | 82                               | 0,00                      | 5,073 % éch. 25/01/2036                                                                   | 27                                  | 23                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2037                                                                           | 216                                 | 152                              | 0,01                      | 4,190 % éch. 25/11/2037                                                                         | 66                                  | 53                               | 0,00                      | Lehman XS Trust<br>4,123 % éch. 25/12/2036                                                | 431                                 | 392                              | 0,01                      |
| 6,220 % éch. 20/09/2046                                                                           | 14                                  | 12                               | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/03/2035                                                                         | 240                                 | 84                               | 0,00                      | Ludgate Funding PLC<br>2,282 % éch. 01/01/2061                                            | € 3 360                             | 3 312                            | 0,12                      |
| Banc of America Mortgage Trust<br>6,000 % éch. 25/10/2036                                         | 5                                   | 4                                | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/03/2035                                                                         | 11                                  | 9                                | 0,00                      | 2,448 % éch. 01/12/2060                                                                   | 1 711                               | 1 685                            | 0,06                      |
| BCAP LLC Trust<br>4,490 % éch. 26/03/2037                                                         | 46                                  | 37                               | 0,00                      | 4,489 % éch. 20/12/2035                                                                         | 34                                  | 27                               | 0,00                      | Mansard Mortgages PLC<br>4,516 % éch. 15/12/2049                                          | £ 317                               | 368                              | 0,01                      |
| 4,896 % éch. 27/03/2037                                                                           | 172                                 | 131                              | 0,01                      | 4,503 % éch. 25/02/2035                                                                         | 131                                 | 107                              | 0,00                      | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust<br>4,198 % éch. 25/03/2035                          | \$ 9                                | 7                                | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/11/2034                                                                           | 8                                   | 7                                | 0,00                      | 4,614 % éch. 20/09/2036                                                                         | 11                                  | 8                                | 0,00                      | Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust<br>6,000 % éch. 25/05/2037                     | 114                                 | 74                               | 0,00                      |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust<br>5,206 % éch. 25/02/2035                            | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 4,614 % éch. 25/09/2047                                                                         | 50                                  | 40                               | 0,00                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust<br>4,244 % éch. 25/03/2036                         | 193                                 | 75                               | 0,00                      |
| 6,273 % éch. 25/12/2046                                                                           | 123                                 | 91                               | 0,00                      | 4,650 % éch. 25/01/2036                                                                         | 20                                  | 17                               | 0,00                      | Merriem Square Residential DAC<br>3,378 % éch. 24/03/2081                                 | € 10 543                            | 10 578                           | 0,37                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/03/2037                                                                         | 62                                  | 25                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/04/2037                                                                         | 88                                  | 30                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2037                                                                         | 14                                  | 5                                | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/10/2021                                                                         | 160                                 | 55                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/02/2022                                                                         | 244                                 | 51                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.<br>4,913 % éch. 25/09/2034                 | 9                                   | 17                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/01/2036                                                                         | 160                                 | 83                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates<br>5,594 % éch. 15/07/2032                          | 1 024                               | 891                              | 0,03                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust<br>4,063 % éch. 25/08/2036                 | 1 157                               | 260                              | 0,01                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2036                                                                         | 173                                 | 65                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/10/2021                                                                         | 205                                 | 3                                | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/02/2022                                                                         | 464                                 | 27                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust<br>4,063 % éch. 25/04/2037                        | 142                                 | 89                               | 0,00                      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                         |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Alternative Loan Trust                                         |                                     |                                  |                           | 4,763 % éch. 25/06/2037                              | \$ 61                               | € 46                             | 0,00                      |
| 4,459 % éch. 25/03/2036                                    | \$ 86                               | € 39                             | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/11/2037                                                    | \$ 21                               | € 16                             | 0,00                      | 4,813 % éch. 25/03/2034                              | 85                                  | 72                               | 0,00                      |
| 5,962 % éch. 25/06/2036                                    | 3 962                               | 911                              | 0,03                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust           |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/10/2037                                    | 111                                 | 49                               | 0,00                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/08/2034                              | 847                                 | 731                              | 0,03                      |
| 6,201 % éch. 25/02/2047                                    | 2 648                               | 743                              | 0,03                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | Carrington Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |
| Newgate Funding PLC                                        |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                         |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/02/2037                              | 100                                 | 84                               | 0,00                      |
| 2,468 % éch. 01/12/2050                                    | € 1 369                             | 1 322                            | 0,05                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES</b>                      |                                     |                                  |                           | Centex Home Equity Loan Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 2,498 % éch. 01/12/2050                                    | 891                                 | 880                              | 0,03                      | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                                          |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/10/2035                              | 3 260                               | 2 840                            | 0,10                      |
| 3,001 % éch. 15/12/2050                                    | 95                                  | 95                               | 0,00                      | 2,939 % éch. 29/12/2036                                                    | € 5 213                             | 5 220                            | 0,18                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.    |                                     |                                  |                           |
| 4,036 % éch. 01/12/2050                                    | £ 287                               | 332                              | 0,01                      | 2,953 % éch. 26/12/2041                                                    | 13 400                              | 13 424                           | 0,47                      | 4,043 % éch. 25/12/2046                              | 2 466                               | 2 017                            | 0,07                      |
| 4,066 % éch. 15/12/2050                                    | 1 829                               | 2 019                            | 0,07                      | Auto ABS Spanish Loans                                                     | 12 096                              | 12 125                           | 0,42                      | 4,203 % éch. 25/05/2037                              | 4 827                               | 4 090                            | 0,14                      |
| 4,866 % éch. 15/12/2050                                    | 115                                 | 133                              | 0,01                      | 3,059 % éch. 28/09/2038                                                    |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/03/2036                              | 798                                 | 640                              | 0,02                      |
| Nomura Resecuritization Trust                              |                                     |                                  |                           | Auto1 Car Funding SARL                                                     |                                     |                                  |                           | Fieldstone Mortgage Investment Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 4,663 % éch. 25/03/2037                                    | \$ 2 545                            | 2 174                            | 0,08                      | 2,829 % éch. 15/12/2033                                                    | 2 056                               | 2 059                            | 0,07                      | 4,543 % éch. 25/12/2035                              | 9 291                               | 7 404                            | 0,26                      |
| Polaris PLC                                                |                                     |                                  |                           | AutoFlorence SRL                                                           |                                     |                                  |                           | First NLC Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 27/03/2069                                    | £ 20 000                            | 23 250                           | 0,82                      | 2,968 % éch. 24/12/2044                                                    | 12 400                              | 12 437                           | 0,44                      | 3,903 % éch. 25/08/2037                              | 121                                 | 53                               | 0,00                      |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust                     |                                     |                                  |                           | Bavarian Sky S.A.                                                          |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/08/2037                              | 40                                  | 17                               | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/06/2037                                    | \$ 36                               | 29                               | 0,00                      | 2,705 % éch. 20/02/2034                                                    | 13 300                              | 13 306                           | 0,47                      | Fremont Home Loan Trust                              |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                    | 42                                  | 31                               | 0,00                      | BBVA Consumer Auto                                                         |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/01/2037                              | 9 136                               | 3 625                            | 0,13                      |
| 6,000 % éch. 25/05/2037                                    | 35                                  | 26                               | 0,00                      | 2,819 % éch. 25/02/2042                                                    | 5 500                               | 5 505                            | 0,19                      | 4,063 % éch. 25/01/2037                              | 188                                 | 75                               | 0,00                      |
| 6,250 % éch. 25/02/2037                                    | 94                                  | 68                               | 0,00                      | 3,117 % éch. 19/03/2038                                                    | 12 142                              | 12 182                           | 0,43                      | 4,083 % éch. 25/08/2036                              | 171                                 | 46                               | 0,00                      |
| Residential Asset Securitization Trust                     |                                     |                                  |                           | 3,239 % éch. 19/05/2042                                                    | 889                                 | 889                              | 0,03                      | 4,103 % éch. 25/02/2037                              | 597                                 | 158                              | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/02/2036                                    | 321                                 | 101                              | 0,00                      | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC                                   |                                     |                                  |                           | 4,633 % éch. 25/11/2034                              | 1 005                               | 790                              | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                    | 146                                 | 43                               | 0,00                      | 2,779 % éch. 15/08/2033                                                    | 9 968                               | 9 986                            | 0,35                      | 4,693 % éch. 25/04/2035                              | 1 513                               | 1 299                            | 0,05                      |
| 6,000 % éch. 25/11/2036                                    | 123                                 | 34                               | 0,00                      | FACT S.A.                                                                  |                                     |                                  |                           | GSAA Home Equity Trust                               |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/03/2037                                    | 96                                  | 25                               | 0,00                      | 2,915 % éch. 20/04/2033                                                    | 6 732                               | 6 742                            | 0,24                      | 5,772 % éch. 25/11/2036                              | 116                                 | 28                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/05/2037                                    | 613                                 | 254                              | 0,01                      | FACT S.A.                                                                  |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 25/11/2036                                    | 84                                  | 24                               | 0,00                      | 2,935 % éch. 22/09/2031                                                    | 4 302                               | 4 310                            | 0,15                      | 3,963 % éch. 25/12/2046                              | 162                                 | 70                               | 0,00                      |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust        |                                     |                                  |                           | First Mobility SARL                                                        |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/12/2036                              | 733                                 | 341                              | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/10/2036                                    | 37                                  | 27                               | 0,00                      | 2,809 % éch. 14/10/2032                                                    | 9 976                               | 9 991                            | 0,35                      | 4,063 % éch. 25/09/2036                              | 648                                 | 193                              | 0,01                      |
| RMAC Securities PLC                                        |                                     |                                  |                           | First Mobility Swiss Lease                                                 |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/12/2046                              | 445                                 | 192                              | 0,01                      |
| 2,667 % éch. 12/06/2044                                    | € 2 344                             | 2 263                            | 0,08                      | 2,959 % éch. 23/09/2033                                                    | 19 243                              | 19 269                           | 0,67                      | 4,163 % éch. 25/11/2036                              | 164                                 | 65                               | 0,00                      |
| 2,827 % éch. 12/06/2044                                    | 236                                 | 226                              | 0,01                      | Fulvia SPV SRL                                                             |                                     |                                  |                           | 4,223 % éch. 25/12/2046                              | 81                                  | 35                               | 0,00                      |
| 4,036 % éch. 12/06/2044                                    | £ 246                               | 281                              | 0,01                      | 3,030 % éch. 23/12/2041                                                    | 17 476                              | 17 515                           | 0,61                      | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust         |                                     |                                  |                           |
| 4,136 % éch. 12/06/2044                                    | 2 454                               | 2 785                            | 0,10                      | Golden Bar Securitisation SRL                                              |                                     |                                  |                           | 5,713 % éch. 25/03/2035                              | 1 000                               | 825                              | 0,03                      |
| Santander Residential FT                                   |                                     |                                  |                           | 3,436 % éch. 22/09/2043                                                    | 4 135                               | 4 159                            | 0,15                      | HSI Asset Securitization Corp. Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 3,088 % éch. 18/10/2068                                    | € 21 182                            | 21 236                           | 0,75                      | 5,286 % éch. 22/09/2043                                                    | 764                                 | 780                              | 0,03                      | 3,983 % éch. 25/12/2036                              | 183                                 | 41                               | 0,00                      |
| Sapphire Trust Central Finance                             |                                     |                                  |                           | Hill FL BV                                                                 |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/12/2036                              | 878                                 | 185                              | 0,01                      |
| 4,999 % éch. 12/02/2067                                    | AUD 201                             | 122                              | 0,01                      | 2,909 % éch. 18/10/2033                                                    | 7 600                               | 7 601                            | 0,27                      | 4,138 % éch. 25/05/2037                              | 2 543                               | 2 226                            | 0,08                      |
| Southern Pacific Securities PLC                            |                                     |                                  |                           | 2,929 % éch. 18/10/2032                                                    | 3 040                               | 3 042                            | 0,11                      | 4,203 % éch. 25/12/2036                              | 508                                 | 107                              | 0,00                      |
| 2,881 % éch. 10/03/2044                                    | € 641                               | 638                              | 0,02                      | 2,939 % éch. 18/06/2034                                                    | 8 600                               | 8 609                            | 0,30                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.                  |                                     |                                  |                           |
| Stratton Mortgage Funding PLC                              |                                     |                                  |                           | Koromo Italy Compartment                                                   |                                     |                                  |                           | 4,693 % éch. 25/06/2035                              | 4 968                               | 4 183                            | 0,15                      |
| 4,649 % éch. 28/06/2050                                    | £ 7 390                             | 8 582                            | 0,30                      | 2,905 % éch. 26/02/2032                                                    | 5 941                               | 5 953                            | 0,21                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 5,496 % éch. 20/06/2060                                    | 11 900                              | 13 836                           | 0,49                      | Red & Black Auto Italy SRL                                                 |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/06/2037                              | 900                                 | 703                              | 0,03                      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust             |                                     |                                  |                           | 3,019 % éch. 28/07/2036                                                    | 7 434                               | 7 466                            | 0,26                      | 6,337 % éch. 25/08/2036                              | 1 806                               | 912                              | 0,03                      |
| 4,274 % éch. 25/02/2036                                    | \$ 43                               | 28                               | 0,00                      | SC Sweden SARL                                                             |                                     |                                  |                           | MASTR Asset-Backed Securities Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 5,057 % éch. 25/10/2035                                    | 55                                  | 43                               | 0,00                      | 2,825 % éch. 25/12/2039                                                    | 6 400                               | 6 408                            | 0,22                      | 3,863 % éch. 25/11/2036                              | 123                                 | 30                               | 0,00                      |
| SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                           | VCL Multi-Compartment S.A.                                                 |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/08/2036                              | 209                                 | 63                               | 0,00                      |
| 6,114 % éch. 25/02/2037                                    | 36                                  | 30                               | 0,00                      | 2,394 % éch. 21/03/2033                                                    | 16 500                              | 16 509                           | 0,58                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                              | 115                                 | 33                               | 0,00                      |
| TBW Mortgage-Backed Trust                                  |                                     |                                  |                           | 2,715 % éch. 21/11/2032                                                    | 11 318                              | 11 329                           | 0,40                      | 4,243 % éch. 25/08/2036                              | 753                                 | 227                              | 0,01                      |
| 6,300 % éch. 25/03/2037                                    | 7 830                               | 1 301                            | 0,05                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust               |                                     |                                  |                           |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                            |                                     |                                  |                           | <b>PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES</b>                                 |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/11/2037                              | 3 101                               | 808                              | 0,03                      |
| 4,984 % éch. 20/04/2051                                    | £ 2 106                             | 2 447                            | 0,09                      | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/04/2047                              | 1 335                               | 436                              | 0,02                      |
| 5,284 % éch. 20/04/2051                                    | 1 264                               | 1 469                            | 0,05                      | 3,983 % éch. 25/10/2036                                                    | \$ 1 660                            | 549                              | 0,02                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               |                                     |                                  |                           |
| 5,984 % éch. 20/04/2051                                    | 1 053                               | 1 226                            | 0,04                      | 3,983 % éch. 25/12/2036                                                    | 390                                 | 87                               | 0,00                      | 3,873 % éch. 25/02/2037                              | 888                                 | 241                              | 0,01                      |
| 6,147 % éch. 20/07/2053                                    | 423                                 | 493                              | 0,02                      | 4,043 % éch. 25/07/2036                                                    | 85                                  | 63                               | 0,00                      | 3,893 % éch. 25/01/2037                              | 87                                  | 35                               | 0,00                      |
| 6,984 % éch. 20/04/2051                                    | 843                                 | 980                              | 0,04                      | 4,063 % éch. 25/01/2037                                                    | 6 688                               | 3 174                            | 0,11                      | 3,903 % éch. 25/10/2036                              | 96                                  | 37                               | 0,00                      |
| 7,247 % éch. 20/07/2053                                    | 400                                 | 465                              | 0,02                      | 4,323 % éch. 25/02/2037                                                    | 2 466                               | 885                              | 0,03                      | 3,943 % éch. 25/03/2037                              | 290                                 | 102                              | 0,00                      |
| 7,984 % éch. 20/04/2051                                    | 526                                 | 613                              | 0,02                      | 4,738 % éch. 25/11/2033                                                    | 494                                 | 446                              | 0,02                      | 3,963 % éch. 25/09/2036                              | 51                                  | 15                               | 0,00                      |
| 8,247 % éch. 20/07/2053                                    | 400                                 | 466                              | 0,02                      | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates     |                                     |                                  |                           | 3,963 % éch. 25/02/2037                              | 97                                  | 37                               | 0,00                      |
| Towd Point Mortgage Trust                                  |                                     |                                  |                           | 5,713 % éch. 25/06/2034                                                    | 1 020                               | 865                              | 0,03                      | 4,013 % éch. 25/03/2037                              | 290                                 | 102                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/03/2058                                    | \$ 1 332                            | 1 160                            | 0,04                      | Amerquest Mortgage Securities Trust                                        |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/09/2036                              | 10 271                              | 3 017                            | 0,11                      |
| Tower Bridge Funding PLC                                   |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/10/2036                                                    | 2 950                               | 780                              | 0,03                      | 4,663 % éch. 25/08/2034                              | 397                                 | 368                              | 0,01                      |
| 4,627 % éch. 20/05/2066                                    | £ 688                               | 800                              | 0,03                      | Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 25/02/2035                              | 2 379                               | 1 737                            | 0,06                      |
| Uropa Securities PLC                                       |                                     |                                  |                           | 3,402 % éch. 25/04/2034                                                    | 722                                 | 632                              | 0,02                      | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                |                                     |                                  |                           |
| 2,512 % éch. 10/10/2040                                    | € 1 549                             | 1 481                            | 0,05                      | 4,763 % éch. 25/01/2036                                                    | 4 000                               | 3 125                            | 0,11                      | 3,933 % éch. 25/04/2037                              | 224                                 | 100                              | 0,00                      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust              |                                     |                                  |                           | Argent Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                   |                                     |                                  |                           |
| 3,236 % éch. 25/10/2036                                    | \$ 16                               | 13                               | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/09/2036                                                    | 785                                 | 218                              | 0,01                      | 4,293 % éch. 25/04/2037                              | 2 091                               | 625                              | 0,02                      |
| 3,781 % éch. 25/05/2037                                    | 30                                  | 23                               | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/06/2036                                                    | 433                                 | 100                              | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/04/2037                              | 2 091                               | 625                              | 0,02                      |
| 4,034 % éch. 25/12/2036                                    | 182                                 | 147                              | 0,01                      | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates            |                                     |                                  |                           | 6,465 % éch. 25/09/2046                              | 266                                 | 76                               | 0,00                      |
| 4,543 % éch. 25/10/2044                                    | 40                                  | 34                               | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/01/2036                                                    | 1 063                               | 864                              | 0,03                      | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| 4,679 % éch. 25/12/2035                                    | 4                                   | 3                                | 0,00                      | Asset-Backed Funding Certificates Trust                                    |                                     |                                  |                           | 6,532 % éch. 25/10/2036                              | 145                                 | 21                               | 0,00                      |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 25/06/2035                                                    | 329                                 | 278                              | 0,01                      | NovaStar Mortgage Funding Trust                      |                                     |                                  |                           |
| 4,514 % éch. 25/04/2047                                    | 282                                 | 209                              | 0,01                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | 2,675 % éch. 25/06/2036                              | 70                                  | 46                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2036                                    | 78                                  | 49                               | 0,00                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/09/2036                              | 126                                 | 42                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2037                                    | 20                                  | 16                               | 0,00                      |                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/05/2036                              | 43                                  | 38                               | 0,00                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/10/2036                              | 995                                 | 404                              | 0,02                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | Option One Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,863 % éch. 25/07/2036                              | 9 106                               | 3 594                            | 0,13                      |



| DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 3,943 % éch. 25/04/2037                                               | \$ 11 811                           | € 5 911                 |                                  | 0,21                      | CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC            |                                     |                         |                                  |                           | 3,483 % éch. 20/04/2038 | € 11 100                            | € 11 116                |                                  | 0,39                      |
| 4,093 % éch. 25/04/2037                                               | 601                                 | 257                     |                                  | 0,01                      | 3,823 % éch. 15/08/2033                           | € 1 000                             | € 1 002                 |                                  | 0,03                      | 4,098 % éch. 20/04/2038 | 3 800                               | 3 807                   |                                  | 0,13                      |
| 4,203 % éch. 25/01/2037                                               | 213                                 | 108                     |                                  | 0,00                      | Dryden Euro CLO DAC                               |                                     |                         |                                  |                           | Toro European CLO DAC   |                                     |                         |                                  |                           |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed<br>Pass-Through Certificates |                                     |                         |                                  |                           | 3,143 % éch. 15/05/2034                           | 639                                 | 639                     |                                  | 0,02                      | 3,070 % éch. 12/01/2032 | 4 755                               | 4 760                   |                                  | 0,17                      |
| 4,498 % éch. 25/08/2035                                               | 962                                 | 844                     |                                  | 0,03                      | Euro-Galaxy CLO DAC                               |                                     |                         |                                  |                           | 3,194 % éch. 15/07/2034 | 3 673                               | 3 677                   |                                  | 0,13                      |
| Renaissance Home Equity Loan Trust                                    |                                     |                         |                                  |                           | 3,233 % éch. 15/02/2034                           | 4 994                               | 5 000                   |                                  | 0,17                      | Voya Euro CLO DAC       | 7 300                               | 7 305                   |                                  | 0,26                      |
| 5,563 % éch. 25/09/2037                                               | 103                                 | 72                      |                                  | 0,00                      | Fair Oaks Loan Funding DAC                        |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 5,612 % éch. 25/04/2037                                               | 10 873                              | 2 263                   |                                  | 0,08                      | 3,204 % éch. 15/10/2034                           | 4 000                               | 4 006                   |                                  | 0,14                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 5,879 % éch. 25/06/2037                                               | 3 494                               | 729                     |                                  | 0,03                      | 3,439 % éch. 15/10/2036                           | 7 700                               | 7 704                   |                                  | 0,27                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 7,238 % éch. 25/09/2037                                               | 832                                 | 273                     |                                  | 0,01                      | FCT Ponant                                        |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| Residential Asset Mortgage Products Trust                             |                                     |                         |                                  |                           | 2,855 % éch. 27/09/2038                           | 5 611                               | 5 614                   |                                  | 0,20                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,708 % éch. 25/10/2035                                               | 1 500                               | 1 146                   |                                  | 0,04                      | Fondo de Titulización Santander Consumo           |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| Residential Asset Securities Corp. Trust                              |                                     |                         |                                  |                           | 3,165 % éch. 25/10/2040                           | 1 000                               | 998                     |                                  | 0,03                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,023 % éch. 25/11/2036                                               | 539                                 | 438                     |                                  | 0,02                      | FTA Santander Consumo                             |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,723 % éch. 25/01/2036                                               | 3 300                               | 2 761                   |                                  | 0,10                      | 3,538 % éch. 20/07/2038                           | 568                                 | 569                     |                                  | 0,02                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                        |                                     |                         |                                  |                           | 3,888 % éch. 20/07/2038                           | 568                                 | 570                     |                                  | 0,02                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 3,943 % éch. 25/07/2036                                               | 176                                 | 49                      |                                  | 0,00                      | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/07/2036                                               | 172                                 | 48                      |                                  | 0,00                      | 2,918 % éch. 25/10/2035                           | 4 337                               | 4 341                   |                                  | 0,15                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/07/2036                                               | 148                                 | 41                      |                                  | 0,00                      | 3,095 % éch. 25/02/2034                           | 4 486                               | 4 503                   |                                  | 0,16                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| Soundview Home Loan Trust                                             |                                     |                         |                                  |                           | 3,158 % éch. 23/12/2036                           | 6 800                               | 6 809                   |                                  | 0,24                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 3,761 % éch. 25/04/2035                                               | 562                                 | 498                     |                                  | 0,02                      | Golden Bar Securitisation SRL                     |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 3,983 % éch. 25/02/2037                                               | 245                                 | 57                      |                                  | 0,00                      | 3,136 % éch. 20/12/2044                           | 8 569                               | 8 591                   |                                  | 0,30                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/06/2037                                               | 114                                 | 69                      |                                  | 0,00                      | Grosvenor Place CLO DAC                           |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/02/2037                                               | 362                                 | 85                      |                                  | 0,00                      | 3,383 % éch. 15/08/2039                           | 12 700                              | 12 713                  |                                  | 0,45                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,213 % éch. 25/05/2036                                               | 9 017                               | 7 225                   |                                  | 0,25                      | Harvest CLO DAC                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 4,763 % éch. 25/09/2037                                               | 6 692                               | 4 402                   |                                  | 0,16                      | 3,188 % éch. 20/10/2032                           | 1 377                               | 1 377                   |                                  | 0,05                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                 |                                     |                         |                                  |                           | 3,523 % éch. 25/07/2037 (b)                       | 7 200                               | 7 200                   |                                  | 0,25                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
| 5,513 % éch. 25/04/2031                                               | 1 079                               | 1 001                   |                                  | 0,04                      | 4,063 % éch. 25/07/2037 (b)                       | 2 100                               | 2 100                   |                                  | 0,07                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     | 87 295                  |                                  | 3,06                      | Hayfin Emerald CLO DAC                            |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,244 % éch. 15/10/2034                           | 3 000                               | 3 001                   |                                  | 0,11                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,454 % éch. 15/10/2038                           | 11 100                              | 11 109                  |                                  | 0,39                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,498 % éch. 18/10/2039                           | 2 200                               | 2 202                   |                                  | 0,08                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Henley CLO DAC                                    |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,135 % éch. 25/12/2035                           | 5 000                               | 5 003                   |                                  | 0,18                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | ICG Euro CLO DAC                                  |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,455 % éch. 26/01/2038                           | 9 400                               | 9 409                   |                                  | 0,33                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 4,055 % éch. 26/01/2038                           | 1 300                               | 1 307                   |                                  | 0,05                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 4,550 % éch. 26/01/2038                           | 1 000                               | 1 005                   |                                  | 0,04                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Indigo Credit Management DAC                      |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/07/2038                           | 10 800                              | 10 817                  |                                  | 0,38                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,464 % éch. 15/10/2037                           | 11 000                              | 11 012                  |                                  | 0,39                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Invesco Euro CLO DAC                              |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,260 % éch. 30/10/2038                           | 4 000                               | 4 005                   |                                  | 0,14                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,277 % éch. 15/07/2037                           | 15 600                              | 15 619                  |                                  | 0,55                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,454 % éch. 22/10/2036                           | 10 300                              | 10 312                  |                                  | 0,36                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Lyra Music Assets Delaware LP                     |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 5,760 % éch. 22/12/2064                           | \$ 16 461                           | 14 498                  |                                  | 0,51                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Madison Park Euro Funding DAC                     |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,004 % éch. 15/07/2032                           | € 15 384                            | 15 403                  |                                  | 0,54                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,384 % éch. 15/07/2036                           | 7 200                               | 7 197                   |                                  | 0,25                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Marzio Finance SRL                                |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 2,641 % éch. 30/06/2050                           | 7 920                               | 7 931                   |                                  | 0,28                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 2,751 % éch. 28/09/2049                           | 9 270                               | 9 296                   |                                  | 0,33                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | MV Credit Euro CLO DAC                            |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,583 % éch. 15/02/2038                           | 8 000                               | 8 006                   |                                  | 0,28                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Palmer Square European Loan Funding DAC           |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,134 % éch. 15/07/2035                           | 15 644                              | 15 653                  |                                  | 0,55                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,273 % éch. 15/05/2034                           | 8 497                               | 8 508                   |                                  | 0,30                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 4,173 % éch. 15/05/2034                           | 8 100                               | 8 126                   |                                  | 0,28                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Penta CLO DAC                                     |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,015 % éch. 25/07/2036                           | 12 300                              | 12 313                  |                                  | 0,43                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Providus CLO DAC                                  |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,513 % éch. 15/11/2039                           | 8 600                               | 8 610                   |                                  | 0,30                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Rockford Tower Europe CLO DAC                     |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,121 % éch. 24/01/2035                           | 4 000                               | 4 001                   |                                  | 0,14                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Sculptor European CLO DAC                         |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,082 % éch. 10/10/2034                           | 20 000                              | 20 013                  |                                  | 0,70                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,254 % éch. 15/10/2034                           | 2 870                               | 2 875                   |                                  | 0,10                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | SLM Student Loan Trust                            |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 2,565 % éch. 25/10/2039                           | 664                                 | 621                     |                                  | 0,02                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 4,542 % éch. 25/01/2075                           | \$ 8 899                            | 7 779                   |                                  | 0,27                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | St. Paul's CLO DAC                                |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,000 % éch. 17/07/2030                           | € 69                                | 69                      |                                  | 0,00                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,145 % éch. 25/10/2035                           | 7 300                               | 7 306                   |                                  | 0,26                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,178 % éch. 20/07/2035                           | 5 000                               | 5 003                   |                                  | 0,18                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | Tikehau CLO DAC                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           | 3,184 % éch. 15/01/2035                           | 10 000                              | 10 008                  |                                  | 0,35                      |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                         |                                  |                           |                                                   |                                     |                         |                                  |                           |                         |                                     |                         |                                  |                           |

| CONTRATS DE MISE EN PENSION           |              |                   |                 |                      |                                                                                |                  |                                          |                                                                    |                     |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                                    | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
| COM                                   | 2,270 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | € 226 700            | Bpifrance SACA 1.000 %<br>éch. 25/05/2027<br>UNEDIC 0,250 % éch.<br>25/11/2029 | € (31 715)       | € 226 700                                | € 226 714                                                          | 7,94                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                                                | € (233 274 )     | € 226 700                                | € 226 714                                                          | 7,94                |

478 PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC



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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026           | 1 021              | € 942                                   | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Long  | 09/2026           | 5 606              | 2 246                                   | 0,08                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Long  | 09/2026           | 678                | 867                                     | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026           | 1 260              | (113)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 2 658              | 619                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 1 959              | 1 502                                   | 0,05                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 65                 | (74)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 560                | (1 242)                                 | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 1 523              | 3 936                                   | 0,14                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 1 016              | 2 524                                   | 0,09                   |
|                                                                                               |       |                   |                    | € 11 207                                | 0,39                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | € 11 207                                | 0,39                   |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

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

| Entité de référence             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| AT&T, Inc.                      | 1,000 %              | 20/06/2028      | \$ 1 100                         | € 17                                    | 0,00                   |
| Danske Bank A/S                 | 1,000                | 20/12/2030      | € 13 300                         | 29                                      | 0,00                   |
| Deutsche Bank AG                | 1,000                | 20/12/2029      | 2 600                            | 37                                      | 0,00                   |
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 1 000                         | 5                                       | 0,00                   |
| Ford Motor Co.                  | 5,000                | 20/12/2028      | 3 100                            | (142)                                   | (0,01)                 |
| Lloyds Banking Group PLC        | 1,000                | 20/12/2030      | € 12 600                         | 7                                       | 0,00                   |
| Prudential Financial, Inc.      | 1,000                | 20/06/2031      | \$ 200                           | 1                                       | 0,00                   |
| Stellantis NV                   | 5,000                | 20/12/2030      | € 1 400                          | (29)                                    | 0,00                   |
| Worldline S.A.                  | 5,000                | 20/12/2030      | 6 900                            | (25)                                    | 0,00                   |
| Électricité de France S.A.      | 1,000                | 20/06/2030      | 7 700                            | 64                                      | 0,01                   |
|                                 |                      |                 |                                  | € (36)                                  | 0,00                   |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans             | 5,000 %              | 20/12/2027      | \$ 672                           | € 36                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans             | 5,000                | 20/06/2030      | 294                              | 3                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans             | 5,000                | 20/12/2030      | 7 546                            | 54                                      | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans             | 5,000                | 20/06/2031      | 20 493                           | 393                                     | 0,02                   |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000                | 20/12/2030      | 6 910                            | 1                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                | 20/06/2031      | 17 750                           | 62                                      | 0,00                   |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans   | 5,000                | 20/06/2031      | € 124 560                        | 4 001                                   | 0,14                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 9 940                            | 65                                      | 0,00                   |
|                                            |                      |                 |                                  | € 4 615                                 | 0,16                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                              | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 141 960         | € (881)                                 | (0,03)                 |
| À recevoir                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,700     | 28/03/2034      | 1 000             | 43                                      | 0,00                   |
| À recevoir                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 15/06/2032      | ¥ 5 164 600       | 300                                     | 0,01                   |
| À recevoir                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,700     | 18/09/2029      | 5 070 000         | 14                                      | 0,00                   |
| À recevoir                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/09/2034      | 2 610 000         | 318                                     | 0,01                   |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,868     | 05/05/2032      | \$ 15 100         | (1 344)                                 | (0,05)                 |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,040     | 25/05/2032      | 7 800             | (623)                                   | (0,02)                 |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,068     | 11/05/2032      | 15 400            | (1 227)                                 | (0,04)                 |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,153     | 18/05/2032      | 15 400            | (1 148)                                 | (0,04)                 |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,750     | 21/06/2053      | 39 900            | 7 130                                   | 0,25                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030      | 15 500            | (97)                                    | 0,00                   |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 21/06/2033      | 3 085             | (115)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,231     | 10/09/2034      | 4 000             | 210                                     | 0,01                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,232     | 10/09/2034      | 2 250             | 121                                     | 0,00                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,240     | 16/09/2034      | 1 300             | 69                                      | 0,00                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,248     | 18/09/2034      | 4 000             | 206                                     | 0,01                   |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2030      | 135 900           | (1 320)                                 | (0,05)                 |

## Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 %   | 19/03/2032      | \$ 17 370         | € (65)                            | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2032      | 3 090             | 60                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2035      | 1 940             | 50                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2055      | 34 200            | 58                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2055      | 38 100            | 1 370                             | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,278     | 16/09/2034      | 5 200             | 261                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 06/03/2033      | 2 600             | (79)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 14/06/2033      | 9 700             | (288)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370     | 12/07/2053      | 2 800             | (332)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,375     | 15/10/2034      | 4 200             | (152)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,385     | 17/10/2034      | 2 700             | (96)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,395     | 17/10/2034      | 5 700             | (199)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400     | 17/10/2034      | 2 300             | (80)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420     | 24/05/2033      | 7 600             | (180)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425     | 01/03/2033      | 40 200            | (925)                             | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,446     | 23/10/2034      | 2 600             | (83)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450     | 07/03/2033      | 5 000             | (110)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450     | 11/10/2034      | 4 200             | (130)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,463     | 23/10/2034      | 4 600             | (141)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,465     | 30/10/2034      | 9 300             | (281)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,481     | 29/10/2034      | 4 600             | (134)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,495     | 30/10/2034      | 4 400             | (124)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 22/06/2030      | 12 200            | (122)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      | 194 100           | 771                               | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      | 10 530            | 226                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 23 720            | (46)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 4 740             | 37                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 21/06/2033      | 8 100             | (155)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      | 212 800           | 5 451                             | 0,19                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/06/2054      | 27 000            | 769                               | 0,03                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,515     | 06/11/2034      | 8 400             | (222)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525     | 02/03/2030      | 1 800             | (17)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,532     | 20/08/2034      | 4 000             | 130                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,550     | 21/08/2034      | 30 400            | 949                               | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,551     | 17/09/2035      | 3 300             | 114                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,555     | 05/03/2054      | 1 000             | (86)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,569     | 14/08/2034      | 4 400             | 131                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,594     | 09/01/2034      | 2 300             | 48                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,595     | 19/08/2034      | 4 400             | 124                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 17/01/2034      | 2 200             | 54                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,613     | 22/08/2034      | 4 000             | 107                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,620     | 31/01/2034      | 1 200             | (18)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,645     | 07/08/2034      | 4 000             | 99                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,648     | 08/01/2034      | 2 300             | 50                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 10/07/2033      | 4 600             | (70)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 05/03/2034      | 2 400             | (33)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,655     | 24/01/2034      | 1 300             | (17)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,665     | 24/01/2034      | 2 300             | (29)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,670     | 08/01/2034      | 2 500             | 51                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 13/08/2034      | 4 000             | 90                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684     | 03/01/2034      | 1 200             | 23                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,685     | 24/01/2034      | 2 300             | (26)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 05/03/2034      | 1 200             | (13)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,710     | 05/03/2034      | 2 400             | (26)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,715     | 07/08/2034      | 4 980             | 103                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,725     | 07/02/2034      | 1 100             | (9)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730     | 03/08/2033      | 1 300             | (13)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 07/08/2033      | 1 500             | (14)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 23/01/2034      | 1 200             | (10)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,738     | 23/01/2034      | 700               | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2026      | 329 400           | 2 677                             | 0,09                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 298 740           | 4 470                             | 0,16                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 30 200            | (866)                             | (0,03)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 15/03/2030      | 46 000            | 1 383                             | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      | 141 700           | 2 822                             | 0,10                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 9 040             | 146                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 20 910            | 447                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 3 300             | (42)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2032      | 169 780           | 3 436                             | 0,12                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2032      | 51 280            | 1 129                             | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/03/2033      | 81 616            | 1 567                             | 0,06                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 12/07/2033      | 4 000             | (35)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 02/01/2034      | 1 200             | 18                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 240               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 120               | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 07/05/2035      | 5 400             | (59)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035      | 20 000            | 491                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 3 350             | 106                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/06/2036      | 1 340             | 10                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760     | 23/08/2033      | 4 700             | (34)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,783     | 07/02/2034      | 1 000             | (5)                               | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,795 %   | 06/08/2034      | \$ 4 000          | € 60                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 10/03/2028      | 5 000             | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 05/09/2028      | 8 500             | 23                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 22/08/2030      | 1 200             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 30/08/2033      | 2 300             | (11)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810     | 02/01/2034      | 1 200             | 14                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830     | 12/10/2053      | 700               | (34)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,840     | 08/01/2035      | 2 500             | (14)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842     | 26/12/2033      | 1 200             | 11                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 08/01/2035      | 1 200             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854     | 29/12/2033      | 2 200             | 19                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 21/02/2034      | 4 600             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,865     | 20/11/2034      | 4 300             | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 05/03/2035      | 1 300             | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 17/10/2053      | 700               | (30)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,874     | 05/03/2035      | 2 700             | 26                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 16/10/2053      | 700               | (29)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,884     | 25/03/2035      | 3 200             | 27                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,885     | 12/07/2034      | 31 200            | 265                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,896     | 08/01/2035      | 5 200             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,899     | 11/03/2035      | 4 300             | 34                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 30/08/2033      | 4 700             | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 10/04/2034      | 2 300             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 15/04/2034      | 1 200             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 08/01/2035      | 2 500             | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,908     | 04/03/2035      | 2 600             | 20                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,933     | 06/01/2035      | 5 200             | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 22/02/2029      | 6 800             | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 19/12/2033      | 2 400             | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 16/04/2034      | 2 500             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 27/02/2029      | 2 300             | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 15/01/2035      | 2 400             | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,994     | 02/07/2034      | 3 400             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 30/12/2034      | 4 200             | 29                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 04/10/2033      | 4 500             | 42                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 15/12/2033      | 2 200             | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060     | 02/07/2034      | 2 400             | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,071     | 15/01/2035      | 4 000             | 40                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,078     | 29/04/2034      | 2 400             | 25                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 17/04/2034      | 2 300             | 25                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 05/06/2034      | 2 700             | (10)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 22/04/2034      | 2 300             | 27                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 30/04/2034      | 12 800            | 140                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,100     | 21/01/2035      | 2 100             | 25                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,105     | 24/04/2034      | 6 600             | 82                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,130     | 03/05/2034      | 2 300             | 30                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 12/10/2033      | 2 100             | 36                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175     | 10/10/2033      | 2 100             | 39                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200     | 18/10/2033      | 1 800             | 36                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220     | 20/10/2033      | 2 200             | 46                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230     | 23/10/2033      | 1 100             | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 22/11/2033      | 2 200             | (34)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255     | 23/10/2033      | 1 100             | 26                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393     | 25/10/2033      | 1 100             | 35                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435     | 01/11/2033      | 1 100             | 38                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 31/10/2033      | 1 300             | 46                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 01/11/2033      | 2 200             | 79                                | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,998     | 04/01/2027      | BRL 15 500        | (241)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,037    | 04/01/2027      | 4 200             | (64)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,041    | 04/01/2027      | 17 100            | (263)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,072    | 04/01/2027      | 7 860             | (103)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,090    | 04/01/2027      | 32 200            | (488)                             | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,098    | 04/01/2027      | 23 760            | (310)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,138    | 04/01/2027      | 8 000             | (119)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,165    | 04/01/2027      | 12 050            | (154)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,170    | 04/01/2027      | 20 100            | (256)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,183    | 04/01/2027      | 36 110            | (457)                             | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,203    | 04/01/2027      | 28 140            | (354)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,210    | 04/01/2027      | 4 050             | (51)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,256    | 04/01/2027      | 28 110            | (347)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,328    | 04/01/2027      | 21 530            | (259)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,800    | 02/01/2031      | 143 700           | (830)                             | (0,03)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,841    | 02/01/2031      | 47 600            | (268)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,172    | 02/01/2031      | 43 100            | (157)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,180    | 02/01/2031      | 175 800           | (569)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,245    | 02/01/2031      | 1 900             | (6)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,255    | 02/01/2031      | 17 400            | (54)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,291    | 02/01/2029      | 25 100            | (96)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,350    | 02/01/2031      | 4 100             | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,354    | 02/01/2029      | 49 900            | (184)                             | (0,01)              |

## Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,435 %  | 02/01/2031      | BRL 1 350         | € (3)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,440    | 02/01/2031      | 1 350             | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,520    | 02/01/2031      | 12 900            | (28)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      | 7 300             | (14)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an         | 13,670    | 02/01/2031      | 1 700             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,681    | 02/01/2031      | 63 950            | (66)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,724    | 02/01/2031      | 13 000            | (14)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,725    | 02/01/2031      | 3 350             | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,790    | 02/01/2031      | 3 400             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,882    | 02/01/2031      | 17 000            | (8)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 13,927    | 04/01/2027      | 38 200            | (55)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an         | 14,009    | 04/01/2027      | 27 200            | (32)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR NZD à 3 mois        | 4,750     | 19/06/2029      | NZD 9 700         | 127                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR 11 600        | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,740     | 15/04/2036      | 12 800            | 0                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,800     | 16/04/2036      | 13 000            | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,800     | 21/04/2036      | 6 094             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,820     | 16/04/2036      | 27 400            | 9                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,822     | 08/04/2036      | 19 400            | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,830     | 16/04/2036      | 13 500            | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,855     | 16/04/2036      | 13 600            | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,860     | 17/04/2036      | 20 700            | 10                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,885     | 17/04/2036      | 9 400             | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,910     | 22/04/2036      | 18 520            | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,950     | 22/04/2036      | 9 800             | 8                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,950     | 07/05/2036      | 3 800             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,960     | 22/04/2036      | 5 820             | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,000     | 03/01/2031      | 5 700             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,000     | 23/04/2036      | 3 000             | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,001     | 06/01/2031      | 5 700             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,010     | 07/01/2031      | 5 600             | 8                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,010     | 08/05/2036      | 2 400             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,030     | 07/01/2031      | 5 600             | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,053     | 07/01/2031      | 5 600             | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,058     | 07/01/2031      | 5 600             | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,063     | 08/01/2031      | 17 000            | 28                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,080     | 08/01/2031      | 7 900             | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,080     | 24/04/2036      | 3 500             | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,140     | 28/04/2036      | 3 100             | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,150     | 28/04/2036      | 3 600             | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,203     | 10/01/2031      | 28 200            | 54                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,360     | 07/08/2028      | 26 500            | 32                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,380     | 04/08/2028      | 11 700            | 15                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,400     | 07/08/2028      | 26 500            | 34                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,410     | 31/07/2028      | 12 600            | 16                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,410     | 04/08/2028      | 28 300            | 36                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,410     | 07/08/2028      | 7 900             | 10                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,415     | 31/07/2028      | 10 100            | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,415     | 04/08/2028      | 11 800            | 15                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,420     | 31/07/2028      | 37 700            | 49                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,421     | 04/08/2028      | 12 000            | 16                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,426     | 01/08/2028      | 15 200            | 20                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,428     | 31/07/2028      | 25 100            | 33                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,460     | 01/08/2028      | 25 700            | 34                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,460     | 02/08/2028      | 26 100            | 35                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,464     | 02/08/2028      | 26 100            | 35                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,543     | 04/08/2028      | 12 000            | 17                                | 0,00                |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,550     | 03/08/2028      | 24 200            | 35                                | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 20/09/2033      | AUD 13 200        | (86)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 20/03/2034      | 13 500            | (76)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 18/09/2034      | 2 400             | (54)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CZK-PRIBOR à 6 mois     | 4,480     | 11/03/2036      | CZK 2 700         | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,830     | 09/12/2052      | € 26 700          | 3 020                             | 0,11                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 1,520     | 07/07/2027      | 9 600             | (32)                              | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,220     | 08/01/2035      | 1 500             | (68)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | 791 900           | (7 166)                           | (0,25)              |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,300     | 25/09/2029      | 5 400             | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,350     | 29/04/2030      | 4 600             | 68                                | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,360     | 07/10/2029      | 5 300             | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,380     | 31/12/2034      | 2 100             | (46)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 09/04/2030      | 2 800             | 38                                | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 12/02/2035      | 2 700             | 99                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,410     | 05/11/2034      | 3 100             | (58)                              | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,420     | 07/03/2035      | 1 500             | (46)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,450     | 05/05/2035      | 3 500             | 126                               | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,460     | 13/03/2035      | 2 600             | (71)                              | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,460     | 01/04/2035      | 1 600             | (47)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 501 960           | (4 794)                           | (0,17)              |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,510     | 09/04/2035      | 1 600             | 50                                | 0,00                |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 27/03/2035      | 1 600             | (39)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 09/04/2035      | 1 700             | 52                                | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir                          | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,550 %   | 16/04/2035      | € 3 600           | € 100                             | 0,00                |
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,590     | 19/08/2034      | 2 500             | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,650     | 14/08/2029      | 2 000             | (26)                              | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 05/03/2034      | 1 600             | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 77 500            | (650)                             | (0,02)              |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 04/03/2034      | 1 600             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 16/04/2029      | 2 400             | 9                                 | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 29/04/2034      | 1 600             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,780     | 02/05/2029      | 2 400             | 10                                | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,860     | 24/04/2029      | 3 600             | 24                                | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,950     | 12/06/2029      | 1 900             | 16                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 49 010            | 11                                | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,270     | 21/08/2033      | 1 600             | 88                                | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,450     | 20/10/2028      | 2 700             | 101                               | 0,00                |
| À recevoir                                                | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      | MXN 854 700       | (273)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                                | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      | 409 800           | (335)                             | (0,01)              |
|                                                           |                         |           |                 |                   | € 12 269                          | 0,43                |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés compensés</b> |                         |           |                 |                   | € 16 848                          | 0,59                |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | ADLER Real Estate AG                                | 5,000 %              | 20/12/2026      | € 1 200                          | € (7)                  | € 27                              | € 20         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement israélien | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 14 200                        | 53                     | 0                                 | 53           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement israélien | 1,000                | 20/12/2029      | 700                              | (17)                   | 29                                | 12           | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                               | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 395 800                        | (168)                  | 47                                | (121)        | (0,01)              |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement israélien | 1,000                | 20/12/2029      | \$ 200                           | (5)                    | 8                                 | 3            | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                               | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 186 000                        | (80)                   | 23                                | (57)         | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement israélien | 1,000                | 20/12/2029      | \$ 400                           | (9)                    | 16                                | 7            | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                               | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 138 800                        | (60)                   | 17                                | (43)         | 0,00                |
|              |                                                     |                      |                 |                                  | € (293)                | € 167                             | € (126)      | (0,01)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 5 150                          | € 1 006                | € (47)                            | € 959        | 0,03                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 18 420                           | 3 328                  | 100                               | 3 428        | 0,12                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 240                            | 442                    | (25)                              | 417          | 0,02                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 26 750                           | 4 727                  | 252                               | 4 979        | 0,17                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 34 700                           | 6 169                  | 289                               | 6 458        | 0,23                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | € 15 672               | € 569                             | € 16 241     | 0,57                |

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

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

#### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À payer            | Nvidia Corp. | 17 021                       | 5,620 %       | \$ 3 277          | 29/07/2026      | € 0                    | € (112)                           | € (112)      | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 47          | \$ 33             | € 0                | € 0                   | € 0                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 200          | AUD 279           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 33              | 47                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | DKK 323         | € 43              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 20 679        | 23 918            | 0                  | (88)                  | (88)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 874             | \$ 1 167          | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 6 368       | 1 881             | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 881        | PEN 6 366         | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 52 746          | BRL 269 448       | 0                  | (955)                 | (955)                                   | (0,03)              |
|              | 09/2026           | PEN 3 001       | \$ 873            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | 2 934           | 852               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 7 278 889   | 1 824             | 0                  | (179)                 | (179)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CNH 240         | 36                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CZK 1 778       | 85                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 3 832         | 4 439             | 51                 | 0                     | 51                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 17 893        | € 20 690          | 0                  | (82)                  | (82)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 202          | KWD 62            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 80              | ZAR 1 315         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3 147           | BRL 16 029        | 0                  | (65)                  | (65)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 56 294      | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 13           | IDR 226 592       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 3               | 56 677            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | 158             | KWD 48            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2029           | KWD 90          | \$ 310            | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 05/2030           | 507             | 1 746             | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,00                |
|              | 08/2030           | 209             | 704               | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 01/2031           | 855             | 2 882             | 66                 | 0                     | 66                                      | 0,00                |
|              | 06/2031           | 431             | 1 449             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 3 203       | € 1 961           | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 901           | AUD 1 481         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 008           | £ 873             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7 212           | \$ 8 368          | 108                | 0                     | 108                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 3 700         | € 4 289           | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | TRY 149 065     | \$ 3 117          | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 16 591       | TRY 794 370       | 171                | 0                     | 171                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 400             | ZAR 6 493         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 6 937         | \$ 7 913          | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 2 188         | € 2 520           | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 33 161      | \$ 9 461          | 7                  | (236)                 | (229)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 3 829        | PEN 13 053        | 6                  | (7)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 12 431      | \$ 3 543          | 0                  | (83)                  | (83)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 5 903 970   | 1 525             | 0                  | (138)                 | (138)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR 241 162     | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 09/2026           | PEN 6 572       | 1 914             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 4            | IDR 66 342        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 14              | PEN 49            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN 5 197       | \$ 1 519          | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 16 864          | 4 824             | 0                  | (78)                  | (78)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 13           | IDR 242 777       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 05/2027           | PEN 10 270      | \$ 2 892          | 0                  | (74)                  | (74)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 1 921       | 92                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 187          | ZAR 3 019         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 2 838       | \$ 812            | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
| DUB          | 10/2026           | 25 695          | 7 427             | 0                  | (64)                  | (64)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 100         | 69                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 239         | 35                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 128          | CNH 870           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 261             | ZAR 4 301         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | CNH 869         | \$ 128            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 69           | AUD 100           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 252         | \$ 177            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 982        | BRL 10 649        | 66                 | 0                     | 66                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 202             | ZAR 3 335         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | 5 118           | BRL 26 152        | 0                  | (91)                  | (91)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 177             | CAD 251           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 6 814           | BRL 35 075        | 0                  | (121)                 | (121)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 8               | IDR 143 341       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 1 299       | \$ 909            | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 10 674      | 2 074             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 37          | € 5               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 17            | DKK 129           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 064           | ¥ 936 388         | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 839           | \$ 5 620          | 77                 | 0                     | 77                                      | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | ¥ 548 396       | € 2 973           | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 199         | 102               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 862          | AUD 1 209         | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 760           | € 4 965           | 0                  | (73)                  | (73)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 276             | ZAR 4 490         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 129         | € 17              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 2 976         | ¥ 548 396         | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 908          | AUD 1 299         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 08/2026           | \$ 9 560        | € 8 375           | € 25               | € 0                   | € 25                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 1 884 561   | \$ 108 472        | 1 136              | 0                     | 1 136                                   | 0,04                |
|              | 09/2026           | TWD 1 672       | 53                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 49 065       | MXN 856 656       | 0                  | (305)                 | (305)                                   | (0,01)              |
|              | 10/2026           | 2 074           | BRL 10 909        | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | 220             | MXN 3 867         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 48          | \$ 33             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 72          | € 10              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4            | AUD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 28 199          | € 24 352          | 0                  | (313)                 | (313)                                   | (0,01)              |
| MYI          | 08/2026           | 33              | AUD 48            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 47 944        | £ 41 379          | 93                 | 0                     | 93                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 370           | € 427             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 990        | 5 275             | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           | £ 39 635        | 45 855            | 0                  | (94)                  | (94)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 34           | TRY 1 613         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 2               | IDR 40 500        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | 5 318           | € 4 608           | 0                  | (44)                  | (44)                                    | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | AUD 4 353       | 2 663             | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 3 676         | AUD 6 078         | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 18              | DKK 137           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 27 227          | ¥ 5 045 380       | 0                  | (74)                  | (74)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 37 406          | \$ 43 519         | 659                | 0                     | 659                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | ¥ 5 257 945     | € 28 538          | 241                | 0                     | 241                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 957          | PEN 3 277         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 6 090       | € 3 676           | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 137         | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 28 575        | ¥ 5 257 945       | 0                  | (242)                 | (242)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | PEN 3 287       | \$ 957            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 6            | IDR 104 169       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 11/2026           | NGN 131 018     | \$ 81             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 391         | 58                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 56 643        | £ 48 869          | 88                 | 0                     | 88                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 424 772         | \$ 483 349        | 119                | (2 126)               | (2 007)                                 | (0,07)              |
| SSB          | 07/2026           | £ 57 790        | € 66 625          | 0                  | (463)                 | (463)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$ 511 948      | 438 861           | 0                  | (8 923)               | (8 923)                                 | (0,31)              |
|              | 08/2026           | £ 47 949        | 55 505            | 0                  | (82)                  | (82)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 477 014      | 418 785           | 2 119              | 0                     | 2 119                                   | 0,07                |
|              | 07/2026           | 188             | CAD 259           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 155           | £ 874             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | € 6 937         | \$ 7 920          | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 874           | 1 155             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 168          | MXN 2 924         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 20            | DKK 148           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 60 420        | € 327             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 148         | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 327           | ¥ 60 420          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 124 693 416 | \$ 32 420         | 0                  | (2 721)               | (2 721)                                 | (0,10)              |
|              |                   |                 |                   | € 5 337            | € (18 000)            | € (12 663)                              | (0,44)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ 3 340 0,12

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN %DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|--------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                |                               |                            |                    |
| ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC               |                               |                            |                    |
| 2,700 % éch. 11/03/2023*                                       | € 8 200                       | € 492                      | 0,02               |
| Total des Autres actifs financiers                             |                               | € 492                      | 0,02               |
| <b>TITRES VENDUS À DÉCOUVERT</b>                               |                               |                            |                    |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                    |
| 6,000 % éch. 01/08/2056 (i)                                    | \$ 11 500                     | (10 251)                   | (0,36)             |
| 6,500 % éch. 01/08/2056 (i)                                    | 7 400                         | (6 688)                    | (0,23)             |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | € (16 939)                 | (0,59)             |
| Total des Investissements                                      |                               | € 4 494 930                | 157,51             |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | € (1 641 227)              | (57,51)            |
| Actif net                                                      |                               | € 2 853 703                | 100,00             |



## Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à rémunération en nature.

(d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(e) Titre à coupon zéro.

(f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(h) Affilié au Fonds.

(i) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des titres négociables et des instruments du marché monétaire.

(j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,11 %) :

| Description de l'émetteur                                    | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Corestate Capital Holding S.A.                               | 22/08/2023   | € 0      | € 0          | 0,00                |
| Kuwait Government International Bond 4,804 % éch. 20/04/2033 | 13/04/2026   | 6 234    | 6 374        | 0,22                |
| Mahle GmbH 7,125 % éch. 15/07/2032                           | 10/06/2026   | 15 987   | 16 145       | 0,56                |
| Project Dorchester 4,610 % éch. 04/01/2027                   | 10/12/2025   | 1 000    | 1 000        | 0,03                |
|                                                              |              | € 23 221 | € 23 519     | 0,81                |

Des titres d'une juste valeur globale de 0 € (31 décembre 2025 : 9 154 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2025 : 221 €) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 71 548 € (31 décembre 2025 : 57 847 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 13 593 € (31 décembre 2025 : 221 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur       |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 3 034                                                                           | € 3 932 082                                          | € 32 284                                          | € 3 967 400        |
| Fonds d'investissement                        | 285 882                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 285 882            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 226 700                                              | 0                                                 | 226 700            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 6 466                                                                             | 24 929                                               | 0                                                 | 31 395             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 492                                                  | 0                                                 | 492                |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (16 939)                                             | 0                                                 | (16 939)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 295 382</b>                                                                  | <b>€ 4 167 264</b>                                   | <b>€ 32 284</b>                                   | <b>€ 4 494 930</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur       |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 1                                                                               | € 3 617 218                                          | € 30 813                                          | € 3 648 032        |
| Fonds d'investissement                        | 24 703                                                                            | 230 150                                              | 0                                                 | 254 853            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 257 900                                              | 0                                                 | 257 900            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (3 463)                                                                           | 15 950                                               | 0                                                 | 12 487             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 1 230                                                | 0                                                 | 1 230              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 21 241</b>                                                                   | <b>€ 4 122 448</b>                                   | <b>€ 30 813</b>                                   | <b>€ 4 174 502</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | € (5)                                                      | € 0                     | € (5)                             | € S/O                                                      | € S/O                   | € S/O                             |
| BOA          | (265)                                                      | 394                     | 129                               | 1 038                                                      | (1 013)                 | 25                                |
| BPS          | 3 527                                                      | (3 540)                 | (13)                              | 578                                                        | (390)                   | 188                               |
| BRC          | 256                                                        | (227)                   | 29                                | 491                                                        | (366)                   | 125                               |
| CBK          | (224)                                                      | 201                     | (23)                              | (119)                                                      | 145                     | 26                                |
| DUB          | (79)                                                       | 0                       | (79)                              | 166                                                        | 0                       | 166                               |
| FAR          | (111)                                                      | 0                       | (111)                             | 496                                                        | (519)                   | (23)                              |
| GLM          | (145)                                                      | 245                     | 100                               | 33                                                         | 17                      | 50                                |
| GST          | 4 943                                                      | (4 933)                 | 10                                | 123                                                        | 0                       | 123                               |
| JPM          | 7 219                                                      | (7 198)                 | 21                                | 607                                                        | (588)                   | 19                                |
| MBC          | (313)                                                      | 499                     | 186                               | 40                                                         | 0                       | 40                                |
| MYC          | (36)                                                       | 0                       | (36)                              | 5                                                          | 0                       | 5                                 |
| MYI          | 31                                                         | 0                       | 31                                | 26                                                         | 0                       | 26                                |
| NSL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 130                                                        | 0                       | 130                               |
| RYL          | (44)                                                       | 0                       | (44)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 600                                                        | (796)                   | (196)                             | (68)                                                       | 60                      | (8)                               |
| SGG          | (9 268)                                                    | 9 446                   | 178                               | 4 581                                                      | (4 760)                 | (179)                             |
| SSB          | (25)                                                       | 0                       | (25)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | (2 721)                                                    | 2 808                   | 87                                | 128                                                        | 0                       | 128                               |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 15,71            | 15,89                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 42,03            | 35,16                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,47             | 0,08                 |
| Fonds d'investissement                                           | 4,19             | 3,57                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 3,33             | 3,61                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,19             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,72             | 0,48                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,32             | 0,15                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,01             | 0,02                 |
| Autres actifs                                                    | 33,03            | 41,02                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 2,59             | 1,68                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 16,51            | 14,90                |
| Obligations et billets convertibles                                                                      | 0,77             | 0,71                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 59,27            | 61,80                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 0,45             | 0,52                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 9,08             | 9,45                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 28,67            | 23,49                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 11,04            | 4,61                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 0,11             | 0,03                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 10,53            | 21,64                |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 10,02            | 9,70                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 7,94             | 9,82                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,39             | (0,21)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,16             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,43             | 0,36                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01)           | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,57             | 0,13                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,44)           | 0,17                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,02             | 0,05                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (0,59)           | S/O                  |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (57,51)          | (58,87)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                  |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                    |                                     |                                  |                           |      |
| BANQUE ET FINANCE                                              |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES |                                     |                                  |                           |      |
| Canadian Imperial Bank of Commerce                             |                                     |                                  |                           | Alba PLC                                                                                |                                     |                                  |                           | Twin Bridges PLC                               |                                     |                                  |                           |      |
| 4,876 % éch. 14/01/2030                                        | \$ 5 100                            | € 4 536                          | 0,35                      | 2,561 % éch. 15/12/2038                                                                 | € 122                               | € 120                            | 0,01                      | 4,647 % éch. 15/07/2059                        | £ 2 210                             | € 2 568                          | 0,20                      |      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                      |                                     |                                  |                           | Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                       | £ 6 200                             | 7 194                            | 0,55                      | 4,407 % éch. 12/09/2055                        | 1 262                               | 1 465                            | 0,11                      |      |
| 3,120 % éch. 20/02/2031                                        | € 3 200                             | 3 132                            | 0,24                      | 4,587 % éch. 18/02/2068                                                                 | £ 4 890                             | 5 680                            | 0,44                      | 4,517 % éch. 12/12/2055                        | 496                                 | 576                              | 0,04                      |      |
| Association internationale de développement                    |                                     |                                  |                           | 4,596 % éch. 18/12/2066                                                                 |                                     |                                  |                           | 4,927 % éch. 15/05/2056                        | 262                                 | 305                              | 0,02                      |      |
| 3,250 % éch. 24/01/2040                                        | 1 300                               | 1 278                            | 0,10                      | Atlas Funding PLC                                                                       | 4,586 % éch. 20/09/2061             | 1 241                            | 1 442                     | 0,11                                           |                                     | 88 611                           | 6,81                      |      |
| Jyske Realkredit A/S                                           |                                     |                                  |                           | 4,886 % éch. 20/01/2061                                                                 | 621                                 | 721                              | 0,06                      | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                    |                                     |                                  |                           |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                        | DKK 0                               | 0                                | 0,00                      | Auburn PLC                                                                              |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES |                                     |                                  |                           |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,586 % éch. 20/07/2045                                                                 | 1 481                               | 1 722                            | 0,13                      | Auto ABS French Loans                          |                                     |                                  |                           |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                             |                                     |                                  |                           | 2,829 % éch. 24/07/2036                        | € 2 863                             | 2 865                            | 0,22                      |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,634 % éch. 25/07/2033                                                                 | \$ 1                                | 1                                | 0,00                      | Auto ABS Italian Stella Loans SRL              |                                     |                                  |                           |      |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                           |                                     |                                  |                           | Beckett Mortgages DAC                                                                   |                                     |                                  |                           | 2,939 % éch. 28/12/2040                        | 4 212                               | 4 223                            | 0,32                      |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 2,888 % éch. 20/10/2070                                                                 | € 1 370                             | 1 370                            | 0,11                      | Autonorria Spain                               |                                     |                                  |                           |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Bletchley Park Funding PLC                                                              |                                     |                                  |                           | 2,882 % éch. 30/04/2043                        | 5 761                               | 5 770                            | 0,44                      |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2047                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,504 % éch. 27/01/2070                                                                 | £ 906                               | 1 051                            | 0,08                      | Bumper NL BV                                   |                                     |                                  |                           |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2050                                        | 19                                  | 2                                | 0,00                      | Braccan Mortgage Funding PLC                                                            |                                     |                                  |                           | 2,925 % éch. 21/03/2036                        | 2 676                               | 2 680                            | 0,21                      |      |
| 4,000 % éch. 01/10/2056                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,588 % éch. 17/05/2067                                                                 | 5 065                               | 5 884                            | 0,45                      | E-Carat DE                                     |                                     |                                  |                           |      |
| Nykredit Realkredit A/S                                        |                                     |                                  |                           | Brants Bridge PLC                                                                       |                                     |                                  |                           | 2,430 % éch. 25/02/2037                        | 6 100                               | 6 099                            | 0,47                      |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,647 % éch. 14/06/2066                                                                 | 932                                 | 1 083                            | 0,08                      | FACT S.A.                                      |                                     |                                  |                           |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Canada Square Funding PLC                                                               |                                     |                                  |                           | 2,935 % éch. 22/09/2031                        | 1 775                               | 1 778                            | 0,14                      |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2056                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,597 % éch. 17/01/2059                                                                 | 1 382                               | 1 605                            | 0,12                      | First Mobility SARL                            |                                     |                                  |                           |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2047                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,409 % éch. 17/06/2058                                                                 | 22                                  | 26                               | 0,00                      | 2,809 % éch. 14/10/2032                        | 1 186                               | 1 188                            | 0,09                      |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Dilosk RMBS DAC                                                                         |                                     |                                  |                           | FTA Santander Consumer Spain Auto              |                                     |                                  |                           |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2052                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 2,869 % éch. 20/05/2062                                                                 | € 2 079                             | 2 081                            | 0,16                      | 3,086 % éch. 22/06/2035                        | 352                                 | 352                              | 0,03                      |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 3,080 % éch. 24/09/2060                                                                 | 1 871                               | 1 873                            | 0,14                      | Fulvia SPV SRL                                 |                                     |                                  |                           |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2047                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 3,108 % éch. 20/07/2061                                                                 | 238                                 | 238                              | 0,02                      | 3,030 % éch. 23/12/2041                        | 408                                 | 409                              | 0,03                      |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 3,204 % éch. 20/10/2062                                                                 | 986                                 | 989                              | 0,08                      | Golden Bar Securitisation SRL                  |                                     |                                  |                           |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Domi BV                                                                                 |                                     |                                  |                           | 3,436 % éch. 22/09/2043                        | 1 663                               | 1 673                            | 0,13                      |      |
| 3,000 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 3,054 % éch. 15/04/2054                                                                 | 525                                 | 526                              | 0,04                      | Hill FL BV                                     |                                     |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 01/04/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Dutch Property Finance BV                                                               |                                     |                                  |                           | 2,909 % éch. 18/10/2033                        | 4 400                               | 4 401                            | 0,34                      |      |
| 4,000 % éch. 01/10/2056                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 2,913 % éch. 28/10/2059                                                                 | 1 909                               | 1 910                            | 0,15                      | 2,939 % éch. 18/02/2032                        | 1 036                               | 1 037                            | 0,08                      |      |
| 5,000 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 3,063 % éch. 28/04/2064                                                                 | 117                                 | 117                              | 0,01                      | LT Rahoitus DAC                                |                                     |                                  |                           |      |
| Realcredit Danmark A/S                                         |                                     |                                  |                           | Elstree PLC                                                                             |                                     |                                  |                           | 2,749 % éch. 18/07/2036                        | 267                                 | 267                              | 0,02                      |      |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,475 % éch. 21/10/2065                                                                 | £ 4 967                             | 5 760                            | 0,44                      | Red & Black Auto Italy SRL                     |                                     |                                  |                           |      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Eurohome UK Mortgages PLC                                                               |                                     |                                  |                           | 3,209 % éch. 28/07/2034                        | 388                                 | 390                              | 0,03                      |      |
| 2,000 % éch. 01/10/2047                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,016 % éch. 15/06/2044                                                                 | 4                                   | 4                                | 0,00                      | RevoCar S.A., Compartiment                     |                                     |                                  |                           |      |
| 3,000 % éch. 01/10/2053                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Harbour PLC                                                                             |                                     |                                  |                           | 2,839 % éch. 25/07/2037                        | 2 207                               | 2 211                            | 0,17                      |      |
| 4,000 % éch. 01/10/2056                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                 | 2 779                               | 3 236                            | 0,25                      | Revocar UG                                     |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                | 8 948                               | 0,69                             |                           | Hops Hill PLC                                                                           |                                     |                                  |                           | 2,845 % éch. 21/02/2037                        | 1 967                               | 1 969                            | 0,15                      |      |
| INDUSTRIE                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           | AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS             |                                     |                                  |                           |      |
| Mundys SpA                                                     |                                     |                                  |                           | 4,464 % éch. 21/06/2056                                                                 | 2 475                               | 2 866                            | 0,22                      | Anchorage Capital Europe CLO DAC               |                                     |                                  |                           |      |
| 4,500 % éch. 24/01/2030                                        | € 1 300                             | 1 338                            | 0,10                      | 4,614 % éch. 21/04/2056                                                                 | 2 170                               | 2 521                            | 0,19                      | 3,424 % éch. 15/10/2038                        | 3 500                               | 3 507                            | 0,27                      |      |
| QatarEnergy                                                    |                                     |                                  |                           | Landmark Mortgage Securities PLC                                                        |                                     |                                  |                           | Arcano Euro CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |      |
| 4,625 % éch. 23/06/2029                                        | \$ 1 400                            | 1 217                            | 0,10                      | 4,066 % éch. 17/06/2039                                                                 | 94                                  | 108                              | 0,01                      | 3,415 % éch. 25/07/2039                        | 1 000                               | 1 001                            | 0,08                      |      |
| RD Michigan Property Owner LLC                                 |                                     |                                  |                           | Ludgate Funding PLC                                                                     | 4,026 % éch. 01/01/2061             | 46                               | 52                        | 0,00                                           | Ares European CLO DAC               |                                  |                           |      |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                        | 3 000                               | 2 617                            | 0,20                      | 4,056 % éch. 01/12/2060                                                                 | 98                                  | 112                              | 0,01                      | 3,088 % éch. 20/04/2032                        | 581                                 | 582                              | 0,04                      |      |
|                                                                | 5 172                               | 0,40                             |                           | Mortimer BTL PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | Bain Capital Euro CLO DAC                      |                                     |                                  |                           |      |
| Total des Obligations et billets privés                        | 14 120                              | 1,09                             |                           | 4,916 % éch. 22/12/2056                                                                 | 454                                 | 527                              | 0,04                      | 3,444 % éch. 22/01/2038                        | 1 900                               | 1 902                            | 0,15                      |      |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN                              |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |      |
| Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | Mortimer Mix PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | BBVA Consumer FTA                              |                                     |                                  |                           |      |
| 3,913 % éch. 25/07/2037                                        | 3                                   | 2                                | 0,00                      | 4,579 % éch. 22/09/2067                                                                 | 2 994                               | 3 477                            | 0,27                      | 2,931 % éch. 21/08/2038                        | 1 064                               | 1 066                            | 0,08                      |      |
| Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | Newgate Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                           | Black Diamond CLO DAC                          |                                     |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 20/02/2055 - 20/01/2056                           | 33 575                              | 26 395                           | 2,03                      | 3,001 % éch. 15/12/2050                                                                 | € 333                               | 331                              | 0,03                      | 3,263 % éch. 15/05/2032                        | 77                                  | 77                               | 0,01                      |      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | Pierpont BTL PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | Blackrock European CLO DAC                     |                                     |                                  |                           |      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 23 250                              | 18 999                           | 1,46                      | 4,846 % éch. 21/09/2054                                                                 | £ 187                               | 218                              | 0,02                      | 3,220 % éch. 17/07/2034                        | 473                                 | 473                              | 0,04                      |      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 112 000                             | 93 783                           | 7,21                      | Polaris PLC                                                                             | 0,000 % éch. 27/03/2069             | 4 665                            | 5 423                     | 0,42                                           | BlueMountain Fuji Euro CLO DAC      |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 01/08/2056                                        | 21 900                              | 18 802                           | 1,45                      | Precise Mortgage Funding PLC                                                            | 4,716 % éch. 16/07/2060             | 895                              | 1 041                     | 0,08                                           | 3,114 % éch. 15/01/2033             | 191                              | 192                       | 0,01 |
|                                                                | 157 981                             | 12,15                            |                           | Project Cashmere                                                                        | 4,543 % éch. 30/12/2057 (a)         | AUD 21 200                       | 12 804                    | 0,98                                           | BNPP AM Euro CLO DAC                |                                  |                           |      |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMERICAIN                                |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |      |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)     |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |      |
| 0,125 % éch. 15/01/2032                                        | 2 882                               | 2 283                            | 0,18                      | RMAC Securities PLC                                                                     |                                     |                                  |                           | 3,183 % éch. 15/02/2034                        | 2 313                               | 2 315                            | 0,18                      |      |
| 0,250 % éch. 15/07/2029                                        | 17 310                              | 14 445                           | 1,11                      | 4,016 % éch. 12/06/2044                                                                 | £ 119                               | 136                              | 0,01                      | Cumulus Static CLO DAC                         |                                     |                                  |                           |      |
| 1,125 % éch. 15/10/2030                                        | 22 540                              | 19 149                           | 1,47                      | Stratton Mortgage Funding PLC                                                           | 4,721 % éch. 25/06/2049             | 2 328                            | 2 704                     | 0,21                                           | 3,483 % éch. 15/11/2033             | 2 114                            | 2 115                     | 0,16 |
| 1,125 % éch. 15/01/2033                                        | 6 035                               | 4 995                            | 0,38                      | 4,896 % éch. 20/06/2060                                                                 | 1 597                               | 1 857                            | 0,14                      | FCT Noria                                      |                                     |                                  |                           |      |
| 1,375 % éch. 15/07/2033                                        | 28 721                              | 24 104                           | 1,85                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                                             |                                     |                                  |                           | 2,812 % éch. 25/07/2043                        | 2 900                               | 2 900                            | 0,22                      |      |
| 1,625 % éch. 15/10/2029                                        | 4 761                               | 4 137                            | 0,32                      | 4,254 % éch. 19/07/2035                                                                 | \$ 3                                | 3                                | 0,00                      | FTA Santander Consumo                          |                                     |                                  |                           |      |
| 2,125 % éch. 15/02/2054                                        | 5 749                               | 4 396                            | 0,34                      | Thornburg Mortgage Securities Trust                                                     |                                     |                                  |                           | 3,106 % éch. 21/12/2037                        | 1 480                               | 1 482                            | 0,11                      |      |
|                                                                | 73 509                              | 5,65                             |                           | 4,403 % éch. 25/09/2043                                                                 | 9                                   | 8                                | 0,00                      | 3,236 % éch. 21/03/2036                        | 451                                 | 451                              | 0,03                      |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Together Asset-Backed Securitisation PLC                                                |                                     |                                  |                           | Ginkgo Sales Finance                           |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,495 % éch. 15/08/2066                                                                 | £ 399                               | 463                              | 0,04                      | 2,942 % éch. 25/11/2049                        | 111                                 | 111                              | 0,01                      |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Towd Point Mortgage Funding PLC                                                         |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                  |                                     |                                  |                           |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,584 % éch. 20/04/2051                                                                 | 1 933                               | 2 244                            | 0,17                      | 3,136 % éch. 20/12/2044                        | 4 978                               | 4 991                            | 0,38                      |      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,672 % éch. 20/07/2053                                                                 | 1 867                               | 2 169                            | 0,17                      |                                                |                                     |                                  |                           |      |

| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Grosvenor Place CLO DAC                 | € 3 500                             | € 3 504                          | 0,27                      | Obligation internationale du gouvernement français    | € 10 600                            | € 2 711                          | 0,21                      | 2,500 % éch. 15/08/2046                            | € 76 600                            | € 67 248                         | 5,17                      |
| 3,444 % éch. 15/01/2039                 |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 25/05/2072                               | 22 400                              | 9 978                            | 0,77                      | 2,500 % éch. 15/08/2054 (e)                        | 50 700                              | 42 369                           | 3,26                      |
| Harvest CLO DAC                         | 1 656                               | 1 657                            | 0,13                      | 0,750 % éch. 25/05/2052                               | 2 600                               | 1 123                            | 0,09                      | 3,250 % éch. 04/07/2042 (e)(g)(f)                  | 44 900                              | 44 965                           | 3,46                      |
| 3,054 % éch. 15/01/2032                 |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 25/05/2053                               | 8 000                               | 6 064                            | 0,47                      | 4,750 % éch. 04/07/2040 (e)(g)(f)                  | 39 100                              | 46 166                           | 3,55                      |
| Hayfin Emerald CLO DAC                  | 5 400                               | 5 404                            | 0,42                      | 1,250 % éch. 25/05/2038 (e)                           | 22 400                              | 13 072                           | 1,00                      | Obligation internationale du gouvernement roumain  | 4 100                               | 3 710                            | 0,29                      |
| 3,184 % éch. 15/01/2035                 | 3 000                               | 3 005                            | 0,23                      | 1,500 % éch. 25/05/2050 (e)                           | 38 270                              | 19 309                           | 1,48                      | 3,750 % éch. 07/02/2034                            | 2 900                               | 2 924                            | 0,22                      |
| 3,404 % éch. 22/01/2039                 | 6 000                               | 6 005                            | 0,46                      | 1,750 % éch. 25/05/2066                               | 75 900                              | 61 317                           | 4,71                      | 5,625 % éch. 22/02/2036                            | 1 300                               | 1 283                            | 0,10                      |
| 3,454 % éch. 15/10/2038                 |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 25/05/2043 (e)                           | 21 300                              | 17 354                           | 1,33                      | 5,625 % éch. 30/05/2037 (e)                        | 2 100                               | 2 202                            | 0,17                      |
| Madison Park Euro Funding DAC           | 1 542                               | 1 542                            | 0,12                      | 3,000 % éch. 25/06/2049                               | 54 950                              | 42 595                           | 3,28                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien | \$ 1 400                            | 1 251                            | 0,10                      |
| 2,905 % éch. 25/10/2030                 | 2 998                               | 3 003                            | 0,23                      | 3,000 % éch. 25/05/2054                               | 76 500                              | 67 585                           | 5,20                      | 5,375 % éch. 13/01/2031                            | € 8 000                             | 8 002                            | 0,62                      |
| 3,115 % éch. 27/07/2034                 |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 25/05/2045 (e)                           | 68 300                              | 55 321                           | 4,25                      | Obligation internationale du gouvernement slovaque | € 8 000                             |                                  |                           |
| Marzio Finance SRL                      | 2 202                               | 2 210                            | 0,17                      | 3,600 % éch. 25/05/2042                               | 67 100                              | 63 600                           | 4,89                      | 4,125 % éch. 19/02/2046                            |                                     |                                  |                           |
| 2,801 % éch. 28/05/2049                 | 128                                 | 129                              | 0,01                      | 3,750 % éch. 25/05/2056                               | 56 300                              | 49 883                           | 3,84                      | Obligation internationale du gouvernement slovène  | 5 200                               | 4 579                            | 0,35                      |
| 3,299 % éch. 28/02/2048                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 25/04/2055                               | 88 850                              | 82 909                           | 6,37                      | 1,500 % éch. 25/03/2035                            | 100                                 | 100                              | 0,01                      |
| OCF Euro CLO DAC                        | 3 200                               | 3 203                            | 0,25                      | 4,000 % éch. 25/04/2060                               | 63 650                              | 58 403                           | 4,49                      | 3,000 % éch. 10/03/2034                            | 7 100                               | 7 083                            | 0,54                      |
| 3,468 % éch. 20/10/2039                 | 1 100                               | 1 101                            | 0,08                      | 4,100 % éch. 25/05/2046 (e)                           | 60 300                              | 59 509                           | 4,58                      | 3,125 % éch. 02/07/2035 (e)                        | 17 300                              | 17 348                           | 1,33                      |
| 3,478 % éch. 20/07/2036                 |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 25/05/2057                               | 28 200                              | 27 897                           | 2,14                      | 3,275 % éch. 12/03/2036                            | 4 200                               | 3 860                            | 0,30                      |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | 2 832                               | 2 832                            | 0,22                      | Île-de-France Mobilités                               |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 14/04/2055                            |                                     |                                  |                           |
| 3,054 % éch. 15/10/2034                 | 1 996                               | 1 998                            | 0,15                      | 3,400 % éch. 25/05/2043                               | 900                                 | 810                              | 0,06                      | Obligation internationale du gouvernement espagnol | 6 400                               | 6 374                            | 0,49                      |
| 3,273 % éch. 15/05/2034                 | 2 145                               | 2 147                            | 0,17                      | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                     | 6 977                               | 6 401                            | 0,49                      | 3,200 % éch. 31/10/2035 (e)                        | 20 300                              | 21 785                           | 1,67                      |
| 3,283 % éch. 15/05/2034                 | 5 113                               | 5 116                            | 0,39                      | 0,100 % éch. 15/05/2033 (c)                           |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 31/01/2037                            |                                     |                                  |                           |
| 3,433 % éch. 15/02/2035                 |                                     |                                  |                           | 1,100 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | Treasury Corp. of Victoria                         | AUD 9 000                           | 5 247                            | 0,40                      |
| Rockford Tower Europe CLO DAC           | 1 700                               | 1 702                            | 0,13                      | 15/08/2031 (c)(e)                                     | 32 246                              | 32 222                           | 2,48                      | 4,250 % éch. 20/12/2032                            |                                     |                                  |                           |
| 3,489 % éch. 29/08/2036                 |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 15/09/2032 (c)                           | 12 627                              | 12 703                           | 0,98                      | Bon du Trésor britannique                          | £ 17 900                            | 20 449                           | 1,57                      |
| SC Germany S.A., Compartiment Consumer  | 2 073                               | 2 075                            | 0,16                      | 2,550 % éch. 25/05/2056 (c)                           | 3 975                               | 4 113                            | 0,32                      | 4,000 % éch. 22/10/2031                            | 20 100                              | 23 161                           | 1,78                      |
| 2,779 % éch. 14/01/2038                 | 688                                 | 689                              | 0,05                      | 4,650 % éch. 01/10/2055                               | 2 000                               | 2 082                            | 0,16                      | 4,125 % éch. 07/03/2031                            |                                     |                                  |                           |
| 2,849 % éch. 15/09/2037                 |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais    | ¥ 70 000                            | 242                              | 0,02                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Secucor Finance DAC                     | 5 900                               | 5 928                            | 0,46                      | 1,800 % éch. 20/03/2054                               | 82 000                              | 313                              | 0,02                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,116 % éch. 20/09/2036                 |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 20/06/2054                               | 82 000                              | 319                              | 0,02                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Tikehau CLO DAC                         | 1 000                               | 1 002                            | 0,08                      | 2,300 % éch. 20/12/2054                               | 164 700                             | 657                              | 0,05                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,404 % éch. 15/10/2038                 |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2055                               | 307 050                             | 1 451                            | 0,11                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Toro European CLO DAC                   | 291                                 | 291                              | 0,02                      | 3,200 % éch. 20/09/2055                               | 530 000                             | 2 603                            | 0,20                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,093 % éch. 15/02/2034                 |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch. 20/12/2055                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain    | \$ 4 100                            | 3 063                            | 0,24                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         | 77 843                              | 5,98                             |                           | 3,500 % éch. 12/02/2034                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         | 115 155                             | 8,85                             |                           | Obligation internationale du gouvernement néerlandais | € 5 000                             | 3 497                            | 0,27                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 15/01/2038 (b)                           | 10 400                              | 10 133                           | 0,78                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 15/07/2034 (e)                           | 37 250                              | 33 731                           | 2,59                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 15/01/2047                               | 14 300                              | 14 120                           | 1,09                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/01/2044                               | 60 500                              | 61 036                           | 4,69                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/01/2056                               | 14 800                              | 15 616                           | 1,20                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/01/2042                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | New South Wales Treasury Corp.                        | AUD 3 300                           | 1 577                            | 0,12                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 20/03/2034                               | 14 100                              | 7 119                            | 0,55                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 08/03/2033                               | 4 000                               | 2 338                            | 0,18                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 20/09/2035                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais    | € 1 200                             | 1 095                            | 0,08                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 18/01/2036                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | Queensland Treasury Corp.                             | AUD 3 300                           | 1 640                            | 0,13                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 22/08/2033                               |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | République d'Allemagne                                |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch.                                          | € 5 800                             | 2 574                            | 0,20                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 15/08/2050 (b)(g)(f)                                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch.                                          | 42 100                              | 28 227                           | 2,17                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 15/08/2048 (e)                                        | 125 100                             | 111 610                          | 8,59                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 04/07/2044 (e)(g)(f)                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                            | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|----------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| COM                                   | 2,270 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | € 6 100                 | Bpifrance SACA 1,000 % éch. 25/05/2027 | € (6 304)           | € 6 100                                        | € 6 100                                                                        | 0,47                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                        | € (6 304)           | € 6 100                                        | € 6 100                                                                        | 0,47                   |

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 246                   | € (232)                                 | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                      | Court | 09/2026              | 341                   | (246)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre    | Long  | 09/2026              | 241                   | 237                                     | 0,02                   |

## Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund (suite)

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 1 645              | € (2 161)                         | (0,17)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Long  | 09/2026           | 2 395              | 5 324                             | 0,41                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 178                | (82)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026           | 249                | (20)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 203                | 13                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 178                | 10                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026           | 288                | (356)                             | (0,03)              |
| CContrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre              | Court | 09/2026           | 460                | (1 019)                           | (0,08)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 718                | 1 350                             | 0,11                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | € 2 818                           | 0,21                |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                   | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor septembre 2026 | € 97,625        | 14/09/2026        | 818                | € (192) | € (36)       | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé    |                 |                   |                    |         | € 2 782      | 0,21                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500 %   | 18/03/2036      | ¥ 2 503 600       | € 443                             | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 20/12/2053      | \$ 6 700          | 344                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 72 460            | 1 130                             | 0,08                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 10 700            | 432                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 4 600             | 73                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 8 000             | 307                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 24 260            | (78)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 9 100             | 27                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 25 500            | 342                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 6 300             | (164)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 11 800            | 191                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,075     | 15/11/2053      | 10 704            | 133                               | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,750     | 18/03/2031      | AUD 47 200        | (129)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | € 89 280          | (214)                             | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 45 830            | 217                               | 0,02                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | € 3 054                           | 0,23                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | € 3 054                           | 0,23                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

### OPTIONS VENDUES

#### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,440 %         | 25/01/2027        | 4 400                            | € (37)    | € (6)        | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,440           | 25/01/2027        | 4 400                            | (37)      | (31)         | 0,00                |
| CBK          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 135 300                          | (422)     | (517)        | (0,04)              |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,350           | 07/01/2027        | 18 500                           | (163)     | (19)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,350           | 07/01/2027        | 18 500                           | (162)     | (153)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,500           | 14/01/2027        | 26 300                           | (234)     | (45)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500           | 14/01/2027        | 26 300                           | (234)     | (161)        | (0,01)              |
| GST          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 58 000                           | (172)     | (221)        | (0,02)              |
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 27/08/2026        | 14 900                           | (74)      | (61)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 14 900                           | (74)      | (20)         | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | € (1 609) | € (1 234)    | (0,10)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| AZD          | 07/2026           | CNH             | 1 423             | \$ 211             | € 1                   | € 0                                     | € 1                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 135             | 1 675              | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00 |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 156               | 30                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | €               | 971               | 1 131              | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | £               | 4 443             | € 5 139            | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00 |
|              | 07/2026           | KRW             | 138 024           | \$ 91              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | NOK             | 208               | 22                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | SGD             | 22 383            | 17 527             | 193                   | 0                                       | 193                 | 0,02 |
|              | 07/2026           | \$              | 1 166             | CNH 7 884          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 128               | PLN 484            | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 307             | \$ 776             | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 680             | 151                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | \$              | 450               | INR 42 759         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
| BPS          | 07/2026           | AUD             | 18                | € 11               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | BRL             | 3 580             | \$ 692             | 2                     | (2)                                     | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 388             | € 1 507            | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | CNH             | 12 702            | \$ 1 877           | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | €               | 922               | £ 796              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 622               | NOK 6 734          | 0                     | (27)                                    | (27)                | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 6 955             | \$ 7 960           | 40                    | (32)                                    | 8                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | IDR             | 135 275 638       | 7 549              | 6                     | (4)                                     | 2                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 135             | 1 064              | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | INR             | 251 446           | 2 618              | 0                     | (34)                                    | (34)                | 0,00 |
|              | 07/2026           | KRW             | 580 065           | 380                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | NOK             | 3 000             | € 269              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | THB             | 35 162            | \$ 1 072           | 13                    | (2)                                     | 11                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 157               | BRL 793            | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 18                | CNY 120            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 10 046            | € 8 775            | 15                    | (27)                                    | (12)                | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 7 314             | INR 693 414        | 13                    | (12)                                    | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 1 772             | KRW 2 718 031      | 0                     | (14)                                    | (14)                | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 258               | TWD 8 153          | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 307               | ZAR 5 034          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | €               | 11                | AUD 18             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | ILS             | 459               | \$ 154             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | \$              | 162               | BRL 827            | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | IDR             | 15 238 653        | \$ 839             | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | THB             | 31 091            | 958                | 15                    | 0                                       | 15                  | 0,00 |
|              | 09/2026           | \$              | 4 312             | IDR 76 523 583     | 5                     | (67)                                    | (62)                | 0,00 |
|              | 09/2026           |                 | 469               | INR 44 566         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           |                 | 190               | THB 6 213          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 12/2026           |                 | 538               | IDR 9 790 727      | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
| BRC          | 07/2026           | AUD             | 15 461            | € 9 465            | 96                    | 0                                       | 96                  | 0,01 |
|              | 07/2026           | €               | 1 019             | NZD 2 050          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 817             | \$ 1 290           | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | NOK             | 5 074             | € 452              | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 2 010             | 1 755              | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 4 854             | TRY 230 528        | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 1 898             | ZAR 30 902         | 1                     | (14)                                    | (13)                | 0,00 |
|              | 08/2026           | CAD             | 6 828             | € 4 209            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
| CBK          | 08/2026           | €               | 132               | NOK 1 497          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 328             | € 1 459            | 19                    | 0                                       | 19                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | €               | 8 504             | £ 7 381            | 65                    | 0                                       | 65                  | 0,01 |
|              | 07/2026           |                 | 1 009             | NOK 10 927         | 0                     | (43)                                    | (43)                | 0,00 |
|              | 07/2026           | ILS             | 12 022            | \$ 4 135           | 87                    | 0                                       | 87                  | 0,01 |
|              | 07/2026           | INR             | 135 731           | 1 439              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 1 455             | IDR 26 100 901     | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 1 401             | INR 135 731        | 29                    | 0                                       | 29                  | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 198               | KRW 298 702        | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 1 468             | PLN 5 423          | 0                     | (23)                                    | (23)                | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 92                | TWD 2 920          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 08/2026           | ILS             | 5 101             | \$ 1 757           | 38                    | 0                                       | 38                  | 0,00 |
|              | 08/2026           | \$              | 376               | ILS 1 116          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | IDR             | 56 005 827        | \$ 3 102           | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | INR             | 17 298            | 180                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | THB             | 37 666            | 1 137              | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | \$              | 1 075             | IDR 19 173 405     | 0                     | (11)                                    | (11)                | 0,00 |
|              | 09/2026           |                 | 493               | MXN 8 814          | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00 |
|              | 12/2026           |                 | 1 648             | IDR 29 953 671     | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |
| DUB          | 07/2026           | IDR             | 3 508 339         | \$ 196             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | INR             | 54 436            | 576                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | NOK             | 515               | 55                 | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 564             | 2 010              | 24                    | 0                                       | 24                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 857               | BRL 4 469          | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 4 013             | CNH 27 298         | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 385               | INR 37 106         | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 676               | PLN 2 508          | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 714               | ZAR 11 561         | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00 |
|              | 08/2026           | CNH             | 27 237            | \$ 4 013           | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00 |
|              | 09/2026           | IDR             | 33 052 161        | 1 834              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |

# Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 09/2026           | \$ 660          | IDR 11 982 878    | € 4                | € 0                   | € 4                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 576             | INR 54 805        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 109 861     | \$ 21 338         | 99                 | 0                     | 99                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW 560 633     | 363               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 20 591       | BRL 111 034       | 778                | (26)                  | 752                                     | 0,06                |
|              | 07/2026           | 1 400           | IDR 25 097 051    | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 363             | KRW 560 553       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 39              | PLN 147           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 634             | ZAR 10 424        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 984           | BRL 15 230        | 0                  | (56)                  | (56)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 372             | INR 35 682        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 25 244 022  | \$ 1 400          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 1 873       | 107               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 95 063      | 2 946             | 58                 | 0                     | 58                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 351          | BRL 1 809         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 3 078           | IDR 55 262 254    | 5                  | (18)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 3 158           | INR 304 281       | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 574             | MXN 9 998         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | 21 334          | BRL 112 256       | 0                  | (99)                  | (99)                                    | (0,01)              |
| JPM          | 07/2026           | € 4 186         | CHF 3 859         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 131           | \$ 5 934          | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 9 799       | 3 282             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 92 613      | 982               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 46 222        | € 250             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 173 240     | \$ 112            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 11 590      | € 1 043           | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 16 063      | 8 218             | 225                | 0                     | 225                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | SEK 1 457       | 132               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 434        | 7 292             | 0                  | (85)                  | (85)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 213             | IDR 3 821 150     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 981             | INR 92 613        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 169             | KRW 259 546       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 148             | NOK 1 461         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 886           | PLN 25 110        | 1                  | (181)                 | (180)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 773             | THB 25 823        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 3 859       | € 4 195           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 108           | ¥ 19 986          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 657             | NOK 7 428         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 132             | SEK 1 456         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | ILS 9 469       | \$ 3 252          | 62                 | 0                     | 62                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 1 461       | 148               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 3 842 384   | 213               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 93 263      | 981               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 6 765       | 384               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 75 076      | 2 300             | 29                 | (7)                   | 22                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 498        | INR 238 279       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 19 827          | MXN 344 602       | 0                  | (200)                 | (200)                                   | (0,02)              |
|              | 12/2026           | MXN 1 244       | \$ 71             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 1 089        | MXN 19 230        | 0                  | (3)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 975           | AUD 1 583         | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 93              | CAD 150           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 196             | NOK 2 170         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 100             | \$ 116            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 5 863         | € 6 756           | 0                  | (51)                  | (51)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 344 821     | \$ 19             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 54 651      | 579               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 2 375 719   | 1 567             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 225       | 132               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 5 404       | € 2 750           | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$ 424          | CHF 332           | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 892             | INR 86 007        | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 47              | NOK 471           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 471         | \$ 47             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 22 090      | 662               | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 391        | INR 228 761       | 10                 | (3)                   | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 996         | € 1 089           | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 1 052         | AUD 1 732         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 48 737          | £ 42 086          | 120                | 0                     | 120                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 138             | SEK 1 485         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 960           | \$ 2 277          | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 897         | € 455             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 35 581        | 41 165            | 0                  | (84)                  | (84)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 303        | IDR 23 230 352    | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 902             | INR 86 806        | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 23 360 632  | \$ 1 303          | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 658          | IDR 11 705 774    | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 21 013      | € 12 857          | 124                | 0                     | 124                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD 20 220      | 12 553            | 87                 | 0                     | 87                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 20 064        | AUD 33 178        | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 2 803           | \$ 3 262          | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 332 985       | € 1 803           | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 1 930       | \$ 1 492          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |



| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG                                                | 07/2026           | \$ 41           | CNY 280           | € 0                | € 0                   | € 0                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 494             | IDR 8 862 946     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 1 188           | INR 113 824       | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | AUD 33 244      | € 20 064          | 0                  | (42)                  | (42)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 1 041         | ¥ 191 622         | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 925          | INR 88 629        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | IDR 26 147 639  | \$ 1 448          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | THB 33 861      | 1 049             | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | \$ 1 677        | IDR 30 107 342    | 2                  | (9)                   | (7)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CHF 7 306       | € 7 988           | 66                 | 0                     | 66                                      | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | 332             | \$ 410            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CNH 21 071      | 3 115             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 5 773         | CAD 9 349         | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 50 176          | £ 43 285          | 74                 | 0                     | 74                                      | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | 89 154          | \$ 101 413        | 0                  | (451)                 | (451)                                   | (0,03)              |
|                                                    | 07/2026           | £ 90 341        | € 104 152         | 0                  | (723)                 | (723)                                   | (0,06)              |
|                                                    | 07/2026           | SGD 40          | \$ 31             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 108 285      | € 92 827          | 0                  | (1 885)               | (1 885)                                 | (0,14)              |
|                                                    | 07/2026           | 20 944          | SGD 27 123        | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | CAD 9 348       | € 5 773           | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 43 044        | 49 828            | 0                  | (74)                  | (74)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | SGD 27 062      | \$ 20 944         | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 410          | CHF 331           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 101 550         | € 89 154          | 450                | 0                     | 450                                     | 0,03                |
|                                                    | 08/2026           | 31              | SGD 40            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 7 768         | CHF 7 158         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 912             | ¥ 167 600         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | CHF 7 158       | € 7 785           | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 4 082        | 3 576             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | € 1 178         | ¥ 218 000         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | ¥ 2 202         | € 12              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 684          | PLN 2 500         | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 12            | ¥ 2 202           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | MXN 2 780       | \$ 159            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | THB 4 243       | 129               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | € 3 501            | € (4 554)             | € (1 053)                               | (0,08)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | € (2 287)                               | (0,18)              |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       | € 1 840 614                             | 141,53              |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       | € (540 128)                             | (41,53)             |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       | € 1 300 486                             | 100,00              |

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

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

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

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

(d) Affilié au Fonds.

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 426 614 € (31 décembre 2025 : 494 727 €) et un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2025 : 1 807 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 3 924 € (31 décembre 2025 : 1 033 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 3 811 € (31 décembre 2025 : 0 €) et un montant en numéraire de 2 648 € (31 décembre 2025 : 0 €) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 19 753 € (31 décembre 2025 : 14 882 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 1 805 559                                          | € 12 804                                          | € 1 818 363  |
| Fonds d'investissement                        | 12 602                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 12 602       |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 6 100                                                | 0                                                 | 6 100        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 2 785                                                                             | 764                                                  | 0                                                 | 3 549        |
| Totaux                                        | € 15 387                                                                          | € 1 812 423                                          | € 12 804                                          | € 1 840 614  |

## Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur       |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 1 731 874                                          | € 12 037                                          | € 1 743 911        |
| Fonds d'investissement                        | 735                                                                               | 6 641                                                | 0                                                 | 7 376              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 4 600                                                | 0                                                 | 4 600              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (1 486)                                                                           | 3 431                                                | 0                                                 | 1 945              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ (751)</b>                                                                    | <b>€ 1 746 546</b>                                   | <b>€ 12 037</b>                                   | <b>€ 1 757 832</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 2,150 %        | 15/05/2026        | 10/07/2026         | € (31 747)       | € (31 836)                               | (2,45)              |
|                                               | 2,240          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (12 510)         | (12 527)                                 | (0,96)              |
|                                               | 2,280          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (22 111)         | (22 140)                                 | (1,70)              |
|                                               | 2,300          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (20 415)         | (20 442)                                 | (1,57)              |
| BRC                                           | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (590)            | (591)                                    | (0,05)              |
|                                               | 2,050          | 06/05/2026        | 10/07/2026         | (43 194)         | (43 331)                                 | (3,33)              |
|                                               | 2,070          | 06/05/2026        | 10/07/2026         | (6 023)          | (6 042)                                  | (0,47)              |
|                                               | 2,260          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (6 293)          | (6 302)                                  | (0,48)              |
|                                               | 2,270          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (7 277)          | (7 287)                                  | (0,56)              |
|                                               | 2,280          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (2 221)          | (2 224)                                  | (0,17)              |
|                                               | 2,290          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (8 844)          | (8 855)                                  | (0,68)              |
| COM                                           | 2,150          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (7 236)          | (7 242)                                  | (0,56)              |
|                                               | 2,180          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (310)            | (310)                                    | (0,02)              |
|                                               | 2,250          | 10/06/2026        | 29/07/2026         | (18 844)         | (18 869)                                 | (1,45)              |
| JML                                           | 2,060          | 06/05/2026        | 10/07/2026         | (68 250)         | (68 469)                                 | (5,27)              |
|                                               | 2,070          | 06/05/2026        | 10/07/2026         | (172 544)        | (173 099)                                | (13,31)             |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>€ (429 566)</b>                       | <b>(33,03)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

|              | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
| Contrepartie | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | € 22                                                       | € 0                     | € 22                              | € S/O                                                      | € S/O                   | € S/O                             |
| BOA          | 190                                                        | 0                       | 190                               | 58                                                         | 0                       | 58                                |
| BPS          | (99)                                                       | 0                       | (99)                              | 141                                                        | 0                       | 141                               |
| BRC          | 62                                                         | 0                       | 62                                | 113                                                        | 0                       | 113                               |
| CBK          | (353)                                                      | 357                     | 4                                 | 142                                                        | (260)                   | (118)                             |
| DUB          | 29                                                         | 0                       | 29                                | 258                                                        | (260)                   | (2)                               |
| GLM          | 391                                                        | (1 060)                 | (669)                             | (349)                                                      | (290)                   | (639)                             |
| GST          | (221)                                                      | 290                     | 69                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (80)                                                       | 257                     | 177                               | (609)                                                      | 571                     | (38)                              |
| MBC          | 30                                                         | 0                       | 30                                | (73)                                                       | 0                       | (73)                              |
| MYI          | 80                                                         | 0                       | 80                                | (87)                                                       | 0                       | (87)                              |
| NSL          | 8                                                          | 0                       | 8                                 | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |
| SSB          | 0                                                          | 0                       | 0                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 291                                                        | (290)                   | 1                                 | (527)                                                      | 462                     | (65)                              |
| SOG          | (2 616)                                                    | 3 020                   | 404                               | 885                                                        | (1 210)                 | (325)                             |
| UAG          | (21)                                                       | 0                       | (21)                              | 50                                                         | 0                       | 50                                |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 74,26            | 74,90                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 14,97            | 16,44                |
| Fonds d'investissement                                           | 0,62             | 0,39                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,30             | 0,24                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,34             | 0,17                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,18             | 0,25                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,17             | 0,18                 |
| Autres actifs                                                    | 9,16             | 7,43                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                                         | 1,09             | 3,37                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                     | 12,15            | 11,29                |
| Obligations du Trésor américain                                                                       | 5,65             | 3,65                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux               | 6,81             | 10,48                |
| Titres adossés à des actifs                                                                           | 8,85             | 16,05                |
| Émissions souveraines                                                                                 | 105,28           | 102,55               |
| Instruments à court terme                                                                             | S/O              | 0,59                 |
| Fonds d'investissement                                                                                | 0,97             | 0,63                 |
| Contrats de mise en pension                                                                           | 0,47             | 0,39                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | 0,21             | (0,12)               |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | 0,00             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                              |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                               | 0,23             | 0,28                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                              |                  |                      |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                           | (0,10)           | (0,08)               |
| Contrats de change à terme                                                                            | (0,08)           | 0,08                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                | (41,53)          | (49,16)              |
| Actif net                                                                                             | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term Fund

| DESCRIPTION                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)         | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)   | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |         |       |      |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------|---------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|---------------------------|---------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                              |                                     |                                  |                           |                |                                             |                                  |                           |                           |                                     |                                    |                           |         |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                   |                                     |                                  |                           |                |                                             |                                  |                           |                           |                                     |                                    |                           |         |       |      |
| BANQUE ET FINANCE                               |                                     |                                  |                           |                |                                             |                                  |                           |                           |                                     |                                    |                           |         |       |      |
| 365 bank A/S                                    |                                     |                                  |                           | DLR Kredit A/S |                                             |                                  |                           | SpareBank Boligkredit A/S |                                     |                                    |                           |         |       |      |
| 7,125 % éch. 04/07/2028                         | €                                   | 1 300                            | € 1 347                   | 0,28           | 1,000 % éch. 01/01/2027                     | DKK                              | 1 000                     | € 133                     | 0,03                                | 0,050 % éch. 03/11/2028            | € 2 300                   | € 2 161 | 0,44  |      |
| Achmea Bank NV                                  |                                     |                                  |                           |                | Banque européenne d'investissement          | €                                | 2 000                     | 1 986                     | 0,41                                | 0,010 % éch. 26/01/2028            | 2 300                     | 2 204   | 0,45  |      |
| 2,625 % éch. 15/10/2027                         |                                     | 3 000                            | 2 996                     | 0,62           | 2,250 % éch. 14/08/2028                     |                                  |                           |                           |                                     | 3,375 % éch. 15/11/2028            | 2 100                     | 2 129   | 0,44  |      |
| American Tower Corp.                            |                                     |                                  |                           |                | Fédération des Caisses Desjardins du Québec |                                  | 474                       | 456                       | 0,09                                | SR-Boligkredit A/S                 |                           |         |       |      |
| 0,450 % éch. 15/01/2027                         |                                     | 1 800                            | 1 779                     | 0,37           | 0,050 % éch. 26/11/2027                     |                                  | 1 300                     | 1 281                     | 0,26                                | 0,010 % éch. 26/06/2027            | 1 700                     | 1 656   | 0,34  |      |
| Argenta Spaarbank NV                            |                                     |                                  |                           |                | 0,250 % éch. 08/02/2027                     |                                  | 2 000                     | 1 999                     | 0,41                                | 1,625 % éch. 15/03/2028            | 2 200                     | 2 161   | 0,44  |      |
| 2,500 % éch. 25/10/2027                         |                                     | 5 100                            | 5 084                     | 1,05           | 2,000 % éch. 31/08/2026                     |                                  | 1 300                     | 1 309                     | 0,27                                | Sumitomo Mitsui Banking Corp.      |                           |         |       |      |
| 3,250 % éch. 20/10/2026                         |                                     | 1 500                            | 1 503                     | 0,31           | 3,250 % éch. 18/04/2028                     |                                  |                           |                           |                                     | 2,768 % éch. 23/04/2029            | 1 400                     | 1 403   | 0,29  |      |
| Athene Global Funding                           |                                     |                                  |                           |                | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                  | 1 700                     | 1 599                     | 0,33                                | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.    |                           |         |       |      |
| 3,204 % éch. 23/02/2027                         |                                     | 800                              | 802                       | 0,16           | 0,875 % éch. 09/05/2029                     |                                  | 1 400                     | 1 403                     | 0,29                                | 0,010 % éch. 15/10/2027            | 1 400                     | 1 348   | 0,28  |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.            |                                     |                                  |                           |                | 2,889 % éch. 17/02/2029                     |                                  |                           |                           |                                     | Svenska Handelsbanken AB           |                           |         |       |      |
| 2,754 % éch. 15/01/2029                         |                                     | 1 300                            | 1 304                     | 0,27           | ING Bank NV                                 |                                  | 1 400                     | 1 389                     | 0,29                                | 1,375 % éch. 23/02/2029            | 2 800                     | 2 687   | 0,55  |      |
| 4,519 % éch. 03/03/2029                         | \$                                  | 1 600                            | 1 404                     | 0,29           | JAB Holdings BV                             |                                  | 600                       | 599                       | 0,12                                | Toronto-Dominion Bank              |                           |         |       |      |
| Banco BPM SpA                                   |                                     |                                  |                           |                | 2,500 % éch. 17/04/2027                     |                                  |                           |                           |                                     | 0,864 % éch. 24/03/2027            | 2 000                     | 1 975   | 0,41  |      |
| 3,875 % éch. 18/09/2026                         | €                                   | 900                              | 903                       | 0,19           | JPMorgan Chase & Co.                        |                                  | 1 400                     | 1 402                     | 0,29                                | 2,498 % éch. 19/10/2026            | 400                       | 400     | 0,08  |      |
| Bank of America Corp.                           |                                     |                                  |                           |                | 2,769 % éch. 18/02/2029                     |                                  | 1 400                     | 1 402                     | 0,29                                | 2,582 % éch. 16/02/2027            | 1 100                     | 1 101   | 0,23  |      |
| 2,693 % éch. 28/01/2028                         |                                     | 800                              | 802                       | 0,17           | 3,674 % éch. 06/06/2028                     |                                  | 1 600                     | 1 612                     | 0,33                                | UBS AG                             |                           |         |       |      |
| Banque de Montréal                              |                                     |                                  |                           |                | Jyske Realkredit A/S                        |                                  |                           |                           |                                     | 2,581 % éch. 21/11/2027            | 1 400                     | 1 402   | 0,29  |      |
| 0,125 % éch. 26/01/2027                         |                                     | 1 000                            | 986                       | 0,20           | 1,000 % éch. 01/01/2027                     | DKK                              | 11 102                    | 1 476                     | 0,30                                | UBS Group AG                       |                           |         |       |      |
| Bank of Nova Scotia                             |                                     |                                  |                           |                | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau             | €                                | 2 200                     | 2 178                     | 0,45                                | 0,650 % éch. 14/01/2028            | 900                       | 890     | 0,18  |      |
| 0,010 % éch. 14/01/2027                         |                                     | 1 000                            | 987                       | 0,20           | 2,125 % éch. 31/07/2028                     |                                  | 16 600                    | 16 780                    | 3,45                                | 4,625 % éch. 17/03/2028            | 900                       | 911     | 0,19  |      |
| 0,010 % éch. 15/12/2027                         |                                     | 2 300                            | 2 212                     | 0,46           | 3,125 % éch. 10/10/2028                     |                                  |                           |                           |                                     | 7,750 % éch. 01/03/2029            | 1 200                     | 1 288   | 0,27  |      |
| 3,250 % éch. 18/01/2028                         |                                     | 2 800                            | 2 821                     | 0,58           | La Banque Postale Home Loan SFH S.A.        |                                  | 900                       | 865                       | 0,18                                | UBS Switzerland AG                 |                           |         |       |      |
| Bank of Queensland Ltd.                         |                                     |                                  |                           |                | 1,000 % éch. 04/10/2028                     |                                  | 800                       | 802                       | 0,17                                | 2,434 % éch. 21/04/2027            | 1 100                     | 1 099   | 0,23  |      |
| 1,839 % éch. 09/06/2027                         |                                     | 2 400                            | 2 378                     | 0,49           | Lloyds Banking Group PLC                    |                                  | 600                       | 601                       | 0,12                                | 2,583 % éch. 23/09/2027            | 3 000                     | 2 992   | 0,62  |      |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.         |                                     |                                  |                           |                | 2,864 % éch. 12/02/2030                     |                                  | 800                       | 802                       | 0,17                                | UniCredit SpA                      |                           |         |       |      |
| 2,704 % éch. 21/01/2029                         |                                     | 1 400                            | 1 402                     | 0,29           | 2,906 % éch. 04/03/2028                     |                                  | 1 300                     | 1 279                     | 0,26                                | 2,875 % éch. 15/07/2030            | 1 400                     | 1 388   | 0,29  |      |
| 3,875 % éch. 26/01/2028                         |                                     | 1 300                            | 1 318                     | 0,27           | London Stock Exchange Group PLC             |                                  | 1 800                     | 1 795                     | 0,37                                | Volkswagen Bank GmbH               |                           |         |       |      |
| Barclays Bank PLC                               |                                     | 1 500                            | 1 501                     | 0,31           | 1,750 % éch. 06/12/2027                     |                                  | 800                       | 796                       | 0,16                                | 2,500 % éch. 31/07/2026            | 500                       | 500     | 0,10  |      |
| 2,787 % éch. 17/06/2028                         |                                     |                                  |                           |                | Macquarie Bank Ltd.                         |                                  | 600                       | 603                       | 0,12                                | Volkswagen Leasing GmbH            |                           |         |       |      |
| Barclays PLC                                    |                                     | 1 800                            | 1 781                     | 0,37           | 2,574 % éch. 15/09/2027                     |                                  | 1 400                     | 1 402                     | 0,29                                | 3,625 % éch. 11/10/2026            | 200                       | 200     | 0,04  |      |
| 0,877 % éch. 28/01/2028                         |                                     |                                  |                           |                | Mitsubishi HC Capital UK PLC                |                                  | 1 400                     | 1 436                     | 0,30                                | Vseobecna Uverova Banka A/S        |                           |         |       |      |
| Bendigo & Adelaide Bank Ltd.                    |                                     |                                  |                           |                | 2,856 % éch. 26/11/2028                     |                                  | 1 400                     | 1 436                     | 0,30                                | 3,500 % éch. 13/10/2026            | 900                       | 903     | 0,19  |      |
| 4,020 % éch. 04/10/2026                         |                                     | 4 750                            | 4 768                     | 0,98           | 3,733 % éch. 02/02/2027                     |                                  | 1 400                     | 1 436                     | 0,30                                | Wells Fargo & Co.                  |                           |         |       |      |
| Bevco Lux SARL                                  |                                     | 200                              | 196                       | 0,04           | Morgan Stanley                              |                                  | 1 400                     | 1 402                     | 0,29                                | 1,000 % éch. 02/02/2027            | 800                       | 793     | 0,16  |      |
| 1,500 % éch. 16/09/2027                         |                                     |                                  |                           |                | 2,749 % éch. 04/05/2029                     |                                  | 1 400                     | 1 436                     | 0,30                                | 1,500 % éch. 24/05/2027            | 800                       | 792     | 0,16  |      |
| Blackstone Holdings Finance Co. LLC             |                                     |                                  |                           |                | 4,656 % éch. 02/03/2029                     |                                  | 485                       | 452                       | 0,09                                | 2,894 % éch. 22/07/2028            | 900                       | 903     | 0,19  |      |
| 1,000 % éch. 05/10/2026                         |                                     | 1 900                            | 1 892                     | 0,39           | National Australia Bank Ltd.                |                                  | 1 600                     | 1 578                     | 0,32                                | Westpac Banking Corp.              |                           |         |       |      |
| BNP Paribas Home Loan SFH S.A.                  |                                     | 2 100                            | 2 107                     | 0,43           | 0,010 % éch. 06/01/2029                     |                                  | 600                       | 596                       | 0,12                                | 1,079 % éch. 05/04/2027            | 2 370                     | 2 343   | 0,48  |      |
| 3,000 % éch. 25/05/2028                         |                                     |                                  |                           |                | 0,625 % éch. 16/03/2027                     |                                  | 1 000                     | 986                       | 0,20                                | Westpac Securities NZ Ltd.         |                           |         |       |      |
| BNP Paribas S.A.                                |                                     |                                  |                           |                | National Bank of Canada                     |                                  | 600                       | 596                       | 0,12                                | 0,010 % éch. 08/06/2028            | 1 500                     | 1 422   | 0,29  |      |
| 0,500 % éch. 30/05/2028                         |                                     | 900                              | 882                       | 0,18           | 0,010 % éch. 29/09/2026                     |                                  | 1 300                     | 1 285                     | 0,26                                | 3,750 % éch. 20/04/2028            | 1 400                     | 1 423   | 0,29  |      |
| 2,750 % éch. 25/07/2028                         |                                     | 800                              | 798                       | 0,16           | 0,125 % éch. 27/01/2027                     |                                  | 3 500                     | 3 594                     | 0,74                                | WPC Eurobond BV                    |                           |         |       |      |
| BPCE S.A.                                       |                                     |                                  |                           |                | Nationwide Building Society                 |                                  | 1 300                     | 1 285                     | 0,26                                | 2,125 % éch. 15/04/2027            | 200                       | 199     | 0,04  |      |
| 4,375 % éch. 13/07/2028                         |                                     | 800                              | 820                       | 0,17           | 2,375 % éch. 16/01/2029                     |                                  | 3 500                     | 3 594                     | 0,74                                | Yorkshire Building Society         |                           |         |       |      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.       |                                     |                                  |                           |                | NatWest Group PLC                           |                                  | 2 300                     | 2 296                     | 0,47                                | 0,010 % éch. 13/10/2027            | 3 500                     | 3 379   | 0,70  |      |
| 2,750 % éch. 12/04/2028                         |                                     | 2 100                            | 2 098                     | 0,43           | NIBC Bank NV                                |                                  | 1 700                     | 1 487                     | 0,31                                |                                    |                           | 193 904 | 39,90 |      |
| Canadian Imperial Bank of Commerce              |                                     |                                  |                           |                | 2,750 % éch. 26/03/2029                     |                                  | 1 600                     | 1 601                     | 0,33                                | INDUSTRIE                          |                           |         |       |      |
| 0,040 % éch. 09/07/2027                         |                                     | 1 900                            | 1 849                     | 0,38           | Nomura Holdings, Inc.                       | \$                               | 1 400                     | 1 404                     | 0,29                                | AbbVie, Inc.                       |                           |         |       |      |
| 3,250 % éch. 31/03/2027                         |                                     | 900                              | 904                       | 0,19           | 4,586 % éch. 29/06/2029                     |                                  | 1 400                     | 1 404                     | 0,29                                | 2,125 % éch. 17/11/2028            | 1 400                     | 1 371   | 0,28  |      |
| 4,297 % éch. 12/09/2028                         | £                                   | 1 500                            | 2 211                     | 0,45           | Nordea Bank Abp                             | €                                | 1 600                     | 1 601                     | 0,33                                | Abertis France S.A.S.              |                           |         |       |      |
| 4,495 % éch. 20/12/2027                         | AUD                                 | 1 500                            | 904                       | 0,19           | 2,613 % éch. 24/12/2027                     |                                  | 1 400                     | 1 404                     | 0,29                                | 0,625 % éch. 14/09/2028            | 900                       | 854     | 0,18  |      |
| Cie de Financement Foncier S.A.                 | €                                   | 1 200                            | 1 158                     | 0,24           | Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj            |                                  | 1 400                     | 1 404                     | 0,29                                | 2,500 % éch. 04/05/2027            | 700                       | 697     | 0,14  |      |
| 0,010 % éch. 25/10/2027                         |                                     | 900                              | 896                       | 0,18           | 2,875 % éch. 03/04/2029                     |                                  | 10 800                    | 1 445                     | 0,30                                | Alphabet, Inc.                     |                           |         |       |      |
| 0,225 % éch. 14/09/2026                         |                                     | 800                              | 776                       | 0,16           | Nykredit Realkredit A/S                     | DKK                              | 600                       | 592                       | 0,12                                | 4,125 % éch. 13/02/2029            | £ 2 400                   | 2 763   | 0,57  |      |
| 0,750 % éch. 11/01/2028                         |                                     | 1 500                            | 1 507                     | 0,31           | 1,000 % éch. 01/07/2026                     | €                                | 1 200                     | 1 242                     | 0,26                                | Amazon.com, Inc.                   | €                         | 1 400   | 1 400 | 0,29 |
| 3,125 % éch. 24/04/2027                         |                                     |                                  |                           |                | 1,375 % éch. 12/07/2027                     |                                  | 1 400                     | 1 393                     | 0,29                                | 2,800 % éch. 16/03/2028            |                           |         |       |      |
| Commonwealth Bank of Australia                  |                                     | 3 079                            | 2 979                     | 0,61           | 4,625 % éch. 19/01/2029                     |                                  | 1 000                     | 986                       | 0,20                                | Amcor UK Finance PLC               |                           |         |       |      |
| 0,750 % éch. 28/02/2028                         |                                     |                                  |                           |                | Realkredit Danmark A/S                      | DKK                              | 17 169                    | 2 283                     | 0,47                                | 1,125 % éch. 23/06/2027            | 600                       | 590     | 0,12  |      |
| Coventry Building Society Charitable Foundation |                                     | 2 540                            | 2 541                     | 0,52           | 1,000 % éch. 01/01/2027                     |                                  | 1 400                     | 1 393                     | 0,29                                | American Medical Systems Europe BV |                           |         |       |      |
| 2,625 % éch. 07/12/2026                         |                                     |                                  |                           |                | Royal Bank of Canada                        | €                                | 1 000                     | 986                       | 0,20                                | 1,375 % éch. 08/03/2028            | 800                       | 779     | 0,16  |      |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.              |                                     | 1 800                            | 1 799                     | 0,37           | 0,010 % éch. 21/01/2027                     |                                  | 148                       | 139                       | 0,03                                | Amprion GmbH                       |                           |         |       |      |
| 2,750 % éch. 12/01/2028                         |                                     |                                  |                           |                | 0,010 % éch. 05/10/2028                     |                                  | 1 600                     | 1 568                     | 0,32                                | 3,450 % éch. 22/09/2027            | 2 000                     | 2 010   | 0,41  |      |
| Crédit Mutuel Home Loan SFH S.A.                |                                     | 1 800                            | 1 800                     | 0,37           | 0,125 % éch. 26/04/2027                     |                                  | 2 100                     | 2 129                     | 0,44                                | APA Infrastructure Ltd.            |                           |         |       |      |
| 3,125 % éch. 22/06/2027                         |                                     | 1 500                            | 1 506                     | 0,31           | 2,625 % éch. 16/03/2029                     |                                  | 800                       | 805                       | 0,17                                | 2,000 % éch. 22/03/2027            | 300                       | 298     | 0,06  |      |
| Danske Bank A/S                                 |                                     |                                  |                           |                | 3,625 % éch. 07/03/2028                     |                                  | 4 400                     | 4 384                     | 0,90                                | Bayer AG                           |                           |         |       |      |
| 2,582 % éch. 19/05/2028                         |                                     | 1 400                            | 1 402                     | 0,29           | Santander UK Group Holdings PLC             |                                  | 800                       | 804                       | 0,17                                | 0,375 % éch. 12/01/2029            | 1 400                     | 1 310   | 0,27  |      |
| Deutsche Bank S.A. Espanola                     |                                     | 500                              | 502                       | 0,10           | 3,530 % éch. 25/08/2028                     |                                  | 1 400                     | 1 330                     | 0,27                                | 0,750 % éch. 06/01/2027            | 700                       | 693     | 0,14  |      |
| 3,625 % éch. 23/11/2026                         |                                     |                                  |                           |                | Santander UK PLC                            |                                  | 4 400                     | 4 384                     | 0,90                                | BMW Finance NV                     |                           |         |       |      |
| Dexia S.A.                                      |                                     | 2 700                            | 2 687                     | 0,55           | 2,625 % éch. 12/04/2028                     |                                  | 800                       | 804                       | 0,17                                | 2,703 % éch. 11/09/2027            | 1 100                     | 1 100   | 0,23  |      |
| 2,500 % éch. 05/04/2028                         |                                     |                                  |                           |                | 2,913 % éch. 24/03/2028                     |                                  |                           |                           |                                     | Chanel Ceres PLC                   |                           |         |       |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                | Sofina S.A.                                 |                                  | 1 400                     | 1 330                     | 0,27                                | 0,500 % éch. 31/07/2026            | 100                       | 100     | 0,02  |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                | 1,000 % éch. 23/09/2028                     |                                  |                           |                           |                                     |                                    |                           |         |       |      |

| DESCRIPTION                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Coca-Cola HBC Finance BV<br>3,375 % éch. 27/02/2028<br>3,375 % éch. 01/10/2028 | € 1 300<br>600                      | € 1 309<br>605                   | 0,27<br>0,12              | British Telecommunications Ltd.<br>1,500 % éch. 23/06/2027                                     | € 800                               | € 790                            | 0,16                      | Mortimer BTL PLC<br>4,916 % éch. 22/12/2056                                                   | £ 227                               | € 264                            | 0,05                      |
| Danfoss Finance BV<br>0,375 % éch. 28/10/2028                                  | 2 900                               | 2 728                            | 0,56                      | Électricité de France S.A.<br>2,510 % éch. 28/11/2027 (d)                                      | 1 300                               | 1 301                            | 0,27                      | Permanent Master Issuer PLC<br>4,247 % éch. 15/07/2073                                        | 1 900                               | 2 206                            | 0,45                      |
| Elia Transmission Belgium S.A.<br>1,375 % éch. 07/04/2027                      | 200                                 | 198                              | 0,04                      | 3,750 % éch. 05/06/2027                                                                        | 600                                 | 605                              | 0,12                      | PMF PLC<br>4,495 % éch. 16/02/2063                                                            | 1 500                               | 1 742                            | 0,36                      |
| Fresenius Medical Care AG<br>3,125 % éch. 08/12/2028                           | 700                                 | 700                              | 0,14                      | 3,875 % éch. 12/01/2027                                                                        | 600                                 | 603                              | 0,12                      | Polaris PLC<br>4,464 % éch. 27/06/2070                                                        | 2 000                               | 2 317                            | 0,48                      |
| Glencore Capital Finance DAC<br>1,125 % éch. 10/03/2028                        | 1 400                               | 1 356                            | 0,28                      | 4,125 % éch. 25/03/2027                                                                        | 600                                 | 607                              | 0,12                      | 4,505 % éch. 25/08/2068                                                                       | 1 541                               | 1 788                            | 0,37                      |
| H Lundbeck A/S<br>0,875 % éch. 14/10/2027                                      | 700                                 | 681                              | 0,14                      | ENEL Finance International NV<br>0,250 % éch. 17/06/2027                                       | 800                                 | 781                              | 0,16                      | 4,554 % éch. 27/10/2069                                                                       | 1 891                               | 2 195                            | 0,45                      |
| Hera SpA<br>0,875 % éch. 14/10/2026<br>0,875 % éch. 05/07/2027                 | 300<br>900                          | 299<br>883                       | 0,06<br>0,18              | Eurogrid GmbH<br>3,075 % éch. 18/10/2027                                                       | 1 300                               | 1 304                            | 0,27                      | 4,555 % éch. 26/02/2068                                                                       | 1 291                               | 1 499                            | 0,31                      |
| IMCD NV<br>2,125 % éch. 31/03/2027<br>4,875 % éch. 18/09/2028                  | 600<br>1 200                        | 596<br>1 236                     | 0,12<br>0,25              | FLUVIUS System Operator C.V.<br>0,250 % éch. 14/06/2028                                        | 600                                 | 569                              | 0,12                      | Precise Mortgage Funding PLC<br>4,716 % éch. 16/07/2060                                       | 447                                 | 520                              | 0,11                      |
| InterContinental Hotels Group PLC<br>2,125 % éch. 15/05/2027                   | 1 900                               | 1 887                            | 0,39                      | National Grid North America, Inc.<br>4,151 % éch. 12/09/2027                                   | 600                                 | 608                              | 0,13                      | Rochester Financing PLC<br>5,046 % éch. 18/12/2044                                            | 316                                 | 367                              | 0,08                      |
| JDE Peet's NV<br>0,625 % éch. 09/02/2028                                       | 1 881                               | 1 804                            | 0,37                      | National Grid PLC<br>0,163 % éch. 20/01/2028                                                   | 1 500                               | 1 437                            | 0,30                      | Silverstone Master Issuer PLC<br>4,197 % éch. 21/01/2079                                      | 1 300                               | 1 508                            | 0,31                      |
| Kinder Morgan, Inc.<br>2,250 % éch. 16/03/2027                                 | 1 300                               | 1 295                            | 0,27                      | 0,250 % éch. 01/09/2028                                                                        | 900                                 | 850                              | 0,18                      | Stratton BTL Mortgage Funding PLC<br>4,477 % éch. 20/01/2054                                  | 195                                 | 226                              | 0,05                      |
| Kraft Heinz Foods Co.<br>2,250 % éch. 25/05/2028                               | 1 600                               | 1 577                            | 0,33                      | Orange S.A.<br>2,500 % éch. 13/11/2028                                                         | 1 800                               | 1 781                            | 0,37                      | Stratton Mortgage Funding PLC<br>4,896 % éch. 20/06/2060                                      | 592                                 | 688                              | 0,14                      |
| Linde PLC<br>2,439 % éch. 20/11/2027                                           | 1 300                               | 1 300                            | 0,27                      | RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR<br>0,000 % éch. 09/09/2027 (b)                     | 800                                 | 774                              | 0,16                      | Together Asset-Backed Securitisation PLC<br>4,495 % éch. 15/08/2066                           | 1 997                               | 2 316                            | 0,48                      |
| Magnum Icc Finance BV<br>2,750 % éch. 26/02/2029                               | 2 600                               | 2 575                            | 0,53                      | TDC Net A/S<br>5,056 % éch. 31/05/2028                                                         | 1 200                               | 1 237                            | 0,25                      | Towd Point Mortgage Funding PLC<br>4,584 % éch. 20/04/2051                                    | 467                                 | 542                              | 0,11                      |
| Motability Operations Group PLC<br>0,125 % éch. 20/07/2028                     | 900                                 | 849                              | 0,18                      | Total des Obligations et billets privés                                                        | 263 603                             | 54,25                            |                           | 5,147 % éch. 20/02/2054                                                                       | 2 661                               | 3 096                            | 0,64                      |
| National Grid Electricity Transmission PLC<br>4,000 % éch. 08/06/2027          | £ 500                               | 577                              | 0,12                      | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                       |                                     |                                  |                           | Trinity Square PLC<br>4,647 % éch. 15/07/2059                                                 | 325                                 | 378                              | 0,08                      |
| Netflix, Inc.<br>3,625 % éch. 15/05/2027                                       | € 200                               | 202                              | 0,04                      | Fannie Mae<br>4,828 % éch. 25/11/2055                                                          | \$ 1 574                            | 1 394                            | 0,28                      | Twin Bridges PLC<br>4,927 % éch. 15/05/2056                                                   | 87                                  | 102                              | 0,02                      |
| Novartis Finance S.A.<br>1,125 % éch. 30/09/2027                               | 100                                 | 98                               | 0,02                      | 5,128 % éch. 25/06/2055                                                                        | 1 194                               | 1 060                            | 0,22                      | White Rose Master Issuer PLC<br>4,215 % éch. 16/07/2071                                       | 1 820                               | 2 112                            | 0,43                      |
| NTT Finance Corp.<br>0,399 % éch. 13/12/2028                                   | 1 400                               | 1 314                            | 0,27                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |                                                                                               | <b>50 875</b>                       | <b>10,47</b>                     |                           |
| 0,743 % éch. 16/07/2027                                                        | 1 100                               | 1 102                            | 0,23                      | Aldbrook Mortgage Transaction PLC<br>4,587 % éch. 18/02/2068                                   | £ 2 400                             | 2 785                            | 0,57                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,767 % éch. 20/06/2028 (a)                                                    | 1 500                               | 1 502                            | 0,31                      | Atlas Funding PLC<br>4,524 % éch. 20/07/2067                                                   | 1 881                               | 2 183                            | 0,45                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                                         | \$ 1 000                            | 869                              | 0,18                      | 4,586 % éch. 20/09/2061                                                                        | 310                                 | 360                              | 0,07                      | Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-Four SRL<br>2,849 % éch. 16/08/2040   | € 1 778                             | 1 784                            | 0,37                      |
| Rentokil Initial Finance BV<br>3,875 % éch. 27/06/2027                         | € 800                               | 806                              | 0,17                      | Avon Finance PLC<br>4,646 % éch. 28/12/2049                                                    | 562                                 | 653                              | 0,13                      | Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-Three SARL<br>2,915 % éch. 21/03/2034 | 293                                 | 293                              | 0,06                      |
| Revvity, Inc.<br>1,875 % éch. 19/07/2026                                       | 200                                 | 200                              | 0,04                      | Beckett Mortgages DAC<br>2,888 % éch. 20/10/2070                                               | € 2 153                             | 2 153                            | 0,44                      | Auto ABS French Loans<br>2,829 % éch. 24/07/2036                                              | 1 827                               | 1 828                            | 0,38                      |
| REWE International Finance BV<br>2,750 % éch. 03/07/2028                       | 1 500                               | 1 491                            | 0,31                      | Bowbell Master Issuer PLC<br>4,247 % éch. 23/07/2071                                           | £ 1 157                             | 1 342                            | 0,28                      | Auto ABS Italian Stella Loans SRL<br>2,939 % éch. 29/12/2036                                  | 1 019                               | 1 020                            | 0,21                      |
| Robert Bosch Finance LLC<br>3,250 % éch. 21/05/2029                            | 700                                 | 702                              | 0,15                      | Braccan Mortgage Funding PLC<br>4,588 % éch. 17/05/2067                                        | 779                                 | 905                              | 0,19                      | Auto ABS Spanish Loans<br>3,059 % éch. 28/09/2038                                             | 2 372                               | 2 378                            | 0,49                      |
| Sage Group PLC<br>3,820 % éch. 15/02/2028                                      | 1 500                               | 1 515                            | 0,31                      | Cheshire PLC<br>4,530 % éch. 28/06/2048                                                        | 848                                 | 983                              | 0,20                      | Auto1 Car Funding SARL<br>2,829 % éch. 15/12/2033                                             | 193                                 | 193                              | 0,04                      |
| Toyota Finance Australia Ltd.<br>2,280 % éch. 21/10/2027                       | 700                                 | 695                              | 0,14                      | Dilosk RMBS DAC<br>3,080 % éch. 24/09/2060                                                     | € 225                               | 225                              | 0,05                      | AutoFlorence SRL<br>2,968 % éch. 24/12/2044                                                   | 1 000                               | 1 003                            | 0,21                      |
| Toyota Motor Finance Netherlands BV<br>3,125 % éch. 21/04/2028                 | 1 100                               | 1 103                            | 0,23                      | 3,108 % éch. 20/07/2061                                                                        | 476                                 | 476                              | 0,10                      | Autonoria Spain<br>2,882 % éch. 30/04/2043                                                    | 1 417                               | 1 419                            | 0,29                      |
| Universal Music Group NV<br>3,000 % éch. 30/06/2027                            | 600                                 | 601                              | 0,12                      | Dutch Property Finance BV<br>2,913 % éch. 28/10/2059                                           | 810                                 | 810                              | 0,17                      | 2,942 % éch. 30/09/2041                                                                       | 469                                 | 470                              | 0,10                      |
| Volkswagen International Finance NV<br>1,875 % éch. 30/03/2027                 | 600                                 | 596                              | 0,12                      | Economic Master Issuer PLC<br>4,205 % éch. 25/04/2075                                          | £ 1 473                             | 1 708                            | 0,35                      | Bavarian Sky S.A.<br>2,705 % éch. 20/02/2034                                                  | 2 300                               | 2 301                            | 0,47                      |
| 4,250 % éch. 15/02/2028                                                        | 1 900                               | 1 933                            | 0,40                      | Elstree PLC<br>4,454 % éch. 21/01/2065                                                         | 419                                 | 486                              | 0,10                      | 2,715 % éch. 20/03/2032                                                                       | 287                                 | 287                              | 0,06                      |
| Wabtec Transportation Netherlands BV<br>1,250 % éch. 03/12/2027                | 1 300                               | 1 269                            | 0,26                      | Harbour PLC<br>4,475 % éch. 21/10/2065                                                         | 1 948                               | 2 259                            | 0,46                      | 2,845 % éch. 20/05/2033                                                                       | 842                                 | 843                              | 0,17                      |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc.<br>1,164 % éch. 15/11/2027                        | 1 400                               | 1 369                            | 0,28                      | Harvest Funding PLC<br>4,643 % éch. 15/11/2069                                                 | 2 200                               | 2 554                            | 0,53                      | 2,846 % éch. 20/08/2032                                                                       | 1 330                               | 1 332                            | 0,27                      |
|                                                                                |                                     | 53 787                           | 11,07                     | Holmes Master Issuer PLC<br>4,247 % éch. 15/10/2072                                            | 1 600                               | 1 856                            | 0,38                      | BBVA Consumer Auto<br>2,879 % éch. 19/05/2042                                                 | 2 222                               | 2 225                            | 0,46                      |
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>                                              |                                     |                                  |                           | 4,277 % éch. 15/10/2072                                                                        | 2 700                               | 3 134                            | 0,64                      | 3,117 % éch. 19/03/2038                                                                       | 522                                 | 524                              | 0,11                      |
| AT&T, Inc.<br>2,780 % éch. 16/09/2027                                          | 1 300                               | 1 302                            | 0,27                      | Lanark Master Issuer PLC<br>4,217 % éch. 22/12/2069                                            | 450                                 | 522                              | 0,11                      | Bumper NL BV<br>2,879 % éch. 24/01/2037                                                       | 1 800                               | 1 802                            | 0,37                      |
| BG Energy Capital PLC<br>2,250 % éch. 21/11/2029                               | 1 400                               | 1 363                            | 0,28                      | Lanebrook Mortgage Transaction PLC<br>4,546 % éch. 15/03/2061                                  | 535                                 | 622                              | 0,13                      | 2,925 % éch. 21/03/2036                                                                       | 1 115                               | 1 117                            | 0,23                      |
|                                                                                |                                     |                                  |                           | Mansard Mortgages PLC<br>4,516 % éch. 15/12/2049                                               | 177                                 | 206                              | 0,04                      | Cars Alliance Auto Leases France<br>2,845 % éch. 21/10/2040                                   | 1 800                               | 1 801                            | 0,37                      |
|                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           | Cars Alliance Auto Loans France<br>2,885 % éch. 23/10/2034                                    | 458                                 | 458                              | 0,09                      |
|                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           | Cars Alliance Auto Loans Germany<br>2,719 % éch. 18/03/2035                                   | 266                                 | 267                              | 0,05                      |
|                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           | 2,729 % éch. 18/01/2036                                                                       | 1 273                               | 1 274                            | 0,26                      |
|                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           | 2,829 % éch. 20/07/2037                                                                       | 783                                 | 784                              | 0,16                      |
|                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC<br>2,814 % éch. 15/12/2032                           | 18                                  | 18                               | 0,00                      |

Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Compartiment Driver UK Ten<br>4,335 % éch. 25/04/2033                | £ 1 022                             | € 1 188                          | 0,24                      | Silver Arrow S.A., Compartiment<br>2,529 % éch. 15/06/2031 | € 299                               | € 299                            | 0,06                      | Noria DE<br>2,832 % éch. 25/02/2043                                | € 458                               | € 458                            | 0,09                      |
| Compartiment Private Driver UK<br>4,387 % éch. 25/04/2031            | 363                                 | 421                              | 0,09                      | 2,569 % éch. 15/02/2030                                    | 48                                  | 48                               | 0,01                      | Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,054 % éch. 15/10/2034 | 383                                 | 383                              | 0,08                      |
| Driver UK Multi-Compartiment S.A.<br>4,315 % éch. 25/09/2033         | 2 000                               | 2 321                            | 0,48                      | 2,609 % éch. 15/09/2030                                    | 92                                  | 92                               | 0,02                      | 3,134 % éch. 15/07/2035                                            | 1 944                               | 1 945                            | 0,40                      |
| E-Carat DE<br>2,430 % éch. 25/02/2037                                | € 2 300                             | 2 300                            | 0,47                      | TitriSocram<br>2,805 % éch. 26/03/2039                     | 289                                 | 289                              | 0,06                      | 3,253 % éch. 15/05/2033                                            | 151                                 | 151                              | 0,03                      |
| FACT S.A.<br>2,935 % éch. 22/09/2031                                 | 376                                 | 377                              | 0,08                      | VCL Multi-Compartiment S.A.<br>2,725 % éch. 21/07/2031     | 1 411                               | 1 413                            | 0,29                      | 3,253 % éch. 15/08/2033                                            | 303                                 | 303                              | 0,06                      |
| FCT Autonoria DE<br>2,712 % éch. 26/01/2043                          | 212                                 | 212                              | 0,04                      | 2,745 % éch. 21/12/2029                                    | 134                                 | 134                              | 0,03                      | 3,273 % éch. 15/05/2034                                            | 399                                 | 400                              | 0,08                      |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                | 2 224                               | 2 227                            | 0,46                      | 2,775 % éch. 22/07/2030                                    | 245                                 | 245                              | 0,05                      | 3,283 % éch. 15/05/2034                                            | 315                                 | 316                              | 0,07                      |
| FTA Santander Consumer Spain Auto<br>2,980 % éch. 17/09/2043         | 2 022                               | 2 021                            | 0,42                      |                                                            |                                     |                                  |                           | 3,433 % éch. 15/02/2035                                            | 754                                 | 755                              | 0,16                      |
| 3,236 % éch. 22/09/2039                                              | 2 957                               | 2 965                            | 0,61                      |                                                            |                                     |                                  |                           | Penta CLO DAC<br>3,015 % éch. 25/07/2036                           | 1 900                               | 1 902                            | 0,39                      |
| Fulvia SPV SRL<br>3,030 % éch. 23/12/2041                            | 1 552                               | 1 555                            | 0,32                      |                                                            |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC<br>3,133 % éch. 15/11/2039                        | 1 400                               | 1 401                            | 0,29                      |
| Ginkgo Auto Loans<br>2,942 % éch. 25/07/2043                         | 119                                 | 119                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           | SC Germany S.A., Compartiment Consumer<br>2,779 % éch. 14/01/2038  | 311                                 | 311                              | 0,06                      |
| Globaldrive Auto Receivables BV<br>2,715 % éch. 22/06/2032           | 276                                 | 276                              | 0,06                      |                                                            |                                     |                                  |                           | 2,849 % éch. 15/09/2037                                            | 430                                 | 431                              | 0,09                      |
| Hill FL BV<br>2,909 % éch. 18/10/2033                                | 2 600                               | 2 600                            | 0,54                      |                                                            |                                     |                                  |                           | 2,859 % éch. 14/12/2038                                            | 795                                 | 798                              | 0,16                      |
| 2,939 % éch. 18/02/2035                                              | 1 216                               | 1 217                            | 0,25                      |                                                            |                                     |                                  |                           | Sculptor European CLO DAC<br>3,254 % éch. 15/10/2034               | 499                                 | 499                              | 0,10                      |
| 2,939 % éch. 18/06/2034                                              | 2 600                               | 2 603                            | 0,54                      |                                                            |                                     |                                  |                           | Takehau CLO DAC<br>3,301 % éch. 07/09/2035                         | 600                                 | 600                              | 0,12                      |
| Koromo UK PLC<br>4,305 % éch. 23/11/2032                             | £ 2 000                             | 2 322                            | 0,48                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| LT Autorahoitus DAC<br>2,789 % éch. 18/05/2035                       | € 141                               | 141                              | 0,03                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Pony S.A., Compartiment German Auto Loans<br>2,609 % éch. 14/12/2036 | 2 100                               | 2 100                            | 0,43                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,619 % éch. 14/12/2035                                              | 336                                 | 336                              | 0,07                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,769 % éch. 14/11/2032                                              | 1 858                               | 1 861                            | 0,38                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Red & Black Auto Germany UG<br>2,609 % éch. 15/08/2034               | 1 776                               | 1 776                            | 0,37                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,679 % éch. 15/09/2033                                              | 357                                 | 358                              | 0,07                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,719 % éch. 15/04/2034                                              | 1 059                               | 1 061                            | 0,22                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Red & Black Auto Italy SRL<br>3,209 % éch. 28/07/2034                | 259                                 | 260                              | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Red & Black Auto Lease France<br>2,513 % éch. 27/06/2039             | 1 078                               | 1 078                            | 0,22                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,769 % éch. 27/10/2040                                              | 1 900                               | 1 901                            | 0,39                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Retail Automotive CP Germany UG<br>2,985 % éch. 21/07/2034           | 149                                 | 149                              | 0,03                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| RevoCar S.A., Compartiment<br>2,789 % éch. 25/08/2038                | 1 872                               | 1 872                            | 0,39                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,819 % éch. 25/03/2038                                              | 576                                 | 577                              | 0,12                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,839 % éch. 25/07/2037                                              | 477                                 | 478                              | 0,10                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Revocar UG<br>2,845 % éch. 21/02/2037                                | 504                                 | 505                              | 0,10                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,905 % éch. 21/09/2036                                              | 839                                 | 840                              | 0,17                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,945 % éch. 21/04/2036                                              | 660                                 | 660                              | 0,14                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| SCF Rahoituspalvelut DAC<br>2,859 % éch. 25/06/2034                  | 236                                 | 236                              | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,979 % éch. 25/06/2033                                              | 253                                 | 254                              | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                    |                                     |                                  |                           |

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                | Court | 12/2027              | 383                   | € (132)                                 | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois juin                    | Long  | 06/2028              | 91                    | (32)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois septembre               | Court | 09/2027              | 425                   | 15                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre     | Long  | 03/2028              | 130                   | (155)                                   | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois septembre    | Long  | 12/2028              | 80                    | (103)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                      | Long  | 09/2026              | 1                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                    | Court | 09/2026              | 482                   | (60)                                    | (0,01)                 |
|                                                                            |       |                      |                       | € (466)                                 | (0,09)                 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé |       |                      |                       | € (466)                                 | (0,09)                 |

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA                                                | 07/2026           | DKK 12 148      | € 1 626           | € 1                | € 0                   | € 1                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | £ 1 640         | 1 895             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|                                                    | 01/2027           | DKK 6 362       | 855               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | € 112           | £ 97              | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | £ 448           | € 516             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 1 487        | 1 301             | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 01/2027           | DKK 2 209       | 297               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC                                                | 07/2026           | AUD 494         | 302               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 15            | CAD 24            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK                                                | 01/2027           | DKK 3 100       | € 416             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM                                                | 07/2026           | CAD 54          | \$ 38             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 38           | CAD 54            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           | CHF 27          | € 29              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | DKK 12 094      | 1 625             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 45            | CAD 72            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 665             | DKK 4 970         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 1 200        | € 1 056           | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | DKK 4 969       | 665               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 29            | CHF 27            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 1 700        | € 1 489           | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| MBC                                                | 07/2026           | DKK 2 727       | 365               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 88            | CHF 80            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | £ 2 392         | € 2 756           | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
| MYI                                                | 07/2026           | DKK 347         | 46                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 29 971        | £ 25 869          | 62                 | 0                     | 62                                      | 0,01                |
|                                                    | 08/2026           | £ 25 905        | € 29 971          | 0                  | (62)                  | (62)                                    | (0,01)              |
| SCX                                                | 07/2026           | AUD 671         | 411               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 705           | AUD 1 165         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 707             | DKK 5 282         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | AUD 1 168       | € 705             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG                                                | 08/2026           | DKK 5 280       | 707               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CAD 34          | 21                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | € 36 278        | £ 31 296          | 54                 | 0                     | 54                                      | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 5 005        | \$ 5 698          | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | £ 57 943        | € 66 804          | 0                  | (463)                 | (463)                                   | (0,10)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 3 647        | 3 126             | 0                  | (63)                  | (63)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | € 21            | CAD 34            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 31 339        | € 36 278          | 0                  | (54)                  | (54)                                    | (0,01)              |
| SSB                                                | 08/2026           | \$ 5 706        | 5 005             | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CHF 53          | 58                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 40           | CAD 55            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | € 58            | CHF 53            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 545          | € 477             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | € 761           | DKK 5 688         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | DKK 5 686       | € 761             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | € 170              | € (701)               | € (531)                                 | (0,11)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | € (531)                                 | (0,11)              |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       | € 481 622                               | 99,11               |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       | € 4 325                                 | 0,89                |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       | € 485 947                               | 100,00              |

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

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

- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Affilié au Fonds.
- (d) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,28 %) :

| Description de l'émetteur  | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|----------------------------|---------|-----------------|--------------|---------|--------------|---------------------|
| Électricité de France S.A. | 2,510 % | 28/11/2027      | 24/11/2025   | € 1 299 | € 1 301      | 0,27                |

Un montant en numéraire de 829 € (31 décembre 2025 : 767 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 290 € (31 décembre 2025 : 300 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.



Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 474 781                                            | € 0                                               | € 474 781        |
| Fonds d'investissement                        | 7 838                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 7 838            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (466)                                                                             | (531)                                                | 0                                                 | (997)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 7 372</b>                                                                    | <b>€ 474 250</b>                                     | <b>€ 0</b>                                        | <b>€ 481 622</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 447 524                                            | € 0                                               | € 447 524        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 14 300                                               | 0                                                 | 14 300           |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 120                                                                               | (81)                                                 | 0                                                 | 39               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 120</b>                                                                      | <b>€ 461 743</b>                                     | <b>€ 0</b>                                        | <b>€ 461 863</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | € (6)                                                      | € 0                     | € (6)                             | € S/O                                                      | € S/O                   | € S/O                             |
| BPS          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | (407)                                                      | 300                     | (107)                             |
| BRC          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | 9                                                          | 0                       | 9                                 |
| CBK          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 17                                                         | 0                       | 17                                | (23)                                                       | 0                       | (23)                              |
| MBC          | (22)                                                       | 0                       | (22)                              | 11                                                         | 0                       | 11                                |
| MYI          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 258                                                        | (260)                   | (2)                               |
| SCX          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | (39)                                                       | 0                       | (39)                              |
| SOG          | (526)                                                      | 290                     | (236)                             | 107                                                        | 0                       | 107                               |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 76,72            | 78,50                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 20,31            | 15,60                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,03             | 1,27                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,60             | S/O                  |
| Contrats de mise en pension                                      | S/O              | 3,05                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,00             | 0,05                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,03             | 0,09                 |
| Autres actifs                                                    | 1,31             | 1,44                 |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                       | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                           | 54,25            | 54,42                |
| Agences du gouvernement américain                                                       | 0,50             | S/O                  |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 10,47            | 8,25                 |
| Titres adossés à des actifs                                                             | 21,78            | 23,07                |
| Émissions souveraines                                                                   | 10,44            | 7,69                 |
| Instruments à court terme                                                               | 0,26             | 2,23                 |
| Fonds d'investissement                                                                  | 1,61             | S/O                  |
| Contrats de mise en pension                                                             | S/O              | 3,06                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                        |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                           | (0,09)           | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                |                  |                      |
| Contrats de change à terme                                                              | (0,11)           | (0,02)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                  | 0,89             | 1,27                 |
| <b>Actif net</b>                                                                        | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

| DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                      |                                     |                                  |                           | <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                  |                                     |                                  |                           | <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>AUTRICHE</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>AUTRICHE</b>                            |                                     |                                  |                           | <b>AUTRICHE</b>                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>     |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b> |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| ams-OSRAM AG                                   |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 09/12/3019                    | € 300                               | € 292                            | 0,05                      | 5,875 % éch. 17/04/2028                                                          | € 2 800                             | € 2 867                          | 0,48                      |
| 2,125 % éch. 03/11/2027                        | € 3 600                             | € 3 537                          | 0,59                      | 5,125 % éch. 14/03/3024                    | 500                                 | 512                              | 0,09                      | 6,000 % éch. 22/03/2029                                                          | 2 700                               | 2 781                            | 0,47                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| ams-OSRAM AG                                   |                                     |                                  |                           | TDC Net A/S                                | 2 200                               | 2 284                            | 0,38                      | Nexans S.A.                                                                      | 600                                 | 611                              | 0,10                      |
| 7,250 % éch. 31/05/2032                        | 2 400                               | 2 477                            | 0,42                      | 5,000 % éch. 09/08/2032                    |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 29/05/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| 10,500 % éch. 30/03/2029                       | 1 202                               | 1 283                            | 0,21                      | Total Danemark                             |                                     | 8 394                            | 1,41                      | RCI Banque S.A.                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Constantia Flexibles GmbH                      |                                     |                                  |                           | <b>FINLANDE</b>                            |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 24/09/2030 (e)(g)                                                   | 1 800                               | 1 809                            | 0,30                      |
| 6,250 % éch. 15/07/2032 (a)                    | 500                                 | 508                              | 0,09                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>       |                                     |                                  |                           | Renault S.A.                                                                     | 300                                 | 299                              | 0,05                      |
| Erste Group Bank AG                            |                                     |                                  |                           | Ahlstrom Holding Oy                        | 1 100                               | 1 099                            | 0,18                      | Société Générale S.A.                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/10/2027 (e)(g)                 | 2 200                               | 2 214                            | 0,37                      | 3,625 % éch. 04/02/2028                    | \$ 2 300                            | 1 991                            | 0,33                      | 3,875 % éch. 20/11/2035                                                          | 2 000                               | 1 992                            | 0,33                      |
|                                                |                                     | 6 482                            | 1,09                      | 4,875 % éch. 04/02/2028                    |                                     |                                  |                           | Ubisoft Entertainment S.A.                                                       |                                     |                                  |                           |
| Total Autriche                                 |                                     | 10 019                           | 1,68                      | Huhtamaki Oyj                              | € 100                               | 101                              | 0,02                      | 0,878 % éch. 24/11/2027 (i)                                                      | 1 600                               | 1 416                            | 0,24                      |
| <b>BELGIQUE</b>                                |                                     |                                  |                           | Total Finlande                             |                                     | 3 191                            | 0,53                      | Valeo SE                                                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | <b>FRANCE</b>                              |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 11/04/2030                                                          | 1 000                               | 1 015                            | 0,17                      |
| Azelis Finance NV                              |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>       |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 03/02/2033                                                          | 2 300                               | 2 301                            | 0,39                      |
| 4,750 % éch. 25/09/2029                        | 1 600                               | 1 633                            | 0,28                      | Atos Group                                 | 2 500                               | 2 475                            | 0,41                      | Viridien                                                                         |                                     |                                  |                           |
| KBC Group NV                                   |                                     |                                  |                           | 8,125 % éch. 21/05/2031                    | 900                                 | 1 034                            | 0,17                      | 8,500 % éch. 15/10/2030                                                          | \$ 1 718                            | 1 820                            | 0,30                      |
| 8,000 % éch. 05/09/2028 (e)(g)                 | 1 400                               | 1 512                            | 0,25                      | 9,360 % éch. 18/12/2029                    |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 15/10/2030                                                         | 894                                 | 831                              | 0,14                      |
| Manuchar Group SARL                            |                                     |                                  |                           | Banijay Gaming S.A.S.                      |                                     | 600                              | 0,10                      | Total France                                                                     |                                     | 70 820                           | 11,87                     |
| 7,401 % éch. 07/07/2032                        | 1 200                               | 1 196                            | 0,20                      | 5,125 % éch. 10/12/2031                    |                                     |                                  |                           | <b>ALLEMAGNE</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Ontex Group NV                                 |                                     |                                  |                           | Bertrand Franchise Finance S.A.S.          |                                     | 400                              | 0,07                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/04/2030                        | 600                                 | 546                              | 0,09                      | BNP Paribas Cardif S.A.                    |                                     | 500                              | 0,09                      | Bayer AG                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Total Belgique                                 |                                     | 4 887                            | 0,82                      | 6,125 % éch. 19/12/2033 (e)(g)             |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 25/03/2082                                                          | € 1 900                             | 1 962                            | 0,33                      |
| <b>BERMUDES</b>                                |                                     |                                  |                           | BNP Paribas S.A.                           |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 25/09/2083                                                          | 5 600                               | 6 197                            | 1,04                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 06/12/2029 (e)(g)             | \$ 1 000                            | 1 073                            | 0,18                      | Birkenstock Group BV & Co. KG                                                    |                                     |                                  |                           |
| Carnival Corp. Ltd.                            |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 17/11/2027 (e)(g)             |                                     | 1 200                            | 0,18                      | 4,500 % éch. 15/06/2033                                                          | 2 100                               | 2 123                            | 0,35                      |
| 5,750 % éch. 15/01/2030                        | \$ 800                              | 852                              | 0,14                      | CAB SELAS                                  | € 3 300                             | 3 301                            | 0,55                      | Cheplapharm Arzneimittel GmbH                                                    |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 15/08/2029                        | 100                                 | 91                               | 0,01                      | CCF Holding S.A.S.                         |                                     | 2 000                            | 0,34                      | 6,750 % éch. 15/02/2032                                                          | 2 900                               | 2 923                            | 0,49                      |
| Luca RE Ltd.                                   |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 27/05/2035                    |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/06/2031                                                          | 2 600                               | 2 670                            | 0,45                      |
| 9,036 % éch. 09/07/2032                        | 250                                 | 218                              | 0,04                      | CMA CGM S.A.                               |                                     | 1 100                            | 0,19                      | 7,500 % éch. 15/05/2030                                                          | 550                                 | 571                              | 0,09                      |
| Odjell Rig Ltd.                                |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/01/2031                    |                                     |                                  |                           | CT Investment GmbH                                                               |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 08/03/2031                        | 300                                 | 270                              | 0,04                      | Crédit Agricole Assurances S.A.            |                                     | 100                              | 0,02                      | 6,375 % éch. 15/04/2030                                                          | 2 600                               | 2 680                            | 0,45                      |
| Purple Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 17/06/2032 (e)(g)             |                                     |                                  |                           | Deutsche Bank AG                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 10,050 % éch. 07/06/2033                       | 250                                 | 219                              | 0,04                      | Crédit Agricole S.A.                       |                                     | 3 100                            | 0,55                      | 7,375 % éch. 30/10/2031 (e)(g)                                                   | 1 200                               | 1 305                            | 0,22                      |
| Tremont Re Ltd.                                |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 23/09/2028 (e)(g)             |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 01/12/2027 (e)(g)                                                  | 1 400                               | 1 510                            | 0,25                      |
| 7,786 % éch. 22/03/2033                        | 250                                 | 218                              | 0,04                      | Électricité de France S.A.                 |                                     | 800                              | 0,13                      | Fressnapf Holding SE                                                             |                                     |                                  |                           |
| Total Bermudes                                 |                                     | 1 868                            | 0,31                      | 3,375 % éch. 15/06/2030 (e)                | £ 4 200                             | 4 881                            | 0,82                      | 5,250 % éch. 31/10/2031                                                          | 3 200                               | 3 268                            | 0,55                      |
| <b>ÎLES CAÏMANS</b>                            |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 22/01/2029 (e)                |                                     |                                  |                           | Gruenthal GmbH                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 17/06/2035 (e)                | € 1 600                             | 1 952                            | 0,33                      | 4,125 % éch. 15/05/2028                                                          | 1 200                               | 1 206                            | 0,20                      |
| Health & Happiness International Holdings Ltd. |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 06/09/2028 (e)                | € 1 400                             | 1 506                            | 0,25                      | 6,750 % éch. 15/05/2030                                                          | 900                                 | 934                              | 0,16                      |
| 9,125 % éch. 24/07/2028                        | 2 800                               | 2 571                            | 0,43                      | 9,125 % éch. 15/03/2033 (e)                | \$ 1 300                            | 1 321                            | 0,22                      | Hornbach Baumarkt AG                                                             |                                     |                                  |                           |
| MM Mirage Bluewater Ltd.                       |                                     |                                  |                           | Eramet S.A.                                | € 1 900                             | 1 882                            | 0,32                      | 3,250 % éch. 25/10/2026                                                          | 800                                 | 800                              | 0,13                      |
| 8,750 % éch. 29/06/2029                        | 2 125                               | 1 845                            | 0,31                      | 7,250 % éch. 22/05/2028                    | 2 200                               | 2 234                            | 0,37                      | HT Troplast GmbH                                                                 |                                     |                                  |                           |
| UPCB Finance Ltd.                              |                                     |                                  |                           | Eutelsat Communications SACA               |                                     | 600                              | 0,10                      | 7,625 % éch. 15/07/2031 (a)                                                      | 700                                 | 711                              | 0,12                      |
| 3,625 % éch. 15/06/2029                        | € 594                               | 597                              | 0,10                      | 6,250 % éch. 15/03/2033                    |                                     | 700                              | 0,12                      | 9,375 % éch. 15/07/2028                                                          | 300                                 | 309                              | 0,05                      |
| Total Îles Caïmans                             |                                     | 5 013                            | 0,84                      | Forvia SE                                  |                                     |                                  |                           | IHO Verwaltungs GmbH                                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>CHINE</b>                                   |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 15/06/2027                    |                                     | 103                              | 0,02                      | 5,625 % éch. 15/05/2031                                                          | 4 300                               | 4 478                            | 0,75                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 15/02/2027                    |                                     | 663                              | 0,11                      | IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| Yango Justice International Ltd.               |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/06/2030                    | 1 200                               | 1 240                            | 0,21                      | 6,750 % éch. 15/11/2029 (b)                                                      | 4 100                               | 4 296                            | 0,72                      |
| 8,250 % éch. 25/11/2023 ^                      | \$ 300                              | 1                                | 0,00                      | Getlink SE                                 |                                     | 500                              | 0,09                      | LANXESS AG                                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>CHYPRE</b>                                  |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/04/2030                    |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 24/06/2031                                                          | 2 400                               | 2 367                            | 0,40                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | Goldstory S.A.S.                           |                                     | 500                              | 0,09                      | Mahle GmbH                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Atrium Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/02/2030                    |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/07/2032 (h)                                                      | 4 000                               | 4 221                            | 0,71                      |
| 2,625 % éch. 05/09/2027                        | € 1 450                             | 1 394                            | 0,23                      | HomeVi SASU                                | 2 400                               | 2 442                            | 0,41                      | Nidda Healthcare Holding GmbH                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                      |                                     |                                  |                           | Iliad Holding S.A.S.                       |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 23/10/2030                                                          | 500                                 | 504                              | 0,08                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/10/2028                    |                                     | 400                              | 0,07                      | 5,533 % éch. 15/10/2032                                                          | 1 300                               | 1 306                            | 0,22                      |
| EP Infrastructure A/S                          |                                     |                                  |                           | iliad S.A.                                 |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 21/02/2030                                                          | 1 200                               | 1 219                            | 0,20                      |
| 1,698 % éch. 30/07/2026                        | 4 200                               | 4 200                            | 0,70                      | 4,250 % éch. 15/12/2029                    | 2 400                               | 2 439                            | 0,41                      | 7,000 % éch. 21/02/2030 (h)                                                      | 500                                 | 517                              | 0,09                      |
| <b>DANEMARK</b>                                |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 09/01/2032                    | 3 300                               | 3 329                            | 0,56                      | PrestigeBidCo GmbH                                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>           |                                     |                                  |                           | Kapla Holding S.A.S.                       |                                     |                                  |                           | 5,954 % éch. 01/07/2029                                                          | 400                                 | 406                              | 0,07                      |
| Orsted A/S                                     |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 30/04/2032                    | 1 200                               | 1 210                            | 0,20                      | ProGroup AG                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 18/02/2021                        | 6 000                               | 5 306                            | 0,89                      | 5,199 % éch. 30/04/2033                    | 900                                 | 911                              | 0,15                      | 5,125 % éch. 15/04/2029                                                          | 1 000                               | 1 024                            | 0,17                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | Loxam S.A.S.                               |                                     |                                  |                           | Schaeffler AG                                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/02/2027                    |                                     | 400                              | 0,07                      | 3,375 % éch. 12/10/2028                                                          | 1 600                               | 1 594                            | 0,27                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/05/2028                    | 2 100                               | 2 138                            | 0,36                      | 4,500 % éch. 14/08/2026                                                          | 400                                 | 401                              | 0,07                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 31/05/2029                    | 810                                 | 835                              | 0,14                      | 4,500 % éch. 12/05/2032                                                          | 1 800                               | 1 804                            | 0,30                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | New Immo Holding S.A.                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 13/05/2033                                                          | 2 400                               | 2 432                            | 0,41                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 08/12/2028                    | 900                                 | 904                              | 0,15                      | 5,375 % éch. 01/04/2031                                                          | 1 300                               | 1 361                            | 0,23                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 14/11/2030                    | 2 100                               | 2 097                            | 0,35                      | Techem Verwaltungsgesellschaft mbH                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/07/2032                                                          | 500                                 | 504                              | 0,08                      |
|                                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | TK Elevator Midco GmbH                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/07/2027                                                          | 700                                 | 703                              | 0,12                      |
|                                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | ZF Finance GmbH                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 21/09/2028                                                          | 900                                 | 895                              | 0,15                      |
|                                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     | 59 201                           | 9,92                      |

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

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                          | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |         |        |      |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------|---------|--------|------|
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS          |                                     |                                  |                           | Gg12 SpA                |                                                       |                                  |                           | Cirsa Finance International SARL |                                     |                                                           |                           |         |        |      |
| CeramTec AcquiCo GmbH                    |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/04/2033 | €                                                     | 2 050                            | € 2 102                   | 0,35                             | 4,875 % éch. 15/10/2031             | €                                                         | 1 800                     | € 1 834 | 0,31   |      |
| TBD % éch. 16/03/2032                    | €                                   | 2 500                            | € 2 519                   | 0,42                    | Gruppo San Donato SpA                                 |                                  |                           |                                  | 6,500 % éch. 15/03/2029             |                                                           | 900                       | 932     | 0,16   |      |
| TK Elevator Midco GmbH                   |                                     |                                  |                           |                         | 6,500 % éch. 31/10/2031 (i)                           |                                  | 2 600                     | 2 579                            | 0,43                                | 7,875 % éch. 31/07/2028                                   |                           | 400     | 410    | 0,07 |
| 5,149 % éch. 30/04/2030                  |                                     | 500                              | 503                       | 0,09                    | IMA Industria Macchine Automatiche SpA                |                                  |                           |                                  | Consolidated Energy Finance S.A.    |                                                           |                           |         |        |      |
|                                          |                                     |                                  | 3 022                     | 0,51                    | 3,750 % éch. 15/01/2028                               |                                  | 1 000                     | 1 004                            | 0,17                                | 5,000 % éch. 15/10/2028                                   |                           | 900     | 857    | 0,14 |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         | 5,954 % éch. 15/04/2029                               |                                  | 2 400                     | 2 436                            | 0,41                                | ContourGlobal Power Holdings S.A.                         |                           |         |        |      |
| Total Allemagne                          |                                     |                                  | 62 223                    | 10,43                   | Infrastrutture Wireless Italiane SpA                  |                                  |                           |                                  | 5,000 % éch. 28/02/2030             |                                                           | 2 400                     | 2 437   | 0,41   |      |
| GIBRALTAR                                |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 13/10/2032 |                                                       | 1 400                            | 1 344                     | 0,23                             | CPI Property Group S.A.             |                                                           |                           |         |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/04/2030 |                                                       | 3 300                            | 3 268                     | 0,55                             | 1,750 % éch. 14/01/2030             |                                                           | 3 000                     | 2 632   | 0,44   |      |
| 888 Acquisitions Ltd.                    |                                     |                                  |                           |                         | Intesa Sanpaolo SpA                                   |                                  |                           |                                  | 3,750 % éch. 28/04/2028 (e)         |                                                           | 600                       | 556     | 0,09   |      |
| 8,000 % éch. 30/09/2031                  |                                     | 600                              | 621                       | 0,10                    | 5,500 % éch. 01/03/2028 (e)(g)                        |                                  | 2 050                     | 2 093                            | 0,35                                | 4,000 % éch. 22/01/2028                                   | £                         | 1 200   | 1 356  | 0,23 |
| GRÈCE                                    |                                     |                                  |                           |                         | Italmatch Chemicals SpA                               |                                  |                           |                                  | 4,750 % éch. 22/07/2030             | €                                                         | 3 000                     | 2 866   | 0,48   |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | 6,250 % éch. 05/02/2031                               |                                  | 500                       | 510                              | 0,09                                | 6,000 % éch. 27/01/2032                                   |                           | 100     | 98     | 0,02 |
| Metlen Energy & Metals S.A.              |                                     |                                  |                           |                         | 6,416 % éch. 05/02/2031                               |                                  | 1 200                     | 1 215                            | 0,20                                | 7,500 % éch. 26/03/2031 (e)                               |                           | 735     | 686    | 0,11 |
| 3,875 % éch. 26/05/2031 (i)              |                                     | 3 500                            | 3 359                     | 0,56                    | Lottomatica Group SpA                                 |                                  |                           |                                  |                                     | Ephios Subco SARL                                         |                           |         |        |      |
| Piraeus Bank S.A.                        |                                     |                                  |                           |                         | 4,625 % éch. 30/04/2032                               |                                  | 1 700                     | 1 713                            | 0,29                                | 7,875 % éch. 31/01/2031 (i)                               |                           | 2 200   | 2 324  | 0,39 |
| 3,875 % éch. 03/11/2027                  |                                     | 700                              | 702                       | 0,12                    | Mundys SpA                                            |                                  |                           |                                  |                                     | Ephios Subco SARL (9,250 % en espèces ou 10,000 % en PIK) |                           |         |        |      |
| Total Grèce                              |                                     |                                  | 4 061                     | 0,68                    | 1,875 % éch. 13/07/2027                               |                                  | 413                       | 408                              | 0,07                                | 9,250 % éch. 15/01/2032 (b)                               |                           | 1 400   | 1 387  | 0,23 |
| GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES          |                                     |                                  |                           |                         | 4,500 % éch. 24/01/2030                               |                                  | 300                       | 309                              | 0,05                                | Essendi S.A.                                              |                           |         |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | Neopharmed Gentili SpA                                |                                  |                           |                                  |                                     | 5,375 % éch. 15/05/2030                                   |                           | 1 800   | 1 840  | 0,31 |
| Globalworth Real Estate Investments Ltd. |                                     |                                  |                           |                         | 5,543 % éch. 29/06/2033                               |                                  | 2 500                     | 2 531                            | 0,42                                | 5,500 % éch. 15/11/2031                                   |                           | 1 800   | 1 830  | 0,31 |
| 6,250 % éch. 31/03/2030                  |                                     | 568                              | 580                       | 0,10                    | TeamSystem SpA                                        |                                  |                           |                                  |                                     | 6,375 % éch. 15/10/2029                                   |                           | 100     | 104    | 0,02 |
| HONG KONG                                |                                     |                                  |                           |                         | 5,000 % éch. 01/07/2031                               |                                  | 500                       | 483                              | 0,08                                | Froneri Lux FinCo SARL                                    |                           |         |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | 5,454 % éch. 01/07/2032                               |                                  | 1 000                     | 985                              | 0,17                                | 4,750 % éch. 01/08/2032                                   |                           | 2 500   | 2 442  | 0,41 |
| Fortune Star BVI Ltd.                    |                                     |                                  |                           |                         | 5,704 % éch. 31/07/2031                               |                                  | 500                       | 497                              | 0,08                                | Intralot Capital Luxembourg S.A.                          |                           |         |        |      |
| 5,875 % éch. 20/11/2030                  |                                     | 1 100                            | 1 083                     | 0,18                    | Telecom Italia SpA                                    |                                  |                           |                                  |                                     | 6,731 % éch. 15/10/2031                                   |                           | 1 100   | 1 112  | 0,19 |
| IRLANDE                                  |                                     |                                  |                           |                         | 2,375 % éch. 12/10/2027                               |                                  | 800                       | 800                              | 0,13                                | 6,750 % éch. 15/10/2031                                   |                           | 2 600   | 2 643  | 0,44 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | UniCredit SpA                                         |                                  |                           |                                  |                                     | ION Platform Finance SARL                                 |                           |         |        |      |
| AIB Group PLC                            |                                     |                                  |                           |                         | 7,296 % éch. 02/04/2034                               | \$                               | 400                       | 368                              | 0,06                                | 6,500 % éch. 30/09/2030                                   |                           | 2 100   | 1 694  | 0,28 |
| 6,000 % éch. 14/07/2031 (e)(g)           |                                     | 1 300                            | 1 350                     | 0,23                    | Total Italie                                          |                                  |                           | 32 292                           | 5,41                                | LHMC Finco 2 SARL (8,625 % en espèces ou 9,375 % en PIK)  |                           |         |        |      |
| 7,125 % éch. 30/10/2029 (e)(g)           |                                     | 1 300                            | 1 404                     | 0,24                    | JAPON                                                 |                                  |                           |                                  |                                     | 8,625 % éch. 15/05/2030 (b)                               |                           | 524     | 541    | 0,09 |
| Bank of Ireland Group PLC                |                                     |                                  |                           |                         | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                  |                           |                                  |                                     | Maxam Prill SARL                                          |                           |         |        |      |
| 6,375 % éch. 10/03/2030 (e)(g)           |                                     | 800                              | 846                       | 0,14                    | Nissan Motor Co. Ltd.                                 |                                  |                           |                                  |                                     | 6,000 % éch. 15/07/2030                                   |                           | 3 350   | 3 423  | 0,57 |
| 6,750 % éch. 01/03/2033                  |                                     | 200                              | 209                       | 0,03                    | 3,201 % éch. 17/09/2028                               | €                                | 500                       | 495                              | 0,08                                | Motion Finco SARL                                         |                           |         |        |      |
| 7,594 % éch. 06/12/2032                  | £                                   | 600                              | 716                       | 0,12                    | 5,250 % éch. 17/07/2029                               |                                  | 2 200                     | 2 236                            | 0,37                                | 7,375 % éch. 15/06/2030                                   |                           | 1 000   | 873    | 0,15 |
| Quercus Re DAC                           |                                     |                                  |                           |                         | Rakuten Group, Inc.                                   |                                  |                           |                                  |                                     | NJJ Continental SA                                        |                           |         |        |      |
| 10,149 % éch. 06/01/2031                 | €                                   | 250                              | 254                       | 0,04                    | 4,250 % éch. 22/04/2027 (e)                           |                                  | 3 200                     | 3 174                            | 0,53                                | 4,500 % éch. 30/01/2030                                   |                           | 300     | 305    | 0,05 |
| 13,324 % éch. 07/01/2031                 |                                     | 250                              | 254                       | 0,04                    | SoftBank Group Corp.                                  |                                  |                           |                                  |                                     | Rossini SARL                                              |                           |         |        |      |
| Total Irlande                            |                                     |                                  | 5 033                     | 0,84                    | 2,875 % éch. 06/01/2027                               |                                  | 1 300                     | 1 297                            | 0,22                                | 6,750 % éch. 31/12/2029                                   |                           | 2 200   | 2 283  | 0,38 |
| ÎLE DE MAN                               |                                     |                                  |                           |                         | 3,375 % éch. 06/07/2029                               |                                  | 300                       | 288                              | 0,05                                | Samsonite Finco SARL                                      |                           |         |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | 4,000 % éch. 19/09/2029                               |                                  | 600                       | 589                              | 0,10                                | 4,375 % éch. 15/02/2033                                   |                           | 600     | 591    | 0,10 |
| Entain PLC                               |                                     |                                  |                           |                         | 5,000 % éch. 15/04/2028                               |                                  | 2 400                     | 2 433                            | 0,41                                | Total Luxembourg                                          |                           |         | 43 843 | 7,35 |
| 4,875 % éch. 30/11/2031                  |                                     | 2 100                            | 2 128                     | 0,36                    | 5,750 % éch. 08/07/2032                               |                                  | 1 100                     | 1 098                            | 0,18                                | ÎLES MARSHALL                                             |                           |         |        |      |
| Playtech PLC                             |                                     |                                  |                           |                         | 5,875 % éch. 10/07/2031                               |                                  | 400                       | 402                              | 0,07                                | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                           |         |        |      |
| 5,875 % éch. 28/06/2028                  |                                     | 400                              | 407                       | 0,07                    | 6,375 % éch. 10/07/2033                               |                                  | 400                       | 402                              | 0,07                                | International Seaways, Inc.                               |                           |         |        |      |
| Total Île de Man                         |                                     |                                  | 2 535                     | 0,43                    | 7,000 % éch. 22/04/2032                               |                                  | 2 400                     | 2 507                            | 0,42                                | 7,125 % éch. 23/09/2030                                   | \$                        | 1 375   | 1 220  | 0,20 |
| ISRAËL                                   |                                     |                                  |                           |                         | 8,250 % éch. 22/10/2031                               | \$                               | 3 200                     | 2 890                            | 0,48                                | MULTINATIONALES                                           |                           |         |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | Total Japon                                           |                                  |                           | 17 811                           | 2,98                                | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                           |         |        |      |
| Energean Israel Finance Ltd.             |                                     |                                  |                           |                         | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES                          |                                  |                           |                                  |                                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                           |         |        |      |
| 5,375 % éch. 30/03/2028                  | \$                                  | 3 300                            | 2 857                     | 0,48                    | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                  |                           |                                  |                                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                           |         |        |      |
| ITALIE                                   |                                     |                                  |                           |                         | CPUK Finance Ltd.                                     |                                  |                           |                                  |                                     | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC                    |                           |         |        |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS               |                                     |                                  |                           |                         | 4,500 % éch. 28/08/2027                               | £                                | 500                       | 574                              | 0,10                                | 3,250 % éch. 01/09/2028                                   |                           | 3 225   | 2 703  | 0,45 |
| Golden Bar Securitisation SRL            |                                     |                                  |                           |                         | G City Europe Ltd.                                    |                                  |                           |                                  |                                     | Stonepeak Motion Holdco Ltd.                              |                           |         |        |      |
| 3,216 % éch. 22/09/2043                  | €                                   | 479                              | 481                       | 0,08                    | 3,625 % éch. 04/08/2026 (e)(i)                        | €                                | 1 800                     | 1 509                            | 0,25                                | 5,000 % éch. 15/07/2033 (a)                               | €                         | 600     | 605    | 0,10 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                    |                                  |                           | 2 083                            | 0,35                                | Total Multinationales                                     |                           |         | 3 308  | 0,55 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           |                         | LITUANIE                                              |                                  |                           |                                  |                                     | PAYS-BAS                                                  |                           |         |        |      |
| Agrifarma SpA                            |                                     |                                  |                           |                         | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                  |                           |                                  |                                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                           |         |        |      |
| 4,500 % éch. 31/10/2028                  |                                     | 1 500                            | 1 512                     | 0,25                    | Maxima Grupe UAB                                      |                                  |                           |                                  |                                     | ABN AMRO Bank NV                                          |                           |         |        |      |
| Value SpA                                |                                     |                                  |                           |                         | 4,750 % éch. 19/05/2031                               |                                  | 1 600                     | 1 613                            | 0,27                                | 4,750 % éch. 22/09/2027 (e)(g)                            |                           | 1 300   | 1 313  | 0,22 |
| 7,000 % éch. 28/02/2030                  |                                     | 200                              | 210                       | 0,04                    | LUXEMBOURG                                            |                                  |                           |                                  |                                     | Ashland Services BV                                       |                           |         |        |      |
| Fibercop SpA                             |                                     |                                  |                           |                         | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                         |                                  |                           |                                  |                                     | 2,000 % éch. 30/01/2028                                   |                           | 600     | 588    | 0,10 |
| 5,125 % éch. 30/06/2032                  |                                     | 3 500                            | 3 603                     | 0,60                    | Aegis Lux SARL (5,625 % en espèces ou 5,625 % en PIK) |                                  |                           |                                  |                                     | ASR Nederland NV                                          |                           |         |        |      |
| 5,375 % éch. 15/04/2031                  |                                     | 1 900                            | 1 973                     | 0,33                    | 5,625 % éch. 29/10/2031 (b)                           |                                  | 600                       | 611                              | 0,10                                | 4,625 % éch. 19/10/2027 (e)(g)                            |                           | 2 100   | 2 117  | 0,35 |
| 7,750 % éch. 24/01/2033                  |                                     | 300                              | 349                       | 0,06                    | Alexandrite Lake Lux Holdings SARL                    |                                  |                           |                                  |                                     | BE Semiconductor Industries NV                            |                           |         |        |      |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         | 6,750 % éch. 30/07/2030                               |                                  | 2 500                     | 2 503                            | 0,42                                | 4,500 % éch. 15/07/2031                                   |                           | 500     | 521    | 0,09 |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         | Arena Luxembourg Finance SARL                         |                                  |                           |                                  |                                     | Boels Topholding BV                                       |                           |         |        |      |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         | 4,500 % éch. 30/06/2031                               |                                  | 1 400                     | 1 412                            | 0,24                                | 5,750 % éch. 15/05/2030                                   |                           | 900     | 927    | 0,16 |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         | Cidron Aida Finco SARL                                |                                  |                           |                                  |                                     | Citycon Treasury BV                                       |                           |         |        |      |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         | 7,000 % éch. 27/10/2031                               |                                  | 1 300                     | 1 261                            | 0,21                                | 1,625 % éch. 12/03/2028                                   |                           | 2 400   | 2 273  | 0,38 |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         |                                                       |                                  |                           |                                  |                                     | 5,000 % éch. 11/03/2030                                   |                           | 1 200   | 1 163  | 0,20 |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         |                                                       |                                  |                           |                                  |                                     | 6,500 % éch. 08/03/2029                                   |                           | 1 500   | 1 535  | 0,26 |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         |                                                       |                                  |                           |                                  |                                     | Cooperatieve Rabobank UA                                  |                           |         |        |      |
|                                          |                                     |                                  |                           |                         |                                                       |                                  |                           |                                  |                                     | 3,100 % éch. 29/06/2028 (e)(a)                            |                           | 600     | 588    | 0,10 |

| DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Dufry One BV                               |                                     |                                  |                           | <b>ESPAGNE</b>                                   |                                     |                                  |                           | Barclays PLC                               |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 11/06/2033                    | € 100                               | € 101                            | 0,02                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>             |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 15/09/2031 (e)(g)             | £ 600                               | € 743                            | 0,12                      |
| Eastern European Electric Co. BV           |                                     |                                  |                           | ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A. |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 15/09/2027 (e)(g)             | 900                                 | 1 083                            | 0,18                      |
| 6,500 % éch. 15/05/2030                    | 1 100                               | 1 147                            | 0,19                      | 3,750 % éch. 11/06/2030                          | € 3 200                             | € 3 197                          | 0,54                      | 9,250 % éch. 15/09/2028 (e)(g)             | 1 200                               | 1 481                            | 0,25                      |
| Flora Food Management BV                   |                                     |                                  |                           | Banco de Sabadell S.A.                           |                                     |                                  |                           | BCP Modular Services Finance PLC           |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 02/07/2029                    | 3 300                               | 3 228                            | 0,54                      | 6,500 % éch. 20/05/2031 (e)(g)                   | 1 200                               | 1 266                            | 0,21                      | 4,750 % éch. 30/11/2028                    | € 1 300                             | 1 234                            | 0,21                      |
| ING Groep NV                               |                                     |                                  |                           | Banco Santander S.A.                             |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 10/07/2031 (i)                | 800                                 | 696                              | 0,12                      |
| 3,875 % éch. 16/05/2027 (e)(g)             | \$ 1 600                            | 1 380                            | 0,23                      | 4,125 % éch. 12/11/2027 (e)(g)                   | 2 200                               | 2 200                            | 0,37                      | Boparan Finance PLC                        |                                     |                                  |                           |
| IPD BV                                     |                                     |                                  |                           | Bankinter S.A.                                   |                                     |                                  |                           | 9,375 % éch. 07/11/2029                    | £ 2 205                             | 2 706                            | 0,45                      |
| 5,776 % éch. 15/06/2031 (i)                | € 3 200                             | 3 183                            | 0,53                      | 6,000 % éch. 30/06/2030 (e)(g)                   | 2 200                               | 2 288                            | 0,38                      | Canary Wharf Group Investment Holdings PLC |                                     |                                  |                           |
| Nouryon Finance BV                         |                                     |                                  |                           | CaixaBank S.A.                                   |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 23/04/2028                    | 5 400                               | 6 024                            | 1,01                      |
| 6,125 % éch. 15/07/2031 (a)                | 1 500                               | 1 525                            | 0,26                      | 5,875 % éch. 09/10/2027 (e)(g)                   | 600                                 | 615                              | 0,10                      | Carnival UK Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| Q-Park Holding BV                          |                                     |                                  |                           | Celsa Opco S.A.                                  |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/07/2031                    | € 5 300                             | 5 338                            | 0,89                      |
| 3,875 % éch. 01/09/2031                    | 300                                 | 297                              | 0,05                      | 8,250 % éch. 15/12/2030                          | 2 900                               | 3 094                            | 0,52                      | CD&R Firefly Bidco PLC                     |                                     |                                  |                           |
| 4,231 % éch. 01/09/2031                    | 950                                 | 952                              | 0,16                      | Grifols S.A.                                     |                                     |                                  |                           | 8,625 % éch. 30/04/2029                    | £ 3 600                             | 4 310                            | 0,72                      |
| Stellantis NV                              |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/05/2030 (h)                      | 2 708                               | 2 823                            | 0,47                      | Deuce Finco PLC                            |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 16/03/2031 (e)                | 3 200                               | 3 140                            | 0,53                      | Grupo Antolin-Irausa S.A.                        |                                     |                                  |                           | 5,901 % éch. 20/11/2032                    | € 1 200                             | 1 223                            | 0,21                      |
| 6,875 % éch. 16/12/2033 (e)                | 2 900                               | 2 833                            | 0,47                      | 3,500 % éch. 30/04/2028                          | 1 100                               | 520                              | 0,09                      | EC Finance PLC                             |                                     |                                  |                           |
| Telefonica Europe BV                       |                                     |                                  |                           | Molins Finance S.A.                              |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/10/2026                    | 4 000                               | 3 993                            | 0,67                      |
| 5,752 % éch. 15/01/2032 (e)                | 2 700                               | 2 861                            | 0,48                      | 5,500 % éch. 15/06/2033                          | 1 100                               | 1 151                            | 0,19                      | EnQuest PLC                                |                                     |                                  |                           |
| 6,135 % éch. 03/02/2030 (e)                | 3 500                               | 3 728                            | 0,62                      | Neinor Homes S.A.                                |                                     |                                  |                           | 9,875 % éch. 30/04/2031                    | \$ 2 300                            | 2 059                            | 0,35                      |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/02/2030                          | 500                                 | 517                              | 0,09                      | Future PLC                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 01/06/2031                    | 4 400                               | 4 435                            | 0,74                      | Telefonica Emisiones S.A.                        |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 10/07/2030                    | £ 1 700                             | 1 846                            | 0,31                      |
| 4,375 % éch. 09/05/2030                    | 5 600                               | 5 711                            | 0,96                      | 4,881 % éch. 19/01/2034 (e)                      | 2 500                               | 2 484                            | 0,42                      | Gatwick Airport Finance PLC                |                                     |                                  |                           |
| Veon Midco BV                              |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 21/11/2030                    | 2 000                               | 2 311                            | 0,39                      |
| 6,950 % éch. 01/06/2031                    | \$ 800                              | 699                              | 0,12                      |                                                  |                                     |                                  |                           | Heathrow Finance PLC                       |                                     |                                  |                           |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                    | 800                                 | 698                              | 0,12                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>           |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/03/2027                    | 3 000                               | 3 454                            | 0,58                      |
| VZ Secured Financing BV                    |                                     |                                  |                           | Subcalidora                                      |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 01/09/2029                    | 1 700                               | 1 858                            | 0,31                      |
| 5,000 % éch. 15/01/2033                    | 2 700                               | 2 069                            | 0,35                      | 8,041 % éch. 14/08/2029                          | 2 000                               | 1 989                            | 0,33                      | INEOS Finance PLC                          |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/01/2033                    | 1 100                               | 922                              | 0,15                      | Total Espagne                                    |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 15/11/2031                    | € 800                               | 770                              | 0,13                      |
| Wintershall Dea Finance BV                 |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | INEOS Quattro Finance PLC                  |                                     |                                  |                           |
| 6,117 % éch. 08/05/2030 (e)                | € 3 700                             | 3 837                            | 0,64                      | <b>SUÈDE</b>                                     |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/03/2029                    | 600                                 | 550                              | 0,09                      |
| ZF Europe Finance BV                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>             |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 15/03/2029                    | \$ 400                              | 329                              | 0,06                      |
| 4,750 % éch. 31/01/2029                    | 600                                 | 603                              | 0,10                      | Castellum AB                                     |                                     |                                  |                           | Ithaca Energy North Sea PLC                |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/02/2032                    | 200                                 | 198                              | 0,03                      | 3,125 % éch. 02/12/2026 (e)                      | 3 500                               | 3 471                            | 0,58                      | 5,500 % éch. 01/10/2031                    | € 1 100                             | 1 099                            | 0,18                      |
| 7,000 % éch. 12/06/2030                    | 6 400                               | 6 816                            | 1,14                      | Dometic Group AB                                 |                                     |                                  |                           | ITV PLC                                    |                                     |                                  |                           |
| Ziggo BV                                   |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 11/09/2030                          | 2 200                               | 2 186                            | 0,37                      | 4,250 % éch. 19/06/2032                    | 1 200                               | 1 241                            | 0,21                      |
| 4,875 % éch. 15/01/2030                    | \$ 3 500                            | 2 876                            | 0,48                      | Heimstaden AB                                    |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC                   |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | 7,361 % éch. 24/01/2031                          | 2 600                               | 2 652                            | 0,44                      | 7,875 % éch. 27/06/2029 (e)(g)             | £ 900                               | 1 091                            | 0,18                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 29/01/2030                          | 1 000                               | 1 049                            | 0,18                      | 8,500 % éch. 27/03/2028 (e)(g)             | 800                                 | 972                              | 0,16                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | Heimstaden Bostad AB                             |                                     |                                  |                           | Market Bidco Finco PLC                     |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 13/10/2026 (e)                      | 3 900                               | 3 885                            | 0,65                      | 6,750 % éch. 31/01/2031                    | € 2 700                             | 2 677                            | 0,45                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 19/01/2031 (e)                      | 700                                 | 684                              | 0,11                      | Miller Homes Group Finco PLC               |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB        |                                     |                                  |                           | 6,533 % éch. 15/10/2030 (h)                | 1 900                               | 1 903                            | 0,32                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 14/11/2028                          | 3 800                               | 3 361                            | 0,56                      | 7,000 % éch. 15/05/2029                    | £ 1 400                             | 1 624                            | 0,27                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch. 26/09/2029                          | 1 700                               | 1 423                            | 0,24                      | Mobico Group PLC                           |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 12/07/2027                          | 600                                 | 583                              | 0,10                      | 4,875 % éch. 26/09/2031                    | € 1 200                             | 961                              | 0,16                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 04/08/2026                          | 950                                 | 950                              | 0,16                      | Nationwide Building Society                |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | Verisure Holding AB                              |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 20/06/2027 (e)(g)             | £ 1 900                             | 2 208                            | 0,37                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 02/01/2032 (a)                      | 1 100                               | 1 109                            | 0,19                      | NatWest Group PLC                          |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | Volvo Car AB                                     |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 31/03/2028 (e)(g)             | 1 300                               | 1 473                            | 0,25                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 10/06/2029                          | 400                                 | 403                              | 0,07                      | 5,125 % éch. 12/05/2027 (e)(g)             | 1 100                               | 1 273                            | 0,21                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | Total Suède                                      |                                     |                                  |                           | NatWest Markets PLC                        |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 04/11/2027                    | € 500                               | 499                              | 0,08                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | <b>TURQUIE</b>                                   |                                     |                                  |                           | Neo Next Energy Consolidated Holdings Ltd. |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>             |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 11/06/2031                    | \$ 2 400                            | 2 068                            | 0,35                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S       |                                     |                                  |                           | Ocado Group PLC                            |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 29/06/2028                          | \$ 1 800                            | 1 472                            | 0,25                      | 10,500 % éch. 08/08/2029                   | £ 1 300                             | 1 567                            | 0,26                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | <b>ROYAUME-UNI</b>                               |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 15/06/2030                   | 600                                 | 736                              | 0,12                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES</b>       |                                     |                                  |                           | OEG Finance PLC                            |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | Ocado Group PLC                                  |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 27/09/2029                    | € 1 900                             | 1 973                            | 0,33                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 06/08/2029                          | £ 1 300                             | 1 439                            | 0,24                      | Pinnacle Bidco PLC                         |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>             |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 11/10/2028                    | 2 100                               | 2 176                            | 0,37                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | Alexandrite Monnet UK Holdco PLC                 |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 11/10/2028                   | £ 1 100                             | 1 327                            | 0,22                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 31/05/2031                          | € 2 700                             | 2 726                            | 0,46                      | SW Finance PLC                             |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/02/2031                          | 2 400                               | 2 367                            | 0,40                      | 6,875 % éch. 07/08/2032                    | 200                                 | 234                              | 0,04                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/08/2031                          | 1 400                               | 1 398                            | 0,23                      | 7,750 % éch. 31/10/2031                    | 1 100                               | 1 326                            | 0,22                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | Allwyn Entertainment Financing UK PLC            |                                     |                                  |                           | Virgin Media Finance PLC                   |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           | Anglian Water Osprey Financing PLC               |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/07/2030                    | € 300                               | 244                              | 0,04                      |
|                                            |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 31/07/2028                          | £ 2 300                             | 2 474                            | 0,41                      | 5,000 % éch. 15/07/2030                    | \$ 3 100                            | 2 065                            | 0,35                      |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Virgin Media Secured Finance PLC           |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/01/2030                    | £ 5 700                             | 5 842                            | 0,98                      |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Vmed O2 UK Financing PLC                   |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 31/01/2029                    | 1 800                               | 1 978                            | 0,33                      |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 31/01/2031                    | \$ 800                              | 576                              | 0,10                      |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/04/2032                    | € 1 650                             | 1 454                            | 0,24                      |

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

| DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Vodafone Group PLC<br>3,000 % éch. 27/08/2080<br>8,000 % éch. 30/08/2086                        | € 1 200<br>£ 2 500                  | € 1 159<br>3 144                 | 0,19<br>0,53              | Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>5,625 % éch. 29/09/2028<br>OAK-Eagle Acquireco, Inc.<br>6,250 % éch. 01/07/2033 | \$ 1 888<br>€ 1 400                 | € 1 649<br>1 469                 | 0,28<br>0,25              | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b><br><b>BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS</b><br>2,061 % éch.<br>29/07/2026 (c)(d)                                                 | € 300                               | € 299                            | 0,05                      |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | Olympus Water U.S. Holding Corp.<br>3,875 % éch. 01/10/2028<br>6,125 % éch. 15/02/2033                             | 1 600<br>1 700                      | 1 596<br>1 712                   | 0,27<br>0,29              | 2,069 % éch.<br>26/08/2026 (c)(d)<br>2,174 % éch.<br>08/07/2026 (c)(d)                                                                                  | 900                                 | 897                              | 0,15                      |
| INEOS Quattro Holdings U.K. Ltd.<br>7,994 % éch. 02/04/2029                                     | \$ 1 985                            | 1 536                            | 0,26                      | Primo Water Holdings, Inc.<br>3,875 % éch. 31/10/2028<br>RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045 | 400<br>\$ 2 400                     | 400<br>2 093                     | 0,07<br>0,35              | 2,246 % éch.<br>05/08/2026 (c)(d)<br>2,259 % éch.<br>05/08/2026 (c)(d)                                                                                  | 500<br>400                          | 500<br>399                       | 0,08<br>0,07              |
| <b>TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | Rio Oil Finance Trust<br>8,200 % éch. 06/04/2028<br>SCIL LLC<br>9,500 % éch. 15/07/2028                            | 670<br>€ 1 900                      | 601<br>1 965                     | 0,10<br>0,33              | 2,288 % éch.<br>22/07/2026 (c)(d)<br>2,388 % éch.<br>16/09/2026 (c)(d)                                                                                  | 1 600                               | 1 598                            | 0,27                      |
| Tower Bridge Funding PLC<br>4,538 % éch. 20/12/2066                                             | £ 580                               | 674                              | 0,11                      | Silgan Holdings, Inc.<br>2,250 % éch. 01/06/2028<br>Sword Purchaser LLC<br>7,250 % éch. 15/04/2033                 | 200<br>1 500                        | 196<br>1 573                     | 0,03<br>0,26              | 2,414 % éch.<br>30/09/2026 (c)(d)<br>Total des Instruments à court terme                                                                                | 400                                 | 398                              | 0,07                      |
| Total Royaume-Uni                                                                               |                                     | 99 512                           | 16,67                     | UGI International LLC<br>2,500 % éch. 01/12/2029<br>5,000 % éch. 01/06/2031                                        | 1 900<br>1 500                      | 1 802<br>1 535                   | 0,30<br>0,26              | 6 000<br>5 971<br>10 661                                                                                                                                | 5 971<br>1,79                       |                                  |                           |
| <b>ÉTATS-UNIS</b>                                                                               |                                     |                                  |                           | VF Corp.<br>0,250 % éch. 25/02/2028<br>4,250 % éch. 07/03/2029                                                     | 2 100<br>1 200                      | 1 989<br>1 209                   | 0,33<br>0,20              | <b>TOTAL DES VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                                                                                     | € 561 940                           | 94,15                            |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                            |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                                                             |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| American Airlines Pass-Through Trust<br>3,375 % éch. 01/11/2028                                 | \$ 696                              | 602                              | 0,10                      | INEOS U.S. Finance LLC<br>6,644 % éch. 07/02/2031<br>6,894 % éch. 18/02/2030                                       | \$ 4 281<br>843                     | 3 336<br>681                     | 0,56<br>0,12              | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b><br><b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b><br>PIMCO Select Funds plc - PIMCO<br>Euro Short-Term Floating<br>NAV Fund (f) | 1 767 764                           | 17 678                           | 2,96                      |
| Bond U.S. Bidco, Inc.<br>6,500 % éch. 15/06/2033                                                | € 1 300                             | 1 310                            | 0,22                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                                             |                                     |                                  |                           | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b><br>PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>Euro Short-Term High<br>Yield Corporate Bond<br>UCITS ETF (f)                              | 674 500                             | 8 415                            | 1,41                      |
| Burford Capital Global Finance LLC<br>9,250 % éch. 01/07/2031                                   | \$ 300                              | 256                              | 0,04                      | Obligations du Trésor américain<br>4,875 % éch. 15/08/2045                                                         | 166                                 | 144                              | 0,02                      | PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>Euro Short Maturity UCITS<br>ETF (f)                                                                                          | 64 018                              | 6 806                            | 1,14                      |
| Canpack Group, Inc.<br>4,875 % éch. 15/01/2032                                                  | € 700                               | 715                              | 0,12                      | Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035                                                             | 250                                 | 216                              | 0,04                      | Total des Fonds d'investissement                                                                                                                        | € 32 899                            | 5,51                             |                           |
| Celanese U.S. Holdings LLC<br>0,625 % éch. 10/09/2028<br>5,000 % éch. 15/04/2031                | 400<br>2 000                        | 376<br>2 001                     | 0,06<br>0,34              | Total États-Unis                                                                                                   |                                     | 360<br>41 460                    | 0,06<br>6,95              |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| CoreWeave, Inc.<br>8,500 % éch. 15/07/2032<br>9,625 % éch. 15/07/2032                           | 2 800<br>\$ 100                     | 2 762<br>86                      | 0,46<br>0,01              |                                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Coty, Inc.<br>4,500 % éch. 15/05/2027                                                           | € 600                               | 603                              | 0,10                      |                                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Encore Capital Group, Inc.<br>4,250 % éch. 01/06/2028<br>5,440 % éch. 15/07/2033                | £ 500<br>€ 2 400                    | 567<br>2 434                     | 0,09<br>0,41              |                                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| LSF12 Pillar Investments US, Inc.<br>5,750 % éch. 15/05/2033                                    | 2 800                               | 2 787                            | 0,47                      |                                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| MKS, Inc.<br>4,250 % éch. 15/02/2034                                                            | 1 400                               | 1 386                            | 0,23                      |                                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| MPT Operating Partnership LP<br>7,000 % éch. 15/02/2032                                         | 1 400                               | 1 409                            | 0,24                      |                                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                           | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre | Long  | 09/2026              | 112                   | € 37                                    | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                 | Long  | 09/2026              | 318                   | 179                                     | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre             | Court | 09/2026              | 11                    | (23)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre             | Long  | 09/2026              | 2                     | 5                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                               | Long  | 09/2026              | 666                   | 53                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre        | Long  | 09/2026              | 7                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026              | 1                     | 1                                       | 0,00                   |
| CContrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre  | Court | 09/2026              | 9                     | (22)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre    | Long  | 09/2026              | 5                     | 10                                      | 0,00                   |
|                                                                                       |       |                      |                       | € 240                                   | 0,04                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé            |       |                      |                       | € 240                                   | 0,04                   |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence  | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Worldline S.A.       | 5,000 %                 | 20/12/2030         | € 2 550                             | € (39)                                  | (0,01)                 |
| ZF Europe Finance BV | 5,000                   | 20/12/2029         | 1 500                               | 28                                      | 0,01                   |
| ZF Europe Finance BV | 5,000                   | 20/12/2030         | 100                                 | 1                                       | 0,00                   |
|                      |                         |                    |                                     | € (10)                                  | 0,00                   |



SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                          | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans | 5,000 %                 | 20/06/2031         | € 38 500                            | € 1 277                                 | 0,21                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir            | Indice de taux variable        | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------|--------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %      | 18/03/2028         | £ 6 500              | € 8                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 16/09/2028         | 7 280                | 19                                      | 0,00                   |
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 18/03/2031         | 7 080                | 39                                      | 0,01                   |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500        | 18/03/2056         | 360                  | 16                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,000        | 19/03/2027         | \$ 9 800             | (111)                                   | (0,02)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,000        | 19/03/2028         | 3 300                | (35)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250        | 19/03/2035         | 1 200                | (17)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500        | 17/12/2027         | 8 000                | 105                                     | 0,02                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750        | 17/12/2030         | 6 700                | 144                                     | 0,03                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750        | 17/12/2035         | 1 800                | 41                                      | 0,01                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,250        | 16/09/2028         | € 28 000             | (253)                                   | (0,04)                 |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,350        | 29/04/2030         | 800                  | 12                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,400        | 09/04/2030         | 1 000                | 13                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,450        | 05/05/2035         | 600                  | 22                                      | 0,01                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,460        | 13/03/2035         | 600                  | (16)                                    | 0,00                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,460        | 01/04/2035         | 600                  | (18)                                    | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,500        | 16/09/2031         | 1 400                | 15                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,510        | 09/04/2035         | 600                  | 19                                      | 0,00                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,520        | 27/03/2035         | 600                  | (15)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,520        | 09/04/2035         | 600                  | 18                                      | 0,00                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,547        | 09/03/2033         | 1 500                | 12                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,550        | 16/04/2035         | 600                  | 17                                      | 0,00                   |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,610        | 24/03/2035         | 600                  | (10)                                    | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois           | 2,750        | 16/09/2036         | 3 630                | (44)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois           | 3,000        | 16/09/2056         | 180                  | 0                                       | 0,00                   |
|                                                    |                                |              |                    |                      | € (19)                                  | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                |              |                    |                      | € 1 248                                 | 0,21                   |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

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

| Contrepartie | Entité de référence   | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|-----------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| GST          | Albion Financing SARL | 5,000 %                 | 20/06/2031         | € 3 200                             | € 249                     | € 150                                   | € 399           | 0,07                   |
|              | Eutelsat S.A.         | 5,000                   | 20/12/2029         | 800                                 | (69)                      | 173                                     | 104             | 0,02                   |
|              | INEOS Finance PLC     | 5,000                   | 20/06/2030         | 600                                 | 12                        | (32)                                    | (20)            | (0,01)                 |
|              |                       |                         |                    |                                     | € 192                     | € 291                                   | € 483           | 0,08                   |

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

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

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

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 664           | \$ 774            | € 12               | € 0                   | € 12                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 4 220         | € 4 875           | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 183        | € 1 888           | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 3 059           | 2 631             | 0                  | (44)                  | (44)                                    | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | € 4 985         | \$ 5 776          | 67                 | 0                     | 67                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 2 329         | € 2 699           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 420          | 360               | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | € 28 502        | £ 24 601          | 58                 | 0                     | 58                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 1 242           | \$ 1 410          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1 586         | € 1 834           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 559        | 1 338             | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 24 635        | 28 502            | 0                  | (58)                  | (58)                                    | (0,01)              |
| SCX          | 07/2026           | \$ 216          | 185               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 31 748        | £ 27 388          | 47                 | 0                     | 47                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 52 525       | \$ 59 747         | 0                  | (267)                 | (267)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | £ 48 729        | € 56 179          | 0                  | (391)                 | (391)                                   | (0,07)              |
|              | 07/2026           | \$ 61 842       | 53 013            | 0                  | (1 079)               | (1 079)                                 | (0,18)              |
|              | 08/2026           | £ 27 426        | 31 748            | 0                  | (47)                  | (47)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 59 828       | 52 525            | 266                | 0                     | 266                                     | 0,04                |
|              |                   |                 |                   | € 450              | € (1 987)             | € (1 537)                               | (0,26)              |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en USD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 684           | \$ 798            | € 14               | € 0                   | € 14                                    | 0,01                |
| BPS          | 07/2026           | 141             | 165               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | \$ 1 970        | € 1 734           | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 734         | \$ 1 972          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 433             | 496               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | 717             | 833               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14           | € 12              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | € 717           | \$ 833            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10           | € 9               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 1 535         | \$ 1 790          | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 1 973         | € 1 734           | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 734         | \$ 1 975          | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 746             | 867               | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 483           | 1 693             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | € 106              | € (25)                | € 81                                    | 0,02                |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ (973) (0,16)

#### DESCRIPTION

#### AUTRES ACTIFS FINANCIERS

| DESCRIPTION                            | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| Credit Suisse AG AT1 Claim             | \$ 800                        | € 247                      | 0,04                |
| Total des Autres actifs financiers     |                               | € 247                      | 0,04                |
| Total des Investissements              |                               | € 595 601                  | 99,79               |
| Autres actifs et passifs à court terme |                               | € 1 275                    | 0,21                |
| Actif net                              |                               | € 596 876                  | 100,00              |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- <sup>A</sup> Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 1,63 %) :



| Description de l'émetteur     | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat            | Coût    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------|---------|-----------------|-------------------------|---------|--------------|---------------------|
| Grifols S.A.                  | 7,500 % | 01/05/2030      | 01/08/2025              | € 2 807 | € 2 823      | 0,47                |
| Mahle GmbH                    | 7,125   | 15/07/2032      | 30/06/2025 - 10/06/2026 | 4 117   | 4 221        | 0,71                |
| Miller Homes Group Finco PLC  | 6,533   | 15/10/2030      | 02/04/2025              | 1 900   | 1 903        | 0,32                |
| Nidda Healthcare Holding GmbH | 7,000   | 21/02/2030      | 20/03/2026              | 511     | 517          | 0,09                |
|                               |         |                 |                         | € 9 335 | € 9 464      | 1,59                |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 12 317 € (31 décembre 2025 : 16 484 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2025 : 25 €) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 7 067 € (31 décembre 2025 : 7 476 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 560 € (31 décembre 2025 : 330 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

#### Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 559 514                                            | € 2 426                                           | € 561 940        |
| Fonds d'investissement                        | 32 899                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 32 899           |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 261                                                                               | 254                                                  | 0                                                 | 515              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 247                                                  | 0                                                 | 247              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 33 160</b>                                                                   | <b>€ 560 015</b>                                     | <b>€ 2 426</b>                                    | <b>€ 595 601</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | € 0                                                                               | € 490 675                                            | € 2 686                                           | € 493 361        |
| Fonds d'investissement                        | 686                                                                               | 22 588                                               | 0                                                 | 23 274           |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 7 200                                                | 0                                                 | 7 200            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (266)                                                                             | 138                                                  | 0                                                 | (128)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 201                                                  | 0                                                 | 201              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€ 420</b>                                                                      | <b>€ 520 802</b>                                     | <b>€ 2 686</b>                                    | <b>€ 523 908</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | (0,250) %      | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (352)          | € (352)                                  | (0,06)              |
|                                               | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 315)          | (2 317)                                  | (0,39)              |
| MYI                                           | (0,600)        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (425)            | (425)                                    | (0,07)              |
|                                               | 1,450          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 410)          | (3 412)                                  | (0,57)              |
|                                               | 1,550          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 600)          | (2 602)                                  | (0,44)              |
|                                               | 1,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 521)          | (2 523)                                  | (0,42)              |
|                                               | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (681)            | (681)                                    | (0,11)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>€ (12 312)</b>                        | <b>(2,06)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | € 14                                                       | € 0                     | € 14                              | € (8)                                                      | € 0                     | € (8)                             |
| BPS          | (30)                                                       | 0                       | (30)                              | (439)                                                      | 330                     | (109)                             |
| CBK          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| GST          | 483                                                        | (290)                   | 193                               | 49                                                         | 0                       | 49                                |
| JPM          | (44)                                                       | 0                       | (44)                              | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |
| MBC          | 55                                                         | 0                       | 55                                | 6                                                          | 0                       | 6                                 |

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

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| MYI          | € (40)                                                     | € 0                     | € (40)                            | € 4                                                        | € 0                     | € 4                               |
| RYL          | 12                                                         | 0                       | 12                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 9                                                          | 0                       | 9                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SOG          | (1 441)                                                    | 1 560                   | 119                               | 529                                                        | (640)                   | (111)                             |
| SSB          | 9                                                          | 0                       | 9                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |

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

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 84,67            | 84,16                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 5,38             | 5,57                 |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,30             | S/O                  |
| Fonds d'investissement                                           | 5,29             | 4,23                 |
| Contrats de mise en pension                                      | S/O              | 1,31                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,05             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,29             | 0,12                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,17             | 0,12                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,04             | 0,04                 |
| Autres actifs                                                    | 3,81             | 4,44                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Autriche                                                                                                 | 1,68             | 1,15                 |
| Belgique                                                                                                 | 0,82             | 0,99                 |
| Bermudes                                                                                                 | 0,31             | 0,05                 |
| Îles Caïmans                                                                                             | 0,84             | 0,24                 |
| Chine                                                                                                    | 0,00             | S/O                  |
| Chypre                                                                                                   | 0,23             | 0,26                 |
| République tchèque                                                                                       | 0,70             | 0,80                 |
| Danemark                                                                                                 | 1,41             | 1,12                 |
| Finlande                                                                                                 | 0,53             | 0,67                 |
| France                                                                                                   | 11,87            | 11,99                |
| Allemagne                                                                                                | 10,43            | 10,40                |
| Gibraltar                                                                                                | 0,10             | S/O                  |
| Grèce                                                                                                    | 0,68             | 0,29                 |
| Guernesey, Îles Anglo-Normandes                                                                          | 0,10             | 0,11                 |
| Hong Kong                                                                                                | 0,18             | S/O                  |
| Irlande                                                                                                  | 0,84             | 1,86                 |
| Île de Man                                                                                               | 0,43             | 0,58                 |
| Israël                                                                                                   | 0,48             | 0,53                 |
| Italie                                                                                                   | 5,49             | 3,35                 |
| Japon                                                                                                    | 2,98             | 1,76                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                             | 0,35             | 0,71                 |
| Lituanie                                                                                                 | 0,27             | S/O                  |
| Luxembourg                                                                                               | 7,35             | 8,91                 |
| Îles Marshall                                                                                            | 0,20             | 0,22                 |
| Multinationales                                                                                          | 0,55             | 0,34                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 10,96            | 9,86                 |
| Norvège                                                                                                  | 0,63             | 0,64                 |
| Panama                                                                                                   | S/O              | 0,10                 |
| Pologne                                                                                                  | 0,34             | 0,45                 |
| Portugal                                                                                                 | 0,32             | S/O                  |
| Slovénie                                                                                                 | 0,06             | 0,07                 |
| Espagne                                                                                                  | 3,71             | 2,83                 |
| Suède                                                                                                    | 3,65             | 3,11                 |
| Suisse                                                                                                   | S/O              | 0,04                 |
| Turquie                                                                                                  | 0,25             | 0,37                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 16,67            | 16,85                |
| États-Unis                                                                                               | 6,95             | 4,92                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 1,79             | 8,49                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 5,51             | 4,44                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | S/O              | 1,37                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,04             | (0,05)               |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Centrally Cleared Financial Derivative Instruments                                                       |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,02                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,21             | 0,04                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,00             | (0,06)               |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,08             | 0,01                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,26)           | 0,02                 |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | 0,02             | S/O                  |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,04             | 0,04                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 0,21             | 0,11                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## 510 PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |         |       |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------|-------|
| VALEURS MOBILIÈRES                          |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |       |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS               |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |       |
| BANQUE ET FINANCE                           |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |       |
| Ageas S.A.                                  |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniformes (UMBS), TBA                           |                                     |                                  |                           |         |       |
| 3,250 % éch. 02/07/2049                     | €                                   | 900                              | €                         | 894         | 0,07                                |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/08/2056                                                                   | \$                                  | 11 800                           | €                         | 8 996   | 0,73  |
| Aircastle Ltd.                              |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/07/2056                                                                   |                                     | 36 100                           |                           | 29 515  | 2,40  |
| 5,000 % éch. 15/09/2030                     | \$                                  | 900                              |                           | 784         | 0,06                                |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                                                 |                                     |                                  |                           |         |       |
| AMCO - Asset Management Co. SpA             |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                                                |                                     | 80 200                           |                           | 67 171  | 5,46  |
| 4,625 % éch. 06/02/2027                     | €                                   | 6 600                            |                           | 6 666       | 0,54                                |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                   |                                     | 36 400                           |                           | 31 288  | 2,55  |
| American Express Co.                        |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           | 171 303 | 13,94 |
| 3,433 % éch. 20/05/2032                     |                                     | 2 100                            |                           | 2 104       | 0,17                                |                                  |                           | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                           |                                     |                                  |                           |         |       |
| American Tower Corp.                        |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)                                |                                     |                                  |                           |         |       |
| 2,100 % éch. 15/06/2030                     | \$                                  | 4 600                            |                           | 3 638       | 0,30                                |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/07/2031                                                                   |                                     | 6 211                            |                           | 4 989   | 0,41  |
| ASR Nederland NV                            |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 0,375 % éch. 15/07/2027                                                                   |                                     | 18 101                           |                           | 15 569  | 1,27  |
| 4,625 % éch. 19/10/2027 (e)(g)              | €                                   | 500                              |                           | 504         | 0,04                                |                                  |                           | 0,500 % éch. 15/01/2028                                                                   |                                     | 6 479                            |                           | 5 523   | 0,45  |
| Banco Santander S.A.                        |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch. 15/10/2030                                                                   |                                     | 15 542                           |                           | 13 203  | 1,07  |
| 5,565 % éch. 17/01/2030                     | \$                                  | 1 800                            |                           | 1 614       | 0,13                                |                                  |                           | 0,1375 % éch. 15/07/2033                                                                  |                                     | 15 676                           |                           | 13 356  | 1,07  |
| Bank of America Corp.                       |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 15/02/2053                                                                   |                                     | 9 520                            |                           | 6 333   | 0,51  |
| 2,572 % éch. 20/10/2032                     |                                     | 1 800                            |                           | 1 402       | 0,11                                |                                  |                           | 1,625 % éch. 15/10/2027                                                                   |                                     | 21 803                           |                           | 18 982  | 1,54  |
| Barclays PLC                                |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 1,625 % éch. 15/10/2029                                                                   |                                     | 16 823                           |                           | 14 616  | 1,19  |
| 5,851 % éch. 21/03/2035                     | £                                   | 4 000                            |                           | 4 692       | 0,38                                |                                  |                           | 2,375 % éch. 15/10/2028                                                                   |                                     | 1 413                            |                           | 1 250   | 0,10  |
| BNP Paribas S.A.                            |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           | 93 621  | 7,61  |
| 4,750 % éch. 13/11/2032                     | €                                   | 3 000                            |                           | 3 170       | 0,26                                |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |         |       |
| Canadian Imperial Bank of Commerce          |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Alba PLC                                                                                  |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,495 % éch. 20/12/2027                     | AUD                                 | 3 900                            |                           | 2 350       | 0,19                                |                                  |                           | 4,036 % éch. 15/12/2038                                                                   | £                                   | 381                              |                           | 436     | 0,04  |
| 5,009 % éch. 24/07/2028                     |                                     | 6 500                            |                           | 3 955       | 0,32                                |                                  |                           | Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                         |                                     |                                  |                           |         |       |
| Cooperative Rabobank UA                     |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,596 % éch. 18/12/2066                                                                   |                                     | 7 993                            |                           | 9 284   | 0,75  |
| 3,100 % éch. 29/06/2028 (e)(g)              | €                                   | 2 400                            |                           | 2 353       | 0,19                                |                                  |                           | Atlas Funding PLC                                                                         |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,875 % éch. 29/06/2029 (e)(g)              |                                     | 1 000                            |                           | 1 018       | 0,08                                |                                  |                           | 4,524 % éch. 20/07/2067                                                                   |                                     | 2 277                            |                           | 2 643   | 0,21  |
| DLR Kredit A/S                              |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,886 % éch. 20/01/2061                                                                   |                                     | 776                              |                           | 901     | 0,07  |
| 1,000 % éch. 01/01/2027                     | DKK                                 | 2 600                            |                           | 346         | 0,03                                |                                  |                           | Bletchley Park Funding PLC                                                                |                                     |                                  |                           |         |       |
| ELM BV for Swiss Prime Site AG              |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,504 % éch. 27/01/2070                                                                   |                                     | 4 209                            |                           | 4 885   | 0,40  |
| 3,125 % éch. 01/10/2031                     | €                                   | 1 300                            |                           | 1 273       | 0,10                                |                                  |                           | Bowbell Master Issuer PLC                                                                 |                                     |                                  |                           |         |       |
| Emirates NBD Bank PJSC                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,247 % éch. 23/07/2071                                                                   |                                     | 3 738                            |                           | 4 337   | 0,35  |
| 3,236 % éch. 13/02/2031                     |                                     | 3 100                            |                           | 3 041       | 0,25                                |                                  |                           | Canada Square Funding PLC                                                                 |                                     |                                  |                           |         |       |
| Fédération des Caisses Desjardins du Québec |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 5,409 % éch. 17/06/2058                                                                   |                                     | 110                              |                           | 128     | 0,01  |
| 4,347 % éch. 02/12/2030                     | £                                   | 5 300                            |                           | 6 165       | 0,50                                |                                  |                           | Domi BV                                                                                   |                                     |                                  |                           |         |       |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                   |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 2,892 % éch. 15/02/2057                                                                   | €                                   | 6 152                            |                           | 6 149   | 0,50  |
| 3,120 % éch. 20/02/2031                     | €                                   | 5 800                            |                           | 5 676       | 0,46                                |                                  |                           | Dutch Property Finance BV                                                                 |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                     | \$                                  | 3 900                            |                           | 3 416       | 0,28                                |                                  |                           | 2,913 % éch. 28/10/2059                                                                   |                                     | 2 892                            |                           | 2 894   | 0,24  |
| Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Economic Master Issuer PLC                                                                |                                     |                                  |                           |         |       |
| 3,509 % éch. 17/08/2033                     | €                                   | 3 900                            |                           | 3 876       | 0,32                                |                                  |                           | 4,205 % éch. 25/04/2075                                                                   | £                                   | 4 321                            |                           | 5 010   | 0,41  |
| 6,561 % éch. 24/10/2034                     | \$                                  | 1 400                            |                           | 1 325       | 0,11                                |                                  |                           | Harbour PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |         |       |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.         |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                   |                                     | 2 393                            |                           | 2 787   | 0,23  |
| 3,875 % éch. 29/04/2033                     | €                                   | 3 800                            |                           | 3 805       | 0,31                                |                                  |                           | Harmony French Home Loans                                                                 |                                     |                                  |                           |         |       |
| HSBC Holdings PLC                           |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 2,854 % éch. 27/05/2062                                                                   | €                                   | 1 267                            |                           | 1 268   | 0,10  |
| 4,750 % éch. 04/07/2029 (e)(g)              |                                     | 1 600                            |                           | 1 617       | 0,13                                |                                  |                           | Holmes Master Issuer PLC                                                                  |                                     |                                  |                           |         |       |
| Intesa Sanpaolo SpA                         |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,247 % éch. 15/10/2072                                                                   | £                                   | 4 400                            |                           | 5 105   | 0,42  |
| 7,778 % éch. 20/06/2054                     | \$                                  | 400                              |                           | 412         | 0,03                                |                                  |                           | 4,277 % éch. 15/10/2072                                                                   |                                     | 2 400                            |                           | 2 786   | 0,23  |
| JAB Holdings BV                             |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Hops Hill PLC                                                                             |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,375 % éch. 25/04/2034                     | €                                   | 3 500                            |                           | 3 615       | 0,30                                |                                  |                           | 4,464 % éch. 21/06/2056                                                                   |                                     | 2 376                            |                           | 2 752   | 0,22  |
| Jyske Realkredit A/S                        |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,614 % éch. 21/04/2056                                                                   |                                     | 293                              |                           | 341     | 0,03  |
| 0,500 % éch. 01/10/2040                     | DKK                                 | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 5,034 % éch. 27/11/2054                                                                   |                                     | 1 647                            |                           | 1 914   | 0,16  |
| 1,000 % éch. 01/01/2027                     |                                     | 26 932                           |                           | 3 581       | 0,29                                |                                  |                           | Kinbane DAC                                                                               |                                     |                                  |                           |         |       |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 3,378 % éch. 24/08/2075                                                                   | €                                   | 5 057                            |                           | 5 066   | 0,41  |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | Laanak Master Issuer PLC                                                                  |                                     |                                  |                           |         |       |
| 1,500 % éch. 01/07/2050                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 4,247 % éch. 22/12/2069                                                                   | £                                   | 653                              |                           | 758     | 0,06  |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | Landmark Mortgage Securities PLC                                                          |                                     |                                  |                           |         |       |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 4,146 % éch. 17/04/2044                                                                   |                                     | 336                              |                           | 384     | 0,03  |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                     |                                     | 36 859                           |                           | 3 801       | 0,31                                |                                  |                           | Lanebrook Mortgage Transaction PLC                                                        |                                     |                                  |                           |         |       |
| Maybank Singapore Ltd.                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,397 % éch. 20/07/2058                                                                   |                                     | 659                              |                           | 765     | 0,06  |
| 2,504 % éch. 02/10/2028                     | €                                   | 2 900                            |                           | 2 875       | 0,23                                |                                  |                           | Mortimer PLC                                                                              |                                     |                                  |                           |         |       |
| Morgan Stanley                              |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,556 % éch. 22/09/2070                                                                   |                                     | 5 201                            |                           | 6 039   | 0,49  |
| 3,521 % éch. 22/05/2031                     |                                     | 5 500                            |                           | 5 525       | 0,45                                |                                  |                           | Olympia Master Home Loans FCT                                                             |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,656 % éch. 02/03/2029                     |                                     | 3 900                            |                           | 3 999       | 0,33                                |                                  |                           | 2,750 % éch. 31/10/2059                                                                   | €                                   | 5 400                            |                           | 5 408   | 0,44  |
| NatWest Group PLC                           |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Permanent Master Issuer PLC                                                               |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,500 % éch. 31/03/2028 (e)(g)              | £                                   | 200                              |                           | 227         | 0,02                                |                                  |                           | 4,247 % éch. 15/07/2073                                                                   | £                                   | 3 100                            |                           | 3 599   | 0,29  |
| Nordea Kredit Realkreditatieselskab         |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Polaris PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |         |       |
| 0,500 % éch. 01/10/2040                     | DKK                                 | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 4,505 % éch. 25/08/2068                                                                   |                                     | 4 045                            |                           | 4 692   | 0,38  |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | Project Cashmere                                                                          |                                     |                                  |                           |         |       |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 4,543 % éch. 30/12/2057 (a)                                                               | AUD                                 | 19 900                           |                           | 12 019  | 0,98  |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | Resloc UK PLC                                                                             |                                     |                                  |                           |         |       |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 4,026 % éch. 15/12/2043                                                                   | £                                   | 1 293                            |                           | 1 480   | 0,12  |
| 2,000 % éch. 01/10/2053                     |                                     | 61 785                           |                           | 6 403       | 0,52                                |                                  |                           | Silverstone Master Issuer PLC                                                             |                                     |                                  |                           |         |       |
| 4,000 % éch. 01/10/2056                     |                                     | 0                                |                           | 0           | 0,00                                |                                  |                           | 4,197 % éch. 21/01/2079                                                                   |                                     | 2 500                            |                           | 2 900   | 0,24  |
|                                             |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | Together Asset-Backed Securitisation PLC                                                  |                                     |                                  |                           |         |       |
|                                             |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,495 % éch. 15/08/2066                                                                   |                                     | 3 994                            |                           | 4 633   | 0,38  |

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |  |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--|
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>4,584 % éch. 20/04/2051 | £ 1 599                             | € 1 857                          | 0,15                      | 2,815 % éch. 21/04/2031 | € 2 599                             | € 2 601                          | 0,21                      | Penta CLO DAC<br>3,015 % éch. 25/07/2036                                                | € 900                               | € 901                            | 0,07                      |  |
| Tower Bridge Funding PLC<br>4,497 % éch. 20/01/2073        | 4 459                               | 5 172                            | 0,42                      |                         |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC<br>3,513 % éch. 15/11/2039                                             | 1 700                               | 1 702                            | 0,14                      |  |
| White Rose Master Issuer PLC<br>4,215 % éch. 16/07/2071    | 4 277                               | 4 964                            | 0,40                      |                         |                                     |                                  |                           | Rockford Tower Europe CLO DAC<br>3,489 % éch. 29/08/2036                                | 1 500                               | 1 502                            | 0,12                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | SC Germany S.A., Compartiment Consumer<br>2,759 % éch. 15/12/2038                       | 482                                 | 483                              | 0,04                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Securor Finance DAC<br>3,116 % éch. 20/09/2036                                          | 5 500                               | 5 526                            | 0,45                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Sound Point Euro CLO Funding DAC<br>3,181 % éch. 24/10/2034                             | 3 400                               | 3 404                            | 0,28                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Tikehau CLO DAC<br>3,404 % éch. 15/10/2038                                              | 900                                 | 901                              | 0,07                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Toro European CLO DAC<br>3,070 % éch. 12/01/2032                                        | 620                                 | 621                              | 0,05                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,093 % éch. 15/02/2034                                                                 | 727                                 | 728                              | 0,06                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     | 114 694                          | 9,33                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |                                                                                         |                                     | 249 602                          | 20,31                     |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Adif Alta Velocidad<br>3,625 % éch. 30/04/2035                                          | 2 500                               | 2 525                            | 0,21                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Agence France Locale<br>7,000 % éch.<br>17/06/2031 (e)(g)                               | 2 400                               | 2 714                            | 0,22                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement australien<br>1,500 % éch. 21/06/2031         | AUD 57 000                          | 30 118                           | 2,45                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>4,375 % éch. 01/10/2030                                | \$ 3 600                            | 3 106                            | 0,25                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 30/04/2029                                                                 | 800                                 | 723                              | 0,06                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>6,125 % éch. 21/01/2031          | 300                                 | 265                              | 0,02                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 26/11/2038                                                                 | € 1 700                             | 1 790                            | 0,15                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035 (h)                                         | 44 500                              | 45 141                           | 3,67                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement français<br>0,100 % éch.<br>25/07/2031 (d)(h) | 41 854                              | 39 940                           | 3,25                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,100 % éch. 15/08/2031 (d)                        | 64 801                              | 64 752                           | 5,27                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 15/03/2029 (h)                                                             | 36 100                              | 35 758                           | 2,91                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,550 % éch. 15/05/2056 (d)                                                             | 5 963                               | 6 169                            | 0,50                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,850 % éch. 01/02/2031                                                                 | 27 400                              | 27 250                           | 2,22                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,950 % éch. 01/07/2030                                                                 | 9 900                               | 9 916                            | 0,81                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,087 % éch. 15/04/2029                                                                 | 51 900                              | 52 612                           | 4,28                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/11/2031                                                                 | 900                                 | 904                              | 0,07                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,237 % éch. 15/10/2028                                                                 | 4 500                               | 4 572                            | 0,37                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,450 % éch. 15/07/2031 (h)                                                             | 25 000                              | 25 503                           | 2,07                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/02/2031 (h)                                                             | 42 300                              | 43 246                           | 3,52                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,587 % éch. 15/10/2031                                                                 | 33 500                              | 34 694                           | 2,82                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 15/06/2030                                                                 | 9 800                               | 10 089                           | 0,82                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/11/2030                                                                 | 200                                 | 209                              | 0,02                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais<br>1,800 % éch. 20/03/2054           | ¥ 112 000                           | 387                              | 0,03                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 20/06/2054                                                                 | 131 000                             | 499                              | 0,04                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 20/12/2054                                                                 | 131 000                             | 510                              | 0,04                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2055                                                                 | 265 800                             | 1 060                            | 0,09                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch. 20/09/2055                                                                 | 488 700                             | 2 309                            | 0,19                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch. 20/12/2055                                                                 | 840 000                             | 4 126                            | 0,34                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>3,500 % éch. 12/02/2034           | \$ 5 200                            | 3 884                            | 0,32                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | New South Wales Treasury Corp.<br>1,750 % éch. 20/03/2034                               | AUD 6 100                           | 2 915                            | 0,24                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 08/03/2033                                                                 | 8 800                               | 4 443                            | 0,36                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 20/09/2035                                                                 | 3 300                               | 1 929                            | 0,16                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation New Zealand Local Government Funding Agency<br>3,750 % éch. 30/09/2030       | \$ 2 800                            | 2 404                            | 0,20                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais<br>5,125 % éch. 18/09/2034           | 1 100                               | 968                              | 0,08                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Queensland Treasury Corp.<br>2,000 % éch. 22/08/2033                                    | AUD 2 600                           | 1 292                            | 0,10                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain<br>3,750 % éch. 07/02/2034 (h)        | € 4 200                             | 3 801                            | 0,31                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 22/02/2036                                                                 | 2 800                               | 2 823                            | 0,23                      |  |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/05/2037 (h)                                                             | 1 100                               | 1 086                            | 0,09                      |  |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                      | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| 5,875 % éch. 11/07/2032                            | € 5 400                             | € 5 663                          | 0,46                      | Bon du Trésor britannique           | £ 34 200                            | € 39 069                         | 3,18                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>    |         |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/10/2031             |                                     |                                  |                           | <b>FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE</b>  |         |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 12/01/2029                            | \$ 14 600                           | 12 588                           | 1,02                      | 4,125 % éch.                        |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc -                 |         |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 13/01/2028                            | 5 900                               | 5 197                            | 0,42                      | 07/03/2031 (h)                      | 9 100                               | 10 486                           | 0,85                      | PIMCO Advantage                  |         |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 13/01/2031                            | 1 100                               | 983                              | 0,08                      | 4,375 % éch.                        |                                     |                                  |                           | Euro Government                  |         |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement slovène  |                                     |                                  |                           | 07/03/2030 (h)                      | 19 100                              | 22 275                           | 1,81                      | Bond UCITS ETF (f)               | 493 941 | € 12 537                         | 1,02                      |
| 3,125 % éch.                                       |                                     |                                  |                           |                                     |                                     | 681 552                          | 55,45                     | PIMCO ETFs plc -                 |         |                                  |                           |
| 02/07/2035 (h)                                     | € 21 450                            | 21 399                           | 1,74                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>    |                                     |                                  |                           | PIMCO Euro Short                 |         |                                  |                           |
| 3,275 % éch. 12/03/2036                            | 18 050                              | 18 101                           | 1,47                      | <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN</b>  |                                     |                                  |                           | Maturity UCITS                   |         |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 14/04/2055                            | 3 400                               | 3 125                            | 0,25                      | 7,066 % éch. 28/10/2026             |                                     |                                  |                           | ETF (f)                          | 200 932 | 21 554                           | 1,75                      |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol |                                     |                                  |                           | (b)(c)                              | ZAR 8 500                           | 444                              | 0,04                      |                                  |         |                                  |                           |
| 2,600 % éch. 31/05/2031                            | 2 700                               | 2 674                            | 0,22                      | Total des Instruments à court terme |                                     | 444                              | 0,04                      | Total des Fonds d'investissement |         | € 34 091                         | 2,77                      |
| 3,100 % éch. 30/07/2031                            | 21 800                              | 22 088                           | 1,80                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                  |         |                                  |                           |
| 3,150 % éch. 30/04/2035                            | 300                                 | 299                              | 0,02                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                  |         |                                  |                           |
| 3,200 % éch. 31/10/2035                            | 33 000                              | 32 868                           | 2,67                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                  |         |                                  |                           |
| Treasury Corp. of Victoria                         |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières        |                                     | € 1 483 764                      | 120,72                    |                                  |         |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 15/09/2033                            | AUD 8 500                           | 4 282                            | 0,35                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                  |         |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 20/12/2032                            | 6 900                               | 4 023                            | 0,33                      |                                     |                                     |                                  |                           |                                  |         |                                  |                           |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                     | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| COM                                   | 2,270 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | € 52 100                | Bpifrance SACA 1,000 % -2,125 %<br>éch. 25/05/2027 - 29/11/2027 | € (53 105)          | € 52 100                                       | € 52 103                                                                       | 4,24                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                 | € (53 105)          | € 52 100                                       | € 52 103                                                                       | 4,24                   |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026              | 152                   | € (140)                                 | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026              | 1 891                 | (967)                                   | (0,08)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Court | 09/2026              | 185                   | (146)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 26                    | 41                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 1 194                 | (554)                                   | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026              | 4 478                 | 300                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026              | 398                   | 66                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 496                   | 97                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 78                    | 44                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026              | 583                   | (711)                                   | (0,06)                 |
| CContrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre              | Court | 09/2026              | 12                    | (29)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 261                   | 261                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Court | 09/2026              | 75                    | (25)                                    | 0,00                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | € (1 763)                               | (0,14)                 |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                   | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime   | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|---------|-----------------|------------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor septembre 2026 | € 97,625           | 14/09/2026           | 1 282                 | € (300) | € (56)          | (0,01)                 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé    |                    |                      |                       |         | € (1 819)       | (0,15)                 |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                          | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice iTraxx Crossover 44 Index à 5 ans | (5,000) %              | 20/12/2030         | € 2 060                             | € (17)                                  | 0,00                   |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice iTraxx Europe Main 44 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | € 12 390                         | € 7                               | 0,00                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 34 915                           | 113                               | 0,01                |
|                                            |                      |                 |                                  | € 120                             | 0,01                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500 %   | 18/03/2036      | ¥ 3 986 800       | € 705                             | 0,06                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/12/2027      | \$ 52 400         | 597                               | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 128 500           | 2 928                             | 0,24                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 23 900            | 794                               | 0,06                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 26 600            | 346                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 9 400             | (255)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 44 800          | (405)                             | (0,03)              |
| À payer <sup>(4)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 101 320           | 650                               | 0,05                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 78 100            | 314                               | 0,02                |
|                                   |                                   |           |                 |                   | € 5 674                           | 0,46                |
|                                   |                                   |           |                 |                   | € 5 777                           | 0,47                |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

## OPTIONS VENDUES

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,440 %         | 25/01/2027        | 3 500                            | € (30)    | € (5)        | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,440           | 25/01/2027        | 3 500                            | (30)      | (24)         | 0,00                |
| CBK          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 131 700                          | (411)     | (503)        | (0,04)              |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,350           | 07/01/2027        | 16 900                           | (148)     | (17)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,350           | 07/01/2027        | 16 900                           | (148)     | (140)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,500           | 14/01/2027        | 20 300                           | (181)     | (35)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500           | 14/01/2027        | 20 300                           | (181)     | (124)        | (0,01)              |
| GST          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 62 600                           | (185)     | (239)        | (0,02)              |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 0,008           | 17/12/2029        | 10 900                           | (352)     | (46)         | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 0,008           | 17/12/2029        | 5 500                            | (341)     | (41)         | 0,00                |
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 27/08/2026        | 21 600                           | (107)     | (89)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 21 600                           | (107)     | (29)         | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | € (2 221) | € (1 292)    | (0,10)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CNH             | 1 355             | \$ 201             | € 1                   | € 0                                     | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 156               | 30                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 159 465           | € 21 348           | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 131 405           | \$ 86              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 16                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 134             | CNH 7 669          | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 120               | PLN 454            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 992             | \$ 670             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 540             | 143                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 460               | INR 43 703         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |



# Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |             | Devise à recevoir |            | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |      | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|------------|--------------------|-----|-----------------------|------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| BPS          | 10/2026           | ZAR             | 8 226       | \$                | 504        | €                  | 6   | €                     | 0    | €                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 01/2027           | DKK             | 13 314      | €                 | 1 789      |                    | 4   |                       | 0    |                                         | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 52          |                   | 31         |                    | 0   |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 3 486       | \$                | 674        |                    | 2   |                       | (2)  |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 347       | €                 | 1 462      |                    | 2   |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 8 352       | \$                | 1 234      |                    | 3   |                       | 0    |                                         | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 1 520       |                   | 1 766      |                    | 25  |                       | 0    |                                         | 25                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 130 530 624 |                   | 7 284      |                    | 6   |                       | (4)  |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 155       |                   | 1 070      |                    | 10  |                       | 0    |                                         | 10                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 242 801     |                   | 2 528      |                    | 0   |                       | (32) |                                         | (32)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 580 065     |                   | 380        |                    | 5   |                       | 0    |                                         | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 33 980      |                   | 1 036      |                    | 12  |                       | (1)  |                                         | 11                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 10 058      | BRL               | 53 980     |                    | 328 |                       | (4)  |                                         | 324                 | 0,03   |
|              | 07/2026           |                 | 12 656      | €                 | 11 046     |                    | 12  |                       | (36) |                                         | (24)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 7 067       | INR               | 670 036    |                    | 12  |                       | (11) |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 717       | KRW               | 2 633 933  |                    | 0   |                       | (14) |                                         | (14)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 461         | ZAR               | 7 566      |                    | 0   |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 31          | AUD               | 52         |                    | 0   |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 446         | \$                | 150        |                    | 0   |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 222         | BRL               | 1 132      |                    | 0   |                       | (5)  |                                         | (5)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 15 066 064  | \$                | 830        |                    | 0   |                       | (5)  |                                         | (5)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 31 178      |                   | 961        |                    | 15  |                       | 0    |                                         | 15                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 4 254       | IDR               | 75 493 123 |                    | 5   |                       | (66) |                                         | (61)                | (0,01) |
|              | 09/2026           |                 | 463         | INR               | 43 961     |                    | 0   |                       | (1)  |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 190         | THB               | 6 211      |                    | 0   |                       | (1)  |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 528         | IDR               | 9 616 965  |                    | 1   |                       | 0    |                                         | 1                   | 0,00   |
| BRC          | 01/2027           | DKK             | 4 989       | €                 | 670        |                    | 2   |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 41 426      |                   | 25 360     |                    | 256 |                       | 0    |                                         | 256                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | €               | 1 274       | ¥                 | 235 900    |                    | 0   |                       | (5)  |                                         | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 987         | NZD               | 1 985      |                    | 1   |                       | 0    |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 878       | \$                | 1 310      |                    | 7   |                       | 0    |                                         | 7                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 3 351       | €                 | 298        |                    | 2   |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 7 133       | TRY               | 338 750    |                    | 13  |                       | 0    |                                         | 13                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 301       | ZAR               | 37 367     |                    | 0   |                       | (21) |                                         | (21)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 7 258       | €                 | 4 474      |                    | 0   |                       | (1)  |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 127         | NOK               | 1 439      |                    | 0   |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           | CHF             | 1 281       | €                 | 1 407      |                    | 18  |                       | 0    |                                         | 18                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 787         | £                 | 683        |                    | 6   |                       | 0    |                                         | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 982         | NOK               | 10 638     |                    | 0   |                       | (42) |                                         | (42)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 11 985      | \$                | 4 122      |                    | 86  |                       | 0    |                                         | 86                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | INR             | 135 892     |                   | 1 440      |                    | 4   |                       | 0    |                                         | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 399       | IDR               | 25 099 584 |                    | 2   |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 402       | INR               | 135 892    |                    | 29  |                       | 0    |                                         | 29                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 188         | KRW               | 283 767    |                    | 0   |                       | (4)  |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 469         | PLN               | 1 713      |                    | 0   |                       | (11) |                                         | (11)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 4 898       | \$                | 1 693      |                    | 42  |                       | 0    |                                         | 42                  | 0,00   |
| 08/2026      | \$                | 366             | ILS         | 1 087             |            | 0                  |     | (1)                   |      | (1)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | IDR               | 54 718 402      | \$          | 3 031             |            | 0                  |     | (2)                   |      | (2)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | INR               | 16 412          |             | 171               |            | 0                  |     | (1)                   |      | (1)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | THB               | 36 488          |             | 1 102             |            | 0                  |     | (3)                   |      | (3)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | \$                | 1 666           | COP         | 6 467 612         |            | 155                |     | 0                     |      | 155                                     | 0,01                |        |
| 09/2026      |                   | 1 059           | IDR         | 18 887 454        |            | 0                  |     | (11)                  |      | (11)                                    | 0,00                |        |
| 09/2026      |                   | 397             | MXN         | 7 105             |            | 6                  |     | 0                     |      | 6                                       | 0,00                |        |
| 12/2026      |                   | 1 632           | IDR         | 29 671 456        |            | 2                  |     | 0                     |      | 2                                       | 0,00                |        |
| DUB          | 01/2027           | DKK             | 8 400       | €                 | 1 129      |                    | 3   |                       | 0    |                                         | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 3 328 416   | \$                | 186        |                    | 0   |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 52 282      |                   | 554        |                    | 2   |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 369         | INR               | 35 637     |                    | 6   |                       | 0    |                                         | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 468         | PLN               | 1 737      |                    | 0   |                       | (5)  |                                         | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 073       | ZAR               | 17 376     |                    | 0   |                       | (13) |                                         | (13)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 33 379 524  | \$                | 1 853      |                    | 2   |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 650         | IDR               | 11 804 172 |                    | 4   |                       | 0    |                                         | 4                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 554         | INR               | 52 636     |                    | 0   |                       | (2)  |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 8 309       | \$                | 1 228      |                    | 4   |                       | 0    |                                         | 4                   | 0,00   |
| 07/2026      | INR               | 94 802          |             | 1 005             |            | 3                  |     | 0                     |      | 3                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      | SGD               | 28 313          |             | 22 193            |            | 264                |     | 0                     |      | 264                                     | 0,02                |        |
| 07/2026      | \$                | 3 296           | CNH         | 22 423            |            | 6                  |     | 0                     |      | 6                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                   | 993             | INR         | 94 802            |            | 7                  |     | 0                     |      | 7                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                   | 3 569           | PLN         | 13 071            |            | 0                  |     | (80)                  |      | (80)                                    | (0,01)              |        |
| 07/2026      |                   | 1 500           | ZAR         | 24 754            |            | 7                  |     | 0                     |      | 7                                       | 0,00                |        |
| 08/2026      | CNH               | 22 373          | \$          | 3 296             |            | 0                  |     | (6)                   |      | (6)                                     | 0,00                |        |
| 08/2026      | ILS               | 2 034           |             | 711               |            | 24                 |     | 0                     |      | 24                                      | 0,00                |        |
| 09/2026      | \$                | 485             | INR         | 46 516            |            | 2                  |     | 0                     |      | 2                                       | 0,00                |        |
| 09/2026      |                   | 322             | MXN         | 5 692             |            | 1                  |     | 0                     |      | 1                                       | 0,00                |        |
| GLM          | 07/2026           | BRL             | 111 495     | \$                | 21 656     |                    | 100 |                       | 0    |                                         | 100                 | 0,01   |
|              | 07/2026           | CAD             | 519         |                   | 365        |                    | 0   |                       | (1)  |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 539 776     |                   | 350        |                    | 1   |                       | 0    |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 11 007      | BRL               | 59 425     |                    | 421 |                       | (8)  |                                         | 413                 | 0,03   |
|              | 07/2026           |                 | 2 599       | €                 | 2 232      |                    | 0   |                       | (42) |                                         | (42)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 352       | IDR               | 24 239 926 |                    | 3   |                       | 0    |                                         | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 350         | KRW               | 539 699    |                    | 0   |                       | (1)  |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 4 085       | BRL               | 20 852     |                    | 0   |                       | (77) |                                         | (77)                | (0,01) |
|              | 08/2026           |                 | 365         | CAD               | 518        |                    | 1   |                       | 0    |                                         | 1                   | 0,00   |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 08/2026           | \$              | 367               | INR                | 35 198                | € 3                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 24 381 877        | \$                 | 1 352                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 873             |                    | 107                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 101 448           |                    | 3 144                 | 62                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 481               | BRL                | 2 476                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3 032             | IDR                | 54 438 079            | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 648             | INR                | 158 528               | 14                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 564               | MXN                | 9 826                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 21 656            | BRL                | 113 949               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 63 565            | €                  | 8 534                 | 31                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 4 338             | CHF                | 4 000                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 729             | DKK                | 65 245                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 284               | ¥                  | 52 303                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 288             | \$                 | 8 436                 | 90                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS             | 9 925             |                    | 3 324                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 11 127            |                    | 118                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 126 235           | €                  | 683                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 166 794           | \$                 | 108                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 7 126             | €                  | 631                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 16 632            |                    | 8 510                 | 234                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | SEK             | 1 913             |                    | 173                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 35 499            | \$                 | 753                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 283               | CNH                | 1 913                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 557             | €                  | 7 422                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 146               | £                  | 109                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 204               | IDR                | 3 671 597             | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 118               | INR                | 11 127                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 163               | KRW                | 249 781               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 826             | PLN                | 21 238                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 747               | THB                | 24 975                | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 4 000             | €                  | 4 348                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 65 221            |                    | 8 729                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 631               | NOK                | 7 139                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 173               | SEK                | 1 912                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 8 019             | \$                 | 2 754                 | 53                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 52 303            | €                  | 284                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 3 692 000         | \$                 | 204                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 6 519             |                    | 370                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 77 602            |                    | 2 379                 | 32                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | TWD             | 498               |                    | 16                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 514             | INR                | 239 754               | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 19 113            | MXN                | 332 194               | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 12/2026           | MXN             | 1 199             | \$                 | 68                    | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 878               | MXN                | 15 501                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 39 801            | €                  | 5 328                 | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 917               | AUD                | 1 489                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 273             | £                  | 4 571                 | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 883               | €                  | 1 017                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 333 032           | \$                 | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 52 488            |                    | 556                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 2 261 793         |                    | 1 492                 | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 5 353             | €                  | 2 724                 | 61                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 452               | CHF                | 354                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 857               | INR                | 82 603                | 13                                      | 0,00                |
| MYI          | 09/2026           | THB             | 21 385            | \$                 | 640                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 344             | INR                | 224 224               | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 971               | €                  | 1 061                 | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 549               |                    | 73                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 1 308             | AUD                | 2 153                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 67 607            | £                  | 58 362                | 145                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 181               | SEK                | 1 950                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 393             | \$                 | 6 124                 | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | NZD             | 840               | €                  | 426                   | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 012             | ILS                | 2 938                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 55 310            | €                  | 63 991                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 258             | IDR                | 22 436 961            | 0                                       | 0,00                |
| RYL<br>SCX   | 07/2026           |                 | 867               | INR                | 83 370                | 12                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 22 562 792        | \$                 | 1 258                 | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 648               | IDR                | 11 531 210            | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 888             | €                  | 1 620                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 56 018            |                    | 34 274                | 329                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | CAD             | 21 332            |                    | 13 243                | 92                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 56 758            | AUD                | 93 854                | 114                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 9 277             | DKK                | 69 339                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 722             | ¥                  | 501 470               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 680 169           | €                  | 3 671                 | 10                                      | 0,00                |
| RYL<br>SCX   | 07/2026           | \$              | 475               | IDR                | 8 516 087             | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 141             | INR                | 109 320               | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 94 040            | €                  | 56 758                | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 69 312            |                    | 9 277                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 501 470           |                    | 2 725                 | 23                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 912               | INR                | 87 425                | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 25 969 528        | \$                 | 1 439                 | 0                                       | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir |            | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 09/2026           | THB             | 36 176    | \$                | 1 120      | € 21               | € 0                   | € 21                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 652     | IDR               | 29 658 336 | 2                  | (9)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 7 850     | €                 | 8 583      | 71                 | 0                     | 71                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 354       | \$                | 438        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 13 988    |                   | 2 068      | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 136     | CAD               | 9 936      | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 77 458    | £                 | 66 820     | 114                | 0                     | 114                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 181 077   | \$                | 205 975    | 0                  | (918)                 | (918)                                   | (0,07)              |
|              | 07/2026           | £               | 140 594   | €                 | 162 087    | 0                  | (1 126)               | (1 126)                                 | (0,09)              |
|              | 07/2026           |                 | 104       | \$                | 137        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 42        |                   | 32         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 201 763   | €                 | 172 959    | 0                  | (3 515)               | (3 515)                                 | (0,29)              |
|              | 07/2026           |                 | 21 908    | SGD               | 28 371     | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 9 936     | €                 | 6 136      | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 66 912    |                   | 77 458     | 0                  | (115)                 | (115)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 28 307    | \$                | 21 908     | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 438       | CHF               | 353        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 206 254   | €                 | 181 077    | 916                | 0                     | 916                                     | 0,08                |
|              | SSB               | 08/2026         |           | 137               | £          | 104                | 1                     | 0                                       | 1                   |
| 08/2026      |                   |                 | 32        | SGD               | 42         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026      |                   | CAD             | 5         | \$                | 3          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026      |                   | €               | 8 084     | CHF               | 7 449      | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
| 07/2026      |                   | \$              | 387       | CAD               | 533        | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | CHF             | 7 449     | €                 | 8 102      | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 3         | CAD               | 5          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 9 989     | DKK               | 74 666     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 31        | ¥                 | 5 762      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 477       | PLN               | 1 742      | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK             | 74 636    | €                 | 9 989      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 5 762     |                   | 31         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 780     | \$                | 159        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 4 117     |                   | 125        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | 6 154 603 |                   | 1 577      | 0                  | (121)                 | (121)                                   | (0,01)              |
|              |                   |                 |           |                   |            | € 4 585            | € (7 394)             | € (2 809)                               | (0,23)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ (4 101) (0,33)

### DESCRIPTION

#### AUTRES ACTIFS FINANCIERS

Credit Suisse AG AT1 Claim

| VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| € 700                         | € 216                      | 0,02                |

Total des Autres actifs financiers

€ 216 0,02

Total des Investissements

€ 1 570 028 127,74

Autres actifs et passifs à court terme

€ (340 931) (27,74)

Actif net

€ 1 229 097 100,00

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

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

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Un titre d'une juste valeur globale de 231 346 € (31 décembre 2025 : 1 044 €) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 € (31 décembre 2025 : 723 €) et un montant en numéraire de 5 308 € (31 décembre 2025 : 775 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 267 € (31 décembre 2025 : 0 €) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 20 557 € (31 décembre 2025 : 16 654 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) |               | Autres données significatives observables (Niveau 2) |                  | Données significatives non observables (Niveau 3) |               | Juste valeur       |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|---------------|------------------------------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|---------------|--------------------|
| Valeurs mobilières                            | €                                                                                 | 0             | €                                                    | 1 471 745        | €                                                 | 12 019        | € 1 483 764        |
| Fonds d'investissement                        |                                                                                   | 34 091        |                                                      | 0                |                                                   | 0             | 34 091             |
| Contrats de mise en pension                   |                                                                                   | 0             |                                                      | 52 100           |                                                   | 0             | 52 100             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> |                                                                                   | (1 547)       |                                                      | 1 404            |                                                   | 0             | (143)              |
| Autres actifs financiers                      |                                                                                   | 0             |                                                      | 216              |                                                   | 0             | 216                |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€</b>                                                                          | <b>32 544</b> | <b>€</b>                                             | <b>1 525 465</b> | <b>€</b>                                          | <b>12 019</b> | <b>€ 1 570 028</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) |              | Autres données significatives observables (Niveau 2) |                  | Données significatives non observables (Niveau 3) |               | Juste valeur       |
|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|--------------|------------------------------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|---------------|--------------------|
| Valeurs mobilières                            | €                                                                                  | 3 319        | €                                                    | 1 173 477        | €                                                 | 13 799        | € 1 190 595        |
| Fonds d'investissement                        |                                                                                    | 0            |                                                      | 120 284          |                                                   | 0             | 120 284            |
| Contrats de mise en pension                   |                                                                                    | 0            |                                                      | 50 300           |                                                   | 0             | 50 300             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> |                                                                                    | 652          |                                                      | 6 359            |                                                   | 0             | 7 011              |
| Autres actifs financiers                      |                                                                                    | 0            |                                                      | 176              |                                                   | 0             | 176                |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>€</b>                                                                           | <b>3 971</b> | <b>€</b>                                             | <b>1 350 596</b> | <b>€</b>                                          | <b>13 799</b> | <b>€ 1 368 366</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance          | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 2,170 %        | 06/05/2026        | 10/07/2026               | € (43 049)       | € (43 194)                               | (3,52)              |
|                                               | 2,200          | 06/05/2026        | 10/07/2026               | (35 675)         | (35 798)                                 | (2,91)              |
|                                               | 2,290          | 10/06/2026        | 29/07/2026               | (33 104)         | (33 149)                                 | (2,70)              |
| BRC                                           | 2,000          | 17/06/2026        | À définir <sup>(1)</sup> | (492)            | (492)                                    | (0,04)              |
|                                               | 3,920          | 05/06/2026        | 03/08/2026               | £ (19 176)       | (22 323)                                 | (1,82)              |
| COM                                           | 2,150          | 17/06/2026        | À définir <sup>(1)</sup> | € (20 841)       | (20 858)                                 | (1,70)              |
|                                               | 2,180          | 30/06/2026        | 01/07/2026               | (45 952)         | (45 955)                                 | (3,74)              |
| MEI                                           | 3,900          | 05/06/2026        | 03/08/2026               | £ (2 986)        | (3 476)                                  | (0,28)              |
| MYI                                           | 2,300          | 17/06/2026        | À définir <sup>(1)</sup> | € (2 010)        | (2 012)                                  | (0,16)              |
| SBI                                           | 2,280          | 10/06/2026        | 29/07/2026               | (25 450)         | (25 483)                                 | (2,07)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                          |                  | <b>€ (232 740)</b>                       | <b>(18,94)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | € 1                                                        | € 0                     | € 1                               | € S/O                                                      | € S/O                   | € S/O                             |
| BOA          | 19                                                         | 0                       | 19                                | 51                                                         | 0                       | 51                                |
| BPS          | 258                                                        | (270)                   | (12)                              | 161                                                        | (270)                   | (109)                             |
| BRC          | 223                                                        | (227)                   | (4)                               | 213                                                        | 0                       | 213                               |
| CBK          | (225)                                                      | 270                     | 45                                | 105                                                        | 0                       | 105                               |
| DUB          | (6)                                                        | 0                       | (6)                               | 27                                                         | 0                       | 27                                |
| FAR          | 232                                                        | (227)                   | 5                                 | 299                                                        | (238)                   | 61                                |
| GLM          | 35                                                         | (805)                   | (770)                             | (227)                                                      | (383)                   | (610)                             |
| GST          | (239)                                                      | 236                     | (3)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 13                                                         | 0                       | 13                                | (803)                                                      | 732                     | (71)                              |
| MBC          | 106                                                        | 0                       | 106                               | (83)                                                       | 0                       | (83)                              |
| MYC          | (87)                                                       | (700)                   | (787)                             | (80)                                                       | (681)                   | (761)                             |
| MYI          | (37)                                                       | 0                       | (37)                              | (93)                                                       | 43                      | (50)                              |
| NSL          | 8                                                          | 0                       | 8                                 | 12                                                         | 0                       | 12                                |
| RYL          | (31)                                                       | 0                       | (31)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 457                                                        | (640)                   | (183)                             | (601)                                                      | 723                     | 122                               |
| SOG          | (4 687)                                                    | 4 697                   | 10                                | 1 505                                                      | (1 584)                 | (79)                              |
| SSB          | (9)                                                        | 0                       | (9)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | (132)                                                      | 105                     | (27)                              | 59                                                         | 0                       | 59                                |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 60,19            | 49,99                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 24,21            | 25,01                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,17             | 0,19                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,94             | 7,60                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 2,97             | 3,18                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,05             | 0,10                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,37             | 0,44                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,26             | 0,26                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,22             | 0,01                 |
| Autres actifs                                                    | 9,62             | 13,22                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                                         | 14,15            | 20,00                |
| Agences du gouvernement américain                                                                     | 13,94            | 13,51                |
| Obligations du Trésor américain                                                                       | 7,61             | 6,81                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux               | 9,22             | 9,29                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                           | 20,31            | 19,35                |
| Émissions souveraines                                                                                 | 55,45            | 26,11                |
| Titres privilégiés                                                                                    | S/O              | 0,27                 |
| Instruments à court terme                                                                             | 0,04             | 0,28                 |
| Fonds d'investissement                                                                                | 2,77             | 9,66                 |
| Contrats de mise en pension                                                                           | 4,24             | 4,04                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | (0,14)           | 0,03                 |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | (0,01)           | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                              |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                      | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                      | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                               | 0,46             | 0,48                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                              |                  |                      |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                           | (0,10)           | (0,09)               |
| Contrats de change à terme                                                                            | (0,23)           | 0,13                 |
| Autres actifs financiers                                                                              | 0,02             | 0,01                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                | (27,74)          | (9,89)               |
| Actif net                                                                                             | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>ARGENTINE</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                                                 |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                                                                            | \$ 222                              | \$ 160                           | 0,04                      |
| 1,000 % éch. 09/07/2029                                                                            | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                                                            | 91                                  | 68                               | 0,01                      |
| Total Argentine                                                                                    |                                     | 230                              | 0,05                      |
| <b>AUSTRALIE</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
| Bank of Queensland Ltd.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,300 % éch. 30/07/2029                                                                            | € 1 400                             | 1 613                            | 0,38                      |
| Commonwealth Bank of Australia                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 2,907 % éch. 11/11/2030                                                                            | 900                                 | 1 028                            | 0,24                      |
| 3,331 % éch. 01/06/2033                                                                            | 700                                 | 812                              | 0,19                      |
| Macquarie Bank Ltd.                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 2,778 % éch. 25/02/2030                                                                            | 500                                 | 568                              | 0,13                      |
| National Australia Bank Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 2,845 % éch. 03/03/2032                                                                            | 1 100                               | 1 245                            | 0,29                      |
| 3,146 % éch. 05/02/2031                                                                            | 2 600                               | 2 993                            | 0,69                      |
| Westpac Banking Corp.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 3,131 % éch. 15/04/2031                                                                            | 2 600                               | 2 992                            | 0,69                      |
|                                                                                                    |                                     | 11 251                           | 2,61                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br/>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                                                        | AUD 6 700                           | 4 626                            | 1,07                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement australien                                               |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 21/11/2027                                                                            | 2 760                               | 1 897                            | 0,44                      |
| 1,750 % éch. 21/06/2051                                                                            | 700                                 | 249                              | 0,06                      |
| 2,500 % éch. 21/05/2030                                                                            | 500                                 | 324                              | 0,08                      |
| New South Wales Treasury Corp.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 20/03/2034                                                                            | 1 300                               | 710                              | 0,16                      |
| 2,000 % éch. 08/03/2033                                                                            | 600                                 | 346                              | 0,08                      |
| 3,500 % éch. 20/11/2037                                                                            | 800                                 | 462                              | 0,11                      |
| Queensland Treasury Corp.                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 20/08/2032                                                                            | 500                                 | 285                              | 0,07                      |
| 1,750 % éch. 20/07/2034                                                                            | 1 500                               | 808                              | 0,19                      |
| 2,000 % éch. 22/08/2033                                                                            | 4 200                               | 2 387                            | 0,55                      |
| 5,250 % éch. 21/07/2036                                                                            | 2 500                               | 1 720                            | 0,40                      |
| Treasury Corp. of Victoria                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 17/09/2035                                                                            | 1 000                               | 527                              | 0,12                      |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                                                                            | 1 400                               | 681                              | 0,16                      |
| 2,250 % éch. 15/09/2033                                                                            | 1 600                               | 921                              | 0,21                      |
| 2,250 % éch. 20/11/2034                                                                            | 1 000                               | 554                              | 0,13                      |
| 4,250 % éch. 20/12/2032                                                                            | 1 000                               | 667                              | 0,15                      |
|                                                                                                    |                                     | 12 538                           | 2,91                      |
| Total Australie                                                                                    |                                     | 28 415                           | 6,59                      |
| <b>BELGIQUE</b>                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                               |                                     |                                  |                           |
| Belfius Bank S.A.                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,875 % éch. 12/02/2031                                                                            | € 900                               | 1 026                            | 0,24                      |
| ING Belgium S.A.                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/02/2031                                                                            | 800                                 | 918                              | 0,21                      |
| Total Belgique                                                                                     |                                     | 1 944                            | 0,45                      |
| <b>BRÉSIL</b>                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 23/04/2030                                                                            | 1 100                               | 1 262                            | 0,29                      |
| 4,875 % éch. 23/04/2033                                                                            | 3 100                               | 3 560                            | 0,83                      |
| Total Brésil                                                                                       |                                     | 4 822                            | 1,12                      |
| <b>BULGARIE</b>                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 18/07/2035                                                                            | 500                                 | 558                              | 0,13                      |
| 4,125 % éch. 18/07/2045                                                                            | 600                                 | 659                              | 0,15                      |
| Total Bulgarie                                                                                     |                                     | 1 217                            | 0,28                      |

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>CANADA</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Air Canada Pass-Through Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 3,300 % éch. 15/07/2031                              | \$ 308                              | \$ 293                           | 0,07                      |
| Banque de Montréal                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 08/06/2033                              | € 1 900                             | 2 177                            | 0,50                      |
| Fairfax Financial Holdings Ltd.                      |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 29/03/2028                              | 400                                 | 454                              | 0,11                      |
| Royal Bank of Canada                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,498 % éch. 06/08/2029                              | \$ 1 300                            | 1 296                            | 0,30                      |
| Toronto-Dominion Bank                                |                                     |                                  |                           |
| 5,298 % éch. 30/01/2032                              | 1 600                               | 1 635                            | 0,38                      |
|                                                      |                                     | 5 855                            | 1,36                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/12/2044 (e)                          | CAD 2 761                           | 1 903                            | 0,44                      |
| Exportation et Développement Canada                  |                                     |                                  |                           |
| 7,130 % éch. 11/03/2029                              | INR 62 600                          | 659                              | 0,15                      |
|                                                      |                                     | 2 562                            | 0,59                      |
| Total Canada                                         |                                     | 8 417                            | 1,95                      |
| <b>ÎLES CAÏMANS</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                   |                                     |                                  |                           |
| Dryden CLO Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,955 % éch. 15/04/2031                              | \$ 149                              | 149                              | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Gaci First Investment Co.                            |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 14/02/2030                              | 1 400                               | 1 391                            | 0,32                      |
| 4,875 % éch. 14/05/2029                              | 700                                 | 698                              | 0,16                      |
| 4,875 % éch. 14/02/2035                              | 900                                 | 876                              | 0,20                      |
| 5,000 % éch. 29/01/2029                              | 1 500                               | 1 501                            | 0,35                      |
| 5,250 % éch. 29/01/2030                              | 2 300                               | 2 322                            | 0,54                      |
| 5,250 % éch. 29/01/2034                              | 1 000                               | 1 000                            | 0,23                      |
| 5,625 % éch. 29/07/2034                              | 1 000                               | 1 024                            | 0,24                      |
| QNB Finance Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,538 % éch. 19/09/2027                              | 2 200                               | 2 199                            | 0,51                      |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                              | 400                                 | 402                              | 0,10                      |
|                                                      |                                     | 11 413                           | 2,65                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| RAK Capital                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 12/03/2035                              | 1 300                               | 1 312                            | 0,30                      |
| Total Îles Caïmans                                   |                                     | 12 874                           | 2,98                      |
| <b>CHILI</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos       |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 01/09/2030                              | CLP 550 000                         | 589                              | 0,14                      |
| 5,800 % éch. 01/10/2029                              | 4 260 000                           | 4 755                            | 1,10                      |
| Obligation internationale du gouvernement chilien    |                                     |                                  |                           |
| 4,850 % éch. 22/01/2029                              | \$ 800                              | 807                              | 0,19                      |
| Total Chili                                          |                                     | 6 151                            | 1,43                      |
| <b>CHINE</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Banque de développement chinoise                     |                                     |                                  |                           |
| 2,630 % éch. 08/01/2034                              | CNY 25 760                          | 4 046                            | 0,94                      |
| 2,820 % éch. 22/05/2033                              | 15 500                              | 2 457                            | 0,57                      |
| Obligation internationale du gouvernement chinois    |                                     |                                  |                           |
| 2,190 % éch. 25/09/2054                              | 20 900                              | 3 038                            | 0,70                      |
| Total Chine                                          |                                     | 9 541                            | 2,21                      |
| <b>COLOMBIE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           |
| Ecopetrol S.A.                                       |                                     |                                  |                           |
| 8,375 % éch. 19/01/2036                              | \$ 1 250                            | 1 355                            | 0,31                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Bogota Distrito Capital                              |                                     |                                  |                           |
| 13,140 % éch. 05/11/2035                             | COP 1 600 000                       | 465                              | 0,11                      |

| DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>COLOMBIE</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement colombien             |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 26/11/2034                                         | € 1 450                             | \$ 1 689                         | 0,39                      |
| TES colombien                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 18/04/2029 (e)                                     | COP 124 420                         | 33                               | 0,01                      |
| 3,000 % éch. 25/03/2033 (e)                                     | 290 314                             | 69                               | 0,02                      |
| 5,750 % éch. 03/11/2027                                         | 570 000                             | 152                              | 0,04                      |
| 6,500 % éch. 22/01/2031 (e)                                     | 2 926 363                           | 841                              | 0,19                      |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                        | 4 853 600                           | 1 366                            | 0,32                      |
| 11,500 % éch. 25/07/2046                                        | 1 090 500                           | 307                              | 0,07                      |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                        | 3 546 600                           | 1 010                            | 0,23                      |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                        | 734 400                             | 222                              | 0,05                      |
|                                                                 |                                     | 6 154                            | 1,43                      |
| Total Colombie                                                  |                                     | 7 509                            | 1,74                      |
| <b>COSTA RICA</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| <b>Obligation internationale du gouvernement costaricain</b>    |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 21/11/2030                                         | € 1 500                             | 1 804                            | 0,42                      |
| <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Ceska sporitelna A/S                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,224 % éch. 19/05/2031                                         | 900                                 | 1 040                            | 0,24                      |
| Komerční Banka A/S                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 15/10/2030                                         | 900                                 | 1 018                            | 0,23                      |
|                                                                 |                                     | 2 058                            | 0,47                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque |                                     |                                  |                           |
| 0,950 % éch. 15/05/2030                                         | CZK 12 100                          | 509                              | 0,12                      |
| Total République tchèque                                        |                                     | 2 567                            | 0,59                      |
| <b>DANEMARK</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                            |                                     |                                  |                           |
| Jyske Realkredit A/S                                            |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                         | DKK 0                               | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2037                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/07/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                                         | 1 056                               | 132                              | 0,03                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                            |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                                         | 351                                 | 44                               | 0,01                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/10/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| Nykredit Realkredit A/S                                         |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,000 % éch. 01/10/2053                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2037                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2050                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2052                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 01/10/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/10/2036                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/10/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 01/10/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 3,750 % éch. 26/09/2033                                         | € 400                               | 457                              | 0,11                      |
| Realkredit Danmark A/S                                          |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050                                         | DKK 0                               | 0                                | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053                                         | 1 402                               | 174                              | 0,04                      |
| 2,500 % éch. 01/04/2036                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/04/2047                                         | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| Total Danemark                                                  |                                     | 807                              | 0,19                      |
| <b>ÉQUATEUR</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement équatorien            |                                     |                                  |                           |
| 6,900 % éch. 31/07/2035                                         | \$ 700                              | 644                              | 0,15                      |
| <b>ÉGYPTE</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien              |                                     |                                  |                           |
| 19,698 % éch. 14/10/2030                                        | EGP 26 400                          | 511                              | 0,12                      |

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| DESCRIPTION                                             |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 21,954 % éch. 04/03/2028                                | EGP | 45 900                              | \$ 906                           | 0,21                      |
| Total Égypte                                            |     |                                     | 1 417                            | 0,33                      |
| <b>FINLANDE</b>                                         |     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |     |                                     |                                  |                           |
| SP Kiinnitysluottopankki Oyj                            |     |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 02/05/2031                                 | €   | 400                                 | 462                              | 0,11                      |
| <b>FRANCE</b>                                           |     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |     |                                     |                                  |                           |
| BNP Paribas S.A.                                        |     |                                     |                                  |                           |
| 3,583 % éch. 15/01/2031                                 |     | 1 100                               | 1 266                            | 0,29                      |
| BPCE S.A.                                               |     |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 11/01/2029                                 |     | 700                                 | 814                              | 0,19                      |
| 3,875 % éch. 26/02/2036                                 |     | 700                                 | 796                              | 0,18                      |
| 5,936 % éch. 30/05/2035                                 | \$  | 400                                 | 411                              | 0,10                      |
| Cie de Financement Foncier S.A.                         |     |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 24/04/2032                                 | €   | 800                                 | 909                              | 0,21                      |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                      |     |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/12/2030                                 |     | 600                                 | 688                              | 0,16                      |
| Credit Agricole S.A.                                    |     |                                     |                                  |                           |
| 5,862 % éch. 09/01/2036                                 | \$  | 1 800                               | 1 855                            | 0,43                      |
|                                                         |     |                                     | 6 739                            | 1,56                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement français      |     |                                     |                                  |                           |
| 0,100 % éch. 25/07/2031 (e)                             | €   | 1 885                               | 2 057                            | 0,48                      |
| 2,750 % éch. 25/02/2030                                 |     | 9 900                               | 11 284                           | 2,61                      |
|                                                         |     |                                     | 13 341                           | 3,09                      |
| Total France                                            |     |                                     | 20 080                           | 4,65                      |
| <b>GUATEMALA</b>                                        |     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement guatémaltèque |     |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 24/04/2032                                 | \$  | 400                                 | 402                              | 0,09                      |
| 6,250 % éch. 15/08/2036                                 |     | 800                                 | 837                              | 0,20                      |
| Total Guatemala                                         |     |                                     | 1 239                            | 0,29                      |
| <b>HONGRIE</b>                                          |     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois      |     |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 22/03/2040 (h)                             | €   | 300                                 | 360                              | 0,08                      |
| 5,500 % éch. 26/03/2036                                 | \$  | 500                                 | 503                              | 0,12                      |
| 6,250 % éch. 22/09/2032                                 |     | 600                                 | 635                              | 0,15                      |
| Magyar Export-Import Bank                               |     |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 27/11/2031                                 | €   | 700                                 | 823                              | 0,19                      |
| 6,125 % éch. 04/12/2027                                 | \$  | 900                                 | 916                              | 0,21                      |
| Magyar Fejlesztési Bank Zrt                             |     |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 27/06/2030                                 | €   | 1 000                               | 1 176                            | 0,27                      |
| Total Hongrie                                           |     |                                     | 4 413                            | 1,02                      |
| <b>INDE</b>                                             |     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |     |                                     |                                  |                           |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.                      |     |                                     |                                  |                           |
| 7,110 % éch. 11/03/2032                                 | \$  | 1 100                               | 1 115                            | 0,26                      |
| <b>INDONÉSIE</b>                                        |     |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien    |     |                                     |                                  |                           |
| 8,375 % éch. 15/03/2034                                 | IDR | 22 982 000                          | 1 375                            | 0,32                      |
| <b>IRLANDE</b>                                          |     |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                       |     |                                     |                                  |                           |
| Ares European CLO DAC                                   |     |                                     |                                  |                           |
| 2,984 % éch. 15/10/2031                                 | €   | 90                                  | 103                              | 0,02                      |
| Aurium CLO DAC                                          |     |                                     |                                  |                           |
| 2,973 % éch. 16/01/2031                                 |     | 452                                 | 517                              | 0,12                      |
| BNPP AM Euro CLO DAC                                    |     |                                     |                                  |                           |
| 3,014 % éch. 22/07/2032                                 |     | 890                                 | 1 017                            | 0,24                      |
| Cairn CLO DAC                                           |     |                                     |                                  |                           |
| 3,434 % éch. 15/01/2040                                 |     | 900                                 | 1 030                            | 0,24                      |

| DESCRIPTION                                         |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Capital Four CLO DAC                                |    |                                     |                                  |                           |
| 3,394 % éch. 15/04/2038                             | €  | 1 000                               | \$ 1 143                         | 0,26                      |
| Dryden Euro CLO DAC                                 |    |                                     |                                  |                           |
| 2,864 % éch. 15/04/2033                             |    | 216                                 | 247                              | 0,06                      |
| 3,143 % éch. 15/05/2034                             |    | 278                                 | 318                              | 0,07                      |
| Euro-Galaxy CLO DAC                                 |    |                                     |                                  |                           |
| 2,995 % éch. 25/07/2035                             |    | 798                                 | 911                              | 0,21                      |
| Harvest CLO DAC                                     |    |                                     |                                  |                           |
| 3,054 % éch. 15/01/2032                             |    | 628                                 | 719                              | 0,17                      |
| 3,154 % éch. 21/10/2034                             |    | 900                                 | 1 030                            | 0,24                      |
| Hayfin Emerald CLO DAC                              |    |                                     |                                  |                           |
| 3,454 % éch. 15/10/2038                             |    | 900                                 | 1 030                            | 0,24                      |
| ICG Euro CLO DAC                                    |    |                                     |                                  |                           |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                             |    | 1 000                               | 1 144                            | 0,27                      |
| Invesco Euro CLO DAC                                |    |                                     |                                  |                           |
| 3,224 % éch. 15/01/2034                             |    | 1 372                               | 1 570                            | 0,36                      |
| Madison Park Euro Funding DAC                       |    |                                     |                                  |                           |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                             |    | 1 085                               | 1 242                            | 0,29                      |
| OCP Euro CLO DAC                                    |    |                                     |                                  |                           |
| 3,158 % éch. 20/04/2035                             |    | 1 200                               | 1 373                            | 0,32                      |
| 3,513 % éch. 15/04/2037                             |    | 800                                 | 915                              | 0,21                      |
| Toro European CLO DAC                               |    |                                     |                                  |                           |
| 3,155 % éch. 25/07/2034                             |    | 490                                 | 560                              | 0,13                      |
| 3,474 % éch. 15/04/2037                             |    | 1 800                               | 2 060                            | 0,48                      |
|                                                     |    |                                     | 16 929                           | 3,93                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |    |                                     |                                  |                           |
| AerCap Ireland Capital DAC                          |    |                                     |                                  |                           |
| 2,450 % éch. 29/10/2026                             | \$ | 400                                 | 398                              | 0,09                      |
| 3,000 % éch. 29/10/2028                             |    | 500                                 | 481                              | 0,11                      |
|                                                     |    |                                     | 879                              | 0,20                      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                     |    |                                     |                                  |                           |
| République du Panama                                |    |                                     |                                  |                           |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                             | €  | 300                                 | 344                              | 0,08                      |
| Total Irlande                                       |    |                                     | 18 152                           | 4,21                      |
| ISRAËL                                              |    |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement israélien |    |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 17/01/2033                             | \$ | 2 200                               | 2 125                            | 0,49                      |
| 5,000 % éch. 30/10/2026                             | €  | 2 100                               | 2 417                            | 0,56                      |
| 5,375 % éch. 19/02/2030                             | \$ | 200                                 | 203                              | 0,05                      |
| 5,625 % éch. 19/02/2035                             |    | 1 800                               | 1 842                            | 0,43                      |
| Total Israël                                        |    |                                     | 6 587                            | 1,53                      |
| ITALIE                                              |    |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                          |    |                                     |                                  |                           |
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL                   |    |                                     |                                  |                           |
| 2,953 % éch. 26/12/2041                             | €  | 900                                 | 1 031                            | 0,24                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |    |                                     |                                  |                           |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                 |    |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 05/09/2027                             |    | 400                                 | 460                              | 0,11                      |
| Intesa Sanpaolo SpA                                 |    |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 20/06/2033                             | \$ | 400                                 | 434                              | 0,10                      |
|                                                     |    |                                     | 894                              | 0,21                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement italien   |    |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 04/08/2028                             | £  | 1 000                               | 1 361                            | 0,31                      |
| Total Italie                                        |    |                                     | 3 286                            | 0,76                      |
| CÔTE D'IVOIRE                                       |    |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |    |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement ivoirien  |    |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 22/03/2030                             | €  | 1 600                               | 1 855                            | 0,43                      |
| 5,875 % éch. 17/10/2031                             |    | 700                                 | 825                              | 0,19                      |
| Total Côte d'Ivoire                                 |    |                                     | 2 680                            | 0,62                      |
| JAPON                                               |    |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |    |                                     |                                  |                           |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                |    |                                     |                                  |                           |
| 2,494 % éch. 13/10/2032                             | \$ | 900                                 | 797                              | 0,18                      |

| DESCRIPTION                                         |       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 5,159 % éch. 24/04/2031                             | \$    | 2 000                               | \$ 2 021                         | 0,47                      |
| Nomura Holdings, Inc.                               |       |                                     |                                  |                           |
| 2,329 % éch. 22/01/2027                             |       | 400                                 | 395                              | 0,09                      |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.                       |       |                                     |                                  |                           |
| 0,409 % éch. 07/11/2029                             | €     | 1 300                               | 1 366                            | 0,32                      |
| 2,737 % éch. 18/02/2030                             |       | 800                                 | 905                              | 0,21                      |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.               |       |                                     |                                  |                           |
| 4,825 % éch. 08/07/2031                             | \$    | 1 100                               | 1 109                            | 0,26                      |
| 5,520 % éch. 13/01/2028                             |       | 1 200                               | 1 218                            | 0,28                      |
|                                                     |       |                                     | 7 811                            | 1,81                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais  |       |                                     |                                  |                           |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (e)                         | ¥     | 960 326                             | 5 932                            | 1,38                      |
| 0,100 % éch. 10/03/2029 (e)                         |       | 996 741                             | 6 130                            | 1,42                      |
| 0,400 % éch. 20/06/2029                             |       | 300 000                             | 1 786                            | 0,41                      |
| 0,400 % éch. 20/06/2040                             |       | 440 000                             | 1 862                            | 0,43                      |
| 0,500 % éch. 20/03/2049                             |       | 211 000                             | 655                              | 0,15                      |
| 0,700 % éch. 20/06/2051                             |       | 204 000                             | 620                              | 0,14                      |
| 2,000 % éch. 20/12/2044                             |       | 140 000                             | 683                              | 0,16                      |
| 2,400 % éch. 20/03/2045                             |       | 338 000                             | 1 755                            | 0,41                      |
|                                                     |       |                                     | 19 423                           | 4,50                      |
| Total Japon                                         |       |                                     | 27 234                           | 6,31                      |
| KAZAKHSTAN                                          |       |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |       |                                     |                                  |                           |
| KazMunayGas National Co. JSC                        |       |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 14/04/2033                             | \$    | 1 550                               | 1 407                            | 0,33                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |       |                                     |                                  |                           |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                  |       |                                     |                                  |                           |
| 18,400 % éch. 16/10/2028                            | KZT   | 221 000                             | 481                              | 0,11                      |
| Total Kazakhstan                                    |       |                                     | 1 888                            | 0,44                      |
| KOWEÏT                                              |       |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït |       |                                     |                                  |                           |
| 4,016 % éch. 09/10/2028                             | \$    | 1 100                               | 1 086                            | 0,25                      |
| 4,136 % éch. 09/10/2030                             |       | 500                                 | 491                              | 0,11                      |
| 4,652 % éch. 09/10/2035                             |       | 100                                 | 98                               | 0,02                      |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (g)                         | 1 100 | 1 098                               | 0,26                             |                           |
| Total Koweït                                        |       |                                     | 2 773                            | 0,64                      |
| ACTIONS                                             |       |                                     |                                  |                           |
| LUXEMBOURG                                          |       |                                     |                                  |                           |
| ACTIONS ORDINAIRES                                  |       |                                     |                                  |                           |
| DrillCo Holding Lux S.A. (g)                        |       | 16 048                              | 368                              | 0,08                      |
| Foresea Holding S.A.                                |       | 6 700                               | 153                              | 0,04                      |
|                                                     |       |                                     | 521                              | 0,12                      |
| VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                 |       |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |       |                                     |                                  |                           |
| Chile Electricity Lux MPC SARL                      |       |                                     |                                  |                           |
| 6,010 % éch. 20/01/2033                             | \$    | 860                                 | 888                              | 0,21                      |
| FORESEA Holding S.A.                                |       |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/06/2030                             |       | 284                                 | 280                              | 0,06                      |
|                                                     |       |                                     | 1 168                            | 0,27                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |       |                                     |                                  |                           |
| Eagle Funding Luxco SARL                            |       |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                             |       | 2 400                               | 2 413                            | 0,56                      |
| Total Luxembourg                                    |       |                                     | 4 102                            | 0,95                      |
| MALAISIE                                            |       |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |       |                                     |                                  |                           |
| Petronas Capital Ltd.                               |       |                                     |                                  |                           |
| 2,480 % éch. 28/01/2032                             |       | 500                                 | 447                              | 0,10                      |
| 3,500 % éch. 21/04/2030                             |       | 200                                 | 192                              | 0,05                      |
| 4,550 % éch. 21/04/2050                             |       | 200                                 | 175                              | 0,04                      |
| 4,800 % éch. 21/04/2060                             |       | 200                                 | 177                              | 0,04                      |
|                                                     |       |                                     | 991                              | 0,23                      |



| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien |                                     |                                  |                           |
| 2,632 % éch. 15/04/2031                             | MYR 2 100                           | \$ 498                           | 0,12                      |
| 3,519 % éch. 20/04/2028                             | 4 621                               | 1 140                            | 0,26                      |
| 4,762 % éch. 07/04/2037                             | 1 000                               | 267                              | 0,06                      |
|                                                     |                                     | <b>1 905</b>                     | <b>0,44</b>               |
| Total Malaisie                                      |                                     | <b>2 896</b>                     | <b>0,67</b>               |

|                                                    |         |              |             |
|----------------------------------------------------|---------|--------------|-------------|
| <b>MEXIQUE</b>                                     |         |              |             |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |         |              |             |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain |         |              |             |
| 4,490 % éch. 25/05/2032                            | € 1 800 | 2 094        | 0,49        |
| 5,850 % éch. 02/07/2032                            | \$ 900  | 910          | 0,21        |
| 6,625 % éch. 29/01/2038                            | 800     | 821          | 0,19        |
| Total Mexique                                      |         | <b>3 825</b> | <b>0,89</b> |

|                                                    |         |       |      |
|----------------------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>MAROC</b>                                       |         |       |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |         |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement marocain |         |       |      |
| 3,875 % éch. 02/04/2029                            | € 2 600 | 2 994 | 0,69 |

|                                      |        |     |      |
|--------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>MULTINATIONALES</b>               |        |     |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |     |      |
| Preferred Term Securities Ltd.       |        |     |      |
| 4,329 % éch. 23/06/2035              | \$ 353 | 344 | 0,08 |

|                                      |          |              |             |
|--------------------------------------|----------|--------------|-------------|
| <b>PAYS-BAS</b>                      |          |              |             |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |          |              |             |
| Achmea Bank NV                       |          |              |             |
| 2,750 % éch. 15/09/2032              | € 900    | 1 014        | 0,24        |
| ASN Bank NV                          |          |              |             |
| 3,000 % éch. 26/03/2031              | 1 100    | 1 258        | 0,29        |
| ENEL Finance International NV        |          |              |             |
| 3,375 % éch. 23/07/2028              | 500      | 577          | 0,13        |
| ING Groep NV                         |          |              |             |
| 4,000 % éch. 12/02/2035              | 300      | 351          | 0,08        |
| Prosus NV                            |          |              |             |
| 3,257 % éch. 19/01/2027              | \$ 1 600 | 1 585        | 0,37        |
|                                      |          | <b>4 785</b> | <b>1,11</b> |

|                                                                                                |       |              |             |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|--------------|-------------|
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |       |              |             |
| Jubilee Place BV                                                                               |       |              |             |
| 3,107 % éch. 17/03/2062                                                                        | € 843 | 965          | 0,22        |
| Total Pays-Bas                                                                                 |       | <b>5 750</b> | <b>1,33</b> |

|                                                         |         |     |      |
|---------------------------------------------------------|---------|-----|------|
| <b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>                                 |         |     |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |         |     |      |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais |         |     |      |
| 1,500 % éch. 15/05/2031                                 | NZD 200 | 102 | 0,02 |

|                              |         |     |      |
|------------------------------|---------|-----|------|
| <b>NORVÈGE</b>               |         |     |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b> |         |     |      |
| Kommunalbanken A/S           |         |     |      |
| 1,900 % éch. 19/01/2027      | AUD 400 | 273 | 0,06 |

|                                              |           |       |      |
|----------------------------------------------|-----------|-------|------|
| <b>PÉROU</b>                                 |           |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>         |           |       |      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |           |       |      |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                     | PEN 7 867 | 2 538 | 0,59 |

|                                                    |           |               |             |
|----------------------------------------------------|-----------|---------------|-------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |           |               |             |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien |           |               |             |
| 5,375 % éch. 08/02/2035                            | \$ 500    | 505           | 0,12        |
| 5,875 % éch. 08/08/2054 (h)                        | 900       | 898           | 0,21        |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                            | PEN 3 900 | 1 239         | 0,29        |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                            | 5 400     | 1 667         | 0,39        |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                            | 12 800    | 4 206         | 0,97        |
| 7,600 % éch. 12/08/2039                            | 2 400     | 756           | 0,17        |
|                                                    |           | <b>9 271</b>  | <b>2,15</b> |
| Total Pérou                                        |           | <b>11 809</b> | <b>2,74</b> |

|                                                     |            |        |      |
|-----------------------------------------------------|------------|--------|------|
| <b>PHILIPPINES</b>                                  |            |        |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |            |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement philippin |            |        |      |
| 6,250 % éch. 14/01/2036                             | PHP 21 000 | \$ 318 | 0,07 |

|                                                    |        |              |             |
|----------------------------------------------------|--------|--------------|-------------|
| <b>POLOGNE</b>                                     |        |              |             |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |        |              |             |
| Obligation internationale du gouvernement polonais |        |              |             |
| 4,875 % éch. 12/02/2030                            | \$ 900 | 911          | 0,21        |
| 5,375 % éch. 12/02/2035                            | 100    | 102          | 0,02        |
| 5,500 % éch. 04/04/2053                            | 300    | 285          | 0,07        |
| Total Pologne                                      |        | <b>1 298</b> | <b>0,30</b> |

|                                      |         |            |             |
|--------------------------------------|---------|------------|-------------|
| <b>PORTUGAL</b>                      |         |            |             |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |         |            |             |
| Banco Espírito Santo S.A.            |         |            |             |
| 4,000 % éch. 21/01/2019 ^            | € 1 900 | 511        | 0,12        |
| 4,750 % éch. 15/01/2018 ^            | 600     | 161        | 0,04        |
| Total Portugal                       |         | <b>672</b> | <b>0,16</b> |

|                                      |        |     |      |
|--------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>QATAR</b>                         |        |     |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |        |     |      |
| QatarEnergy                          |        |     |      |
| 4,625 % éch. 23/06/2029              | \$ 400 | 397 | 0,09 |

|                                                  |     |              |             |
|--------------------------------------------------|-----|--------------|-------------|
| Obligation internationale du gouvernement qatari |     |              |             |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                          | 700 | 704          | 0,16        |
| Total Qatar                                      |     | <b>1 101</b> | <b>0,25</b> |

|                                                   |       |              |             |
|---------------------------------------------------|-------|--------------|-------------|
| <b>ROUMANIE</b>                                   |       |              |             |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                      |       |              |             |
| Obligation internationale du gouvernement roumain |       |              |             |
| 1,375 % éch. 02/12/2029 (h)                       | € 360 | 378          | 0,09        |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                           | 1 300 | 1 350        | 0,31        |
| 5,250 % éch. 10/03/2030                           | 400   | 475          | 0,11        |
| 6,625 % éch. 27/09/2029                           | 500   | 618          | 0,14        |
| Total Roumanie                                    |       | <b>2 821</b> | <b>0,65</b> |

|                                                    |          |              |             |
|----------------------------------------------------|----------|--------------|-------------|
| <b>ARABIE SAOUDITE</b>                             |          |              |             |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |          |              |             |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien |          |              |             |
| 5,125 % éch. 13/01/2028                            | \$ 1 100 | 1 107        | 0,26        |
| 5,375 % éch. 13/01/2031                            | 600      | 613          | 0,14        |
| Total Arabie saoudite                              |          | <b>1 720</b> | <b>0,40</b> |

|                                                 |          |              |             |
|-------------------------------------------------|----------|--------------|-------------|
| <b>SERBIE</b>                                   |          |              |             |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                    |          |              |             |
| Obligation internationale du gouvernement serbe |          |              |             |
| 1,650 % éch. 03/03/2033                         | € 700    | 678          | 0,16        |
| 2,050 % éch. 23/09/2036                         | 400      | 363          | 0,08        |
| 6,000 % éch. 12/06/2034                         | \$ 1 700 | 1 744        | 0,41        |
| Total Serbie                                    |          | <b>2 785</b> | <b>0,65</b> |

|                                        |           |              |             |
|----------------------------------------|-----------|--------------|-------------|
| <b>SINGAPOUR</b>                       |           |              |             |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |           |              |             |
| CapitaLand Ascendas REIT               |           |              |             |
| 0,750 % éch. 23/06/2028                | € 1 000   | 1 092        | 0,25        |
| Standard Chartered Bank Singapore Ltd. |           |              |             |
| 2,595 % éch. 02/10/2028                | 800       | 910          | 0,21        |
| Temasek Financial Ltd.                 |           |              |             |
| 2,050 % éch. 30/07/2035                | CNY 3 500 | 512          | 0,12        |
| Total Singapour                        |           | <b>2 514</b> | <b>0,58</b> |

|                                                        |         |       |      |
|--------------------------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |         |       |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |         |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |         |       |      |
| 5,375 % éch. 24/07/2044                                | \$ 300  | 255   | 0,06 |
| 5,750 % éch. 30/09/2049                                | 200     | 170   | 0,04 |
| 6,250 % éch. 31/03/2036                                | ZAR 800 | 42    | 0,01 |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                | 48 200  | 2 965 | 0,69 |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                | 8 500   | 517   | 0,12 |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 115 300 | 7 290 | 1,69 |

|                              |           |               |             |
|------------------------------|-----------|---------------|-------------|
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>        |           |               |             |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b> |           |               |             |
| 9,000 % éch. 31/01/2040      | ZAR 4 200 | \$ 259        | 0,06        |
| 10,500 % éch. 21/12/2026     | 8 000     | 495           | 0,11        |
| Total Afrique du Sud         |           | <b>11 993</b> | <b>2,78</b> |

|                                      |       |              |             |
|--------------------------------------|-------|--------------|-------------|
| <b>CORÉE DU SUD</b>                  |       |              |             |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |       |              |             |
| KEB Hana Bank                        |       |              |             |
| 3,125 % éch. 20/01/2031              | € 900 | 1 032        | 0,24        |
| Kookmin Bank                         |       |              |             |
| 2,625 % éch. 29/09/2029              | 900   | 1 019        | 0,23        |
|                                      |       | <b>2 051</b> | <b>0,47</b> |

|                                                      |             |              |             |
|------------------------------------------------------|-------------|--------------|-------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |             |              |             |
| Korea Housing Finance Corp.                          |             |              |             |
| 3,124 % éch. 18/03/2029                              | 1 700       | 1 952        | 0,45        |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen |             |              |             |
| 1,375 % éch. 10/06/2030                              | KRW 908 220 | 534          | 0,12        |
| 2,375 % éch. 10/12/2028                              | 2 656 710   | 1 665        | 0,39        |
| 2,625 % éch. 10/06/2028                              | 3 023 160   | 1 917        | 0,45        |
|                                                      |             | <b>6 068</b> | <b>1,41</b> |
| Total Corée du Sud                                   |             | <b>8 119</b> | <b>1,88</b> |

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>ESPAGNE</b>                       |       |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |       |       |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. |       |       |      |
| 3,125 % éch. 23/06/2033              | € 900 | 1 034 | 0,24 |

|                                                    |       |              |             |
|----------------------------------------------------|-------|--------------|-------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |       |              |             |
| Communauté autonome de Catalogne                   |       |              |             |
| 4,220 % éch. 26/04/2035                            | 300   | 357          | 0,08        |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol |       |              |             |
| 3,150 % éch. 30/04/2035                            | 360   | 410          | 0,10        |
| 3,200 % éch. 31/10/2035                            | 300   | 342          | 0,08        |
| 3,450 % éch. 31/10/2034                            | 1 510 | 1 762        | 0,41        |
| 3,500 % éch. 31/05/2029                            | 1 700 | 1 989        | 0,46        |
|                                                    |       | <b>4 860</b> | <b>1,13</b> |
| Total Espagne                                      |       | <b>5 894</b> | <b>1,37</b> |

|                                      |             |       |      |
|--------------------------------------|-------------|-------|------|
| <b>SUPRANATIONALES</b>               |             |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |             |       |      |
| Banque de développement asiatique    |             |       |      |
| 6,150 % éch. 25/02/2030              | INR 252 300 | 2 574 | 0,60 |

|                              |       |              |             |
|------------------------------|-------|--------------|-------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b> |       |              |             |
| Union européenne             |       |              |             |
| 3,250 % éch. 12/12/2036      | € 100 | 114          | 0,03        |
| 3,375 % éch. 12/12/2035      | 300   | 348          | 0,08        |
| 3,625 % éch. 12/12/2040      | 200   | 228          | 0,05        |
|                              |       | <b>690</b>   | <b>0,16</b> |
| Total Supranationales        |       | <b>3 264</b> | <b>0,76</b> |

|                                      |          |              |             |
|--------------------------------------|----------|--------------|-------------|
| <b>SUISSE</b>                        |          |              |             |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |          |              |             |
| UBS AG                               |          |              |             |
| 4,302 % éch. 16/03/2029              | \$ 1 100 | 1 096        | 0,26        |
| UBS Group AG                         |          |              |             |
| 4,194 % éch. 01/04/2031              | 1 200    | 1 172        | 0,27        |
| 6,327 % éch. 22/12/2027              | 300      | 302          | 0,07        |
| 7,000 % éch. 30/09/2027              | £ 300    | 400          | 0,09        |
| UBS Switzerland AG                   |          |              |             |
| 3,146 % éch. 21/06/2031              | € 1 400  | 1 602        | 0,37        |
| Total Suisse                         |          | <b>4 572</b> | <b>1,06</b> |

|                                                       |            |       |      |
|-------------------------------------------------------|------------|-------|------|
| <b>THAÏLANDE</b>                                      |            |       |      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                          |            |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais |            |       |      |
| 2,700 % éch. 17/06/2040                               | THB 93 088 | 2 875 | 0,67 |

|                                          |          |       |      |
|------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>               |          |       |      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |          |       |      |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |          |       |      |
| 4,375 % éch. 02/10/2031                  | \$ 2 100 | 2 054 | 0,48 |
| 4,500 % éch. 06/05/2030                  | 300      | 297   | 0,07 |
| 5,000 % éch. 06/05/2035                  | 500      | 493   | 0,11 |

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Abu Dhabi Future Energy Co. PJSC Masdar<br>4,875 % éch. 25/07/2033                           | \$ 1 800                            | \$ 1 772                         | 0,41                      | London Wall Mortgage Capital PLC<br>4,738 % éch. 15/05/2057                  | £ 611                               | \$ 813                           | 0,19                      | RAAC Trust<br>5,263 % éch. 25/09/2047                                     | \$ 306                              | \$ 312                           | 0,07                      |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>5,125 % éch. 29/06/2031                                            | 400                                 | 399                              | 0,09                      | Polaris PLC<br>4,554 % éch. 27/10/2069                                       | 796                                 | 1 057                            | 0,24                      | Residential Asset Mortgage Products Trust<br>4,403 % éch. 25/01/2036      | 240                                 | 224                              | 0,05                      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,789 % éch. 03/06/2031                                         | 1 100                               | 1 102                            | 0,26                      | Resloc UK PLC<br>4,026 % éch. 15/12/2043                                     | 299                                 | 391                              | 0,09                      | 4,813 % éch. 25/09/2035                                                   | 1 300                               | 1 205                            | 0,28                      |
| MDGH GMTN RSC Ltd.<br>5,500 % éch. 28/04/2033                                                | 200                                 | 205                              | 0,05                      | RMAC PLC<br>4,947 % éch. 15/02/2047                                          | 783                                 | 1 040                            | 0,24                      | Residential Asset Securities Corp. Trust<br>4,323 % éch. 25/04/2036       | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
|                                                                                              |                                     | 6 322                            | 1,47                      | RMAC Securities PLC<br>4,036 % éch. 12/06/2044                               | 328                                 | 429                              | 0,10                      | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust<br>4,263 % éch. 25/05/2036 | 351                                 | 188                              | 0,04                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                        |                                     |                                  |                           | Stratton Mortgage Funding PLC<br>4,721 % éch. 25/06/2049                     | 315                                 | 418                              | 0,10                      | 4,423 % éch. 25/08/2035                                                   | 397                                 | 310                              | 0,07                      |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033 | 1 100                               | 1 097                            | 0,25                      | Together Asset-Backed Securitisation PLC<br>4,495 % éch. 15/08/2066          | 639                                 | 848                              | 0,20                      | 4,723 % éch. 25/01/2036                                                   | 20                                  | 19                               | 0,01                      |
| Total Émirats arabes unis                                                                    |                                     | 7 419                            | 1,72                      |                                                                              |                                     | 15 332                           | 3,55                      | Soundview Home Loan Trust<br>4,323 % éch. 25/05/2036                      | 187                                 | 184                              | 0,04                      |
| ROYAUME-UNI                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                              |                                     |                                  |                           | Structured Asset Investment Loan Trust<br>4,383 % éch. 25/01/2036         | 1 469                               | 1 386                            | 0,32                      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                                   |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                        |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/08/2033                                                   | 9                                   | 9                                | 0,00                      |
| Curzon Mortgages PLC<br>4,592 % éch. 28/07/2049                                              | £ 700                               | 930                              | 0,22                      | Bon du Trésor britannique<br>0,125 % éch. 22/03/2051 (e)                     | 324                                 | 251                              | 0,06                      | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.<br>5,102 % éch. 01/04/2035 | 158                                 | 161                              | 0,04                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 22/03/2068 (e)                                                  | 183                                 | 110                              | 0,02                      |                                                                           |                                     | 17 654                           | 4,09                      |
| Anglian Water Services Financing PLC<br>5,875 % éch. 20/06/2031                              | 500                                 | 675                              | 0,16                      | 0,625 % éch. 22/11/2042 (e)                                                  | 195                                 | 203                              | 0,05                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                             |                                     |                                  |                           |
| Antofagasta PLC<br>2,375 % éch. 14/10/2030                                                   | \$ 400                              | 362                              | 0,08                      | 0,625 % éch. 22/10/2050                                                      | 1 300                               | 610                              | 0,14                      | Athene Global Funding<br>4,847 % éch. 25/03/2027                          | 800                                 | 803                              | 0,19                      |
| Barclays PLC<br>7,437 % éch. 02/11/2033                                                      | 300                                 | 334                              | 0,08                      | 1,250 % éch. 31/07/2051                                                      | 370                                 | 209                              | 0,05                      | Bank of America Corp.<br>4,640 % éch. 24/01/2031                          | 1 200                               | 1 209                            | 0,28                      |
| HSBC Holdings PLC<br>4,041 % éch. 13/03/2028                                                 | 200                                 | 199                              | 0,05                      | 4,125 % éch. 07/03/2031                                                      | 5 400                               | 7 114                            | 1,65                      | 5,288 % éch. 25/04/2034                                                   | 400                                 | 405                              | 0,09                      |
| 4,583 % éch. 19/06/2029                                                                      | 1 000                               | 997                              | 0,23                      | Total Royaume-Uni                                                            |                                     | 45 658                           | 10,58                     | 5,511 % éch. 24/01/2036                                                   | 900                                 | 919                              | 0,21                      |
| 5,597 % éch. 17/05/2028                                                                      | 400                                 | 403                              | 0,09                      | ÉTATS-UNIS                                                                   |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                           | 4 300                               | 4 389                            | 1,02                      |
| 5,887 % éch. 14/08/2027                                                                      | 400                                 | 401                              | 0,09                      | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                   |                                     |                                  |                           | Boeing Co.<br>6,259 % éch. 01/05/2027                                     | 400                                 | 405                              | 0,09                      |
| Lloyds Banking Group PLC<br>3,875 % éch. 14/05/2032                                          | € 700                               | 817                              | 0,19                      | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust<br>4,043 % éch. 25/07/2036       | \$ 73                               | 61                               | 0,02                      | Citibank N.A.<br>4,838 % éch. 06/08/2029                                  | 1 100                               | 1 109                            | 0,26                      |
| 5,250 % éch. 04/10/2030                                                                      | £ 1 200                             | 1 610                            | 0,37                      | 4,369 % éch. 25/02/2036                                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Doctors Co. An Interinsurance Exchange<br>4,500 % éch. 18/01/2032         | 100                                 | 93                               | 0,02                      |
| Nationwide Building Society<br>2,972 % éch. 16/02/2028                                       | \$ 1 300                            | 1 287                            | 0,30                      | 4,423 % éch. 25/11/2035                                                      | 20                                  | 24                               | 0,01                      | GA Global Funding Trust<br>2,250 % éch. 06/01/2027                        | 300                                 | 296                              | 0,07                      |
| NatWest Group PLC<br>5,076 % éch. 27/01/2030                                                 | 1 100                               | 1 107                            | 0,26                      | Carrington Mortgage Loan Trust<br>3,983 % éch. 25/01/2037                    | 1 100                               | 868                              | 0,20                      | Goldman Sachs Group, Inc.<br>3,500 % éch. 23/01/2033                      | € 400                               | 456                              | 0,11                      |
| NatWest Markets PLC<br>4,827 % éch. 21/03/2030                                               | 1 400                               | 1 414                            | 0,33                      | Citigroup Mortgage Loan Trust<br>4,283 % éch. 25/03/2036                     | 751                                 | 686                              | 0,16                      | 3,615 % éch. 15/03/2028                                                   | \$ 100                              | 99                               | 0,02                      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC<br>0,000 % éch. 05/04/2032 (c)                | 1 200                               | 978                              | 0,23                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>7,250 % éch. 25/10/2037               | 364                                 | 347                              | 0,08                      | 3,984 % éch. 18/12/2036                                                   | € 600                               | 688                              | 0,16                      |
| Santander UK Group Holdings PLC<br>2,469 % éch. 11/01/2028                                   | 500                                 | 494                              | 0,11                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>3,903 % éch. 25/08/2037 | 671                                 | 597                              | 0,14                      | 5,218 % éch. 23/04/2031                                                   | \$ 900                              | 909                              | 0,21                      |
| 6,534 % éch. 10/01/2029                                                                      | 1 300                               | 1 335                            | 0,31                      | 3,963 % éch. 25/06/2047                                                      | 821                                 | 724                              | 0,17                      | 5,536 % éch. 28/01/2036                                                   | 800                                 | 813                              | 0,19                      |
| 7,482 % éch. 29/08/2029                                                                      | £ 1 000                             | 1 394                            | 0,32                      | 4,043 % éch. 25/06/2047                                                      | 184                                 | 170                              | 0,04                      | 5,727 % éch. 25/04/2030                                                   | 1 500                               | 1 538                            | 0,36                      |
| Skipston Building Society<br>3,250 % éch. 18/06/2029                                         | € 1 200                             | 1 381                            | 0,32                      | 4,223 % éch. 25/04/2047                                                      | 1 090                               | 1 006                            | 0,23                      | JPMorgan Chase & Co.<br>3,588 % éch. 23/01/2036                           | € 800                               | 905                              | 0,21                      |
| Standard Chartered PLC<br>2,608 % éch. 12/01/2028                                            | \$ 600                              | 594                              | 0,14                      | 4,283 % éch. 25/12/2036                                                      | 2 059                               | 1 958                            | 0,45                      | 5,012 % éch. 23/01/2030                                                   | \$ 800                              | 806                              | 0,19                      |
| TP ICAP Finance PLC<br>2,625 % éch. 18/11/2028                                               | £ 400                               | 501                              | 0,11                      | First Franklin Mortgage Loan Trust<br>4,483 % éch. 25/11/2035                | 77                                  | 72                               | 0,02                      | Morgan Stanley<br>3,149 % éch. 07/11/2031                                 | € 700                               | 790                              | 0,18                      |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % éch. 15/04/2032                                          | € 1 300                             | 1 310                            | 0,30                      | First NLC Trust<br>3,833 % éch. 25/08/2037                                   | 338                                 | 168                              | 0,04                      | 3,749 % éch. 07/11/2036                                                   | 700                                 | 790                              | 0,18                      |
| Yorkshire Building Society<br>3,000 % éch. 16/04/2031                                        | 2 900                               | 3 306                            | 0,77                      | GSAMP Trust<br>4,063 % éch. 25/12/2046                                       | 162                                 | 80                               | 0,02                      | 3,790 % éch. 21/03/2030                                                   | 1 000                               | 1 160                            | 0,27                      |
|                                                                                              |                                     | 20 899                           | 4,84                      | 4,223 % éch. 25/12/2046                                                      | 81                                  | 40                               | 0,01                      | 3,955 % éch. 21/03/2035                                                   | 1 800                               | 2 087                            | 0,48                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR<br>DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX    |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/09/2036                                                      | 2 810                               | 957                              | 0,22                      | 5,656 % éch. 18/04/2030                                                   | \$ 900                              | 919                              | 0,21                      |
| Alba PLC<br>4,036 % éch. 17/03/2039                                                          | £ 509                               | 673                              | 0,16                      | Home Equity Asset Trust<br>4,858 % éch. 25/05/2035                           | 10                                  | 10                               | 0,00                      | Pacific Gas & Electric Co.<br>2,100 % éch. 01/08/2027                     | 100                                 | 97                               | 0,02                      |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC<br>4,587 % éch. 18/02/2068                                 | 1 700                               | 2 255                            | 0,52                      | HSI Asset Securitization Corp. Trust<br>4,103 % éch. 25/12/2036              | 185                                 | 45                               | 0,01                      | 3,950 % éch. 01/12/2047                                                   | 100                                 | 73                               | 0,02                      |
| 4,596 % éch. 18/12/2066                                                                      | 752                                 | 999                              | 0,23                      | 4,378 % éch. 25/01/2036                                                      | 2 120                               | 2 041                            | 0,47                      | 4,000 % éch. 01/12/2046                                                   | 100                                 | 75                               | 0,02                      |
| Atlas Funding PLC<br>4,586 % éch. 20/09/2061                                                 | 434                                 | 577                              | 0,13                      | Massachusetts Educational Financing Authority<br>4,880 % éch. 25/04/2038     | 13                                  | 12                               | 0,00                      | 4,500 % éch. 01/07/2040                                                   | 100                                 | 86                               | 0,02                      |
| Elstree PLC<br>4,454 % éch. 21/01/2065                                                       | 1 424                               | 1 889                            | 0,44                      | MASTR Asset-Backed Securities Trust<br>4,063 % éch. 25/08/2036               | 251                                 | 86                               | 0,02                      | 4,550 % éch. 01/07/2030                                                   | 100                                 | 98                               | 0,02                      |
| 4,475 % éch. 21/10/2065                                                                      | 682                                 | 904                              | 0,21                      | 4,183 % éch. 25/05/2037                                                      | 128                                 | 125                              | 0,03                      | PacifiCorp<br>5,300 % éch. 15/02/2031                                     | 400                                 | 406                              | 0,09                      |
| Hops Hill PLC<br>4,570 % éch. 21/06/2058 (b)                                                 | 1 700                               | 2 259                            | 0,52                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                                                      | 3 246                               | 1 052                            | 0,24                      | Philip Morris International, Inc.<br>5,125 % éch. 13/02/2031              | 400                                 | 407                              | 0,10                      |
| London Bridge Mortgages PLC<br>4,514 % éch. 20/03/2067                                       | 589                                 | 780                              | 0,18                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>3,893 % éch. 25/10/2036            | 524                                 | 472                              | 0,11                      | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                 | 2 200                               | 2 194                            | 0,51                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | 3,893 % éch. 25/01/2037                                                      | 1 697                               | 775                              | 0,18                      | Southern California Edison Co.<br>4,800 % éch. 15/03/2033                 | 700                                 | 687                              | 0,16                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/03/2037                                                      | 629                                 | 253                              | 0,06                      | Southern Co.<br>1,875 % éch. 15/09/2081                                   | € 200                               | 225                              | 0,05                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/06/2036                                                      | 1 153                               | 565                              | 0,13                      | Wells Fargo & Co.<br>3,900 % éch. 22/07/2032                              | 1 200                               | 1 399                            | 0,32                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | New Century Home Equity Loan Trust<br>4,483 % éch. 25/03/2035                | 169                                 | 172                              | 0,04                      | 4,892 % éch. 15/09/2036                                                   | \$ 1 000                            | 976                              | 0,23                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | NovaStar Mortgage Funding Trust<br>4,063 % éch. 25/09/2036                   | 168                                 | 64                               | 0,02                      | 5,211 % éch. 03/12/2035                                                   | 900                                 | 899                              | 0,21                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           | Option One Mortgage Loan Trust<br>3,903 % éch. 25/03/2037                    | 238                                 | 216                              | 0,05                      | 5,499 % éch. 23/01/2035                                                   | 600                                 | 612                              | 0,14                      |
|                                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 29 822                           | 6,91                      |

| DESCRIPTION                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX</b>                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR HONGROIS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Maricopa County, Arizona Industrial Development<br>Authority Revenue Notes, Series 2024           |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | 24,060 % éch. 20/10/2026 (c)(d) EGP                                 | 475                                 | \$ 9                             | 0,00                      |
| 7,375 % éch. 01/10/2029                                                                           | \$ 400                              | \$ 418                           | 0,10                      | 3,000 % éch. 20/07/2046 -<br>20/11/2055                        | \$ 15 193                           | \$ 13 509                        | 3,13                      | 24,651 % éch. 10/11/2026 (c)(d)                                     | 22 075                              | 414                              | 0,09                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR<br/>DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | 4,101 % éch. 20/12/2062                                        | 67                                  | 67                               | 0,01                      |                                                                     |                                     | <b>478</b>                       | <b>0,11</b>               |
| Ashford Hospitality Trust                                                                         |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,698 % éch. 15/04/2035                                                                           | 189                                 | 189                              | 0,04                      | 2,500 % éch. 01/07/2056                                        | 3 300                               | 2 818                            | 0,65                      | 6,082 % éch. 02/07/2026 (c)(d) HUF                                  | 655 000                             | 2 104                            | 0,49                      |
| Banc of America Funding Trust                                                                     |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 18 500                              | 16 610                           | 3,85                      | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,134 % éch. 20/10/2036                                                                           | 36                                  | 28                               | 0,01                      | 6,500 % éch. 01/07/2056                                        | 16 900                              | 17 510                           | 4,06                      | 21,097 % éch. 07/07/2026 (c)(d) NGN                                 | 132 500                             | 96                               | 0,02                      |
| Barclays Commercial Mortgage Securities Trust                                                     |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | 21,137 % éch. 06/10/2026 (c)(d)                                     | 47 812                              | 33                               | 0,01                      |
| 4,923 % éch. 15/07/2037                                                                           | 1 361                               | 1 325                            | 0,31                      | 3,500 % éch. 01/10/2034 -<br>01/10/2039                        | 141                                 | 135                              | 0,03                      | 21,241 % éch. 14/07/2026 (c)(d)                                     | 119 530                             | 86                               | 0,02                      |
| Chase Mortgage Finance Trust                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/11/2040 -<br>01/06/2050                        | 243                                 | 229                              | 0,05                      | 21,322 % éch. 28/07/2026 (c)(d)                                     | 57 375                              | 41                               | 0,01                      |
| 4,763 % éch. 25/07/2037                                                                           | 29                                  | 23                               | 0,01                      | 5,500 % éch. 01/07/2037 -<br>01/04/2039                        | 116                                 | 120                              | 0,03                      | 21,450 % éch. 07/07/2026 (c)(d)                                     | 165 700                             | 120                              | 0,03                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                               |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 21,480 % éch. 28/07/2026 (c)(d)                                     | 71 700                              | 51                               | 0,01                      |
| 4,133 % éch. 25/05/2035                                                                           | 13                                  | 12                               | 0,00                      | 2,500 % éch. 01/08/2056                                        | 3 600                               | 3 008                            | 0,70                      | 21,625 % éch. 11/08/2026 (c)(d)                                     | 302 000                             | 215                              | 0,05                      |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 8 290                               | 7 749                            | 1,80                      | 21,638 % éch. 11/08/2026 (c)(d)                                     | 198 800                             | 141                              | 0,03                      |
| 4,174 % éch. 20/03/2046                                                                           | 15                                  | 15                               | 0,00                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 23 200                              | 22 226                           | 5,15                      | 21,659 % éch. 25/08/2026 (c)(d)                                     | 115 900                             | 82                               | 0,02                      |
| 4,174 % éch. 20/05/2046                                                                           | 19                                  | 17                               | 0,00                      | 5,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 101 780                             | 99 914                           | 23,16                     | 21,675 % éch. 18/08/2026 (c)(d)                                     | 66 300                              | 47                               | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/03/2036                                                                           | 369                                 | 155                              | 0,04                      | 5,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 9 320                               | 9 342                            | 2,16                      | 21,690 % éch. 07/07/2026 (c)(d)                                     | 151 100                             | 110                              | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 25/05/2037                                                                           | 192                                 | 74                               | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 21,699 % éch. 25/08/2026 (c)(d)                                     | 90 700                              | 64                               | 0,02                      |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 21,702 % éch. 18/08/2026 (c)(d)                                     | 253 900                             | 180                              | 0,04                      |
| 4,383 % éch. 25/03/2035                                                                           | 182                                 | 169                              | 0,04                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 21,704 % éch. 01/09/2026 (c)(d)                                     | 90 700                              | 64                               | 0,01                      |
| GSR Mortgage Loan Trust                                                                           |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     | <b>1 330</b>                     | <b>0,31</b>               |
| 5,750 % éch. 25/02/2036                                                                           | 115                                 | 101                              | 0,02                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN</b>                                  |                                     |                                  |                           |
| HarborView Mortgage Loan Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           | 7,046 % éch. 27/01/2027 (c)(d) ZAR                                  | 19 000                              | 1 114                            | 0,26                      |
| 4,237 % éch. 19/06/2036                                                                           | 151                                 | 56                               | 0,01                      | 1,875 % éch. 15/02/2041 (h)                                    | 9 000                               | 6 247                            | 1,45                      | 7,393 % éch. 22/07/2026 (c)(d)                                      | 6 920                               | 421                              | 0,09                      |
| Lehman XS Trust                                                                                   |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 15/08/2049 (h)                                    | 1 000                               | 622                              | 0,14                      |                                                                     |                                     | <b>1 535</b>                     | <b>0,35</b>               |
| 4,283 % éch. 25/02/2046                                                                           | 148                                 | 136                              | 0,03                      | 2,375 % éch. 15/11/2049 (h)                                    | 300                                 | 191                              | 0,04                      | <b>TOTAL DES INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                          |                                     |                                  |                           |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 15/05/2052 (h)                                    | 300                                 | 208                              | 0,05                      |                                                                     |                                     | <b>10 119</b>                    | <b>2,34</b>               |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                                                           | 201                                 | 167                              | 0,04                      | 3,000 % éch. 15/02/2048 (h)                                    | 900                                 | 663                              | 0,15                      | <b>TOTAL DES VALEURS MOBILIÈRES</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/09/2036                                                                           | 236                                 | 81                               | 0,02                      | 3,000 % éch. 15/08/2048 (h)                                    | 500                                 | 367                              | 0,09                      |                                                                     |                                     | <b>\$ 648 003</b>                | <b>150,18</b>             |
| Residential Asset Securitization Trust                                                            |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/02/2049 (h)                                    | 475                                 | 347                              | 0,08                      | <b>ACTIONS</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/02/2036                                                                           | 817                                 | 511                              | 0,12                      | 3,375 % éch. 15/11/2048 (h)                                    | 2 000                               | 1 565                            | 0,36                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT<br/>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |                                     |                                  |                           |
| Sequoia Mortgage Trust                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/08/2044 (h)                                    | 5 750                               | 5 202                            | 1,21                      | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series                             |                                     |                                  |                           |
| 3,876 % éch. 20/01/2047                                                                           | 10                                  | 7                                | 0,00                      | 4,500 % éch. 15/11/2054 (h)                                    | 11 200                              | 10 428                           | 2,42                      | plc - Global Bond                                                   |                                     |                                  |                           |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/02/2050 (h)                                    | 2 700                               | 2 566                            | 0,60                      | Opportunities Fund (f)                                              | 327 056                             | 3 306                            | 0,77                      |
| 4,083 % éch. 25/10/2035                                                                           | 98                                  | 96                               | 0,02                      | 4,750 % éch. 15/05/2055 (h)                                    | 300                                 | 291                              | 0,07                      | PIMCO Select Funds plc -<br>PIMCO US Dollar Short-<br>Term Floating |                                     |                                  |                           |
| 4,161 % éch. 25/10/2036                                                                           | 52                                  | 23                               | 0,01                      | 4,875 % éch. 15/08/2045 (h)                                    | 100                                 | 99                               | 0,02                      | NAV Fund (f)                                                        | 8 613                               | 86                               | 0,02                      |
| 4,203 % éch. 25/05/2037                                                                           | 19                                  | 18                               | 0,00                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)     |                                     |                                  |                           | PIMCO Specialty Funds                                               |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust                                                       |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/07/2030 (h)                                    | 2 207                               | 2 063                            | 0,48                      | Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/07/2046                                                                           | 284                                 | 255                              | 0,06                      | 0,125 % éch. 15/07/2031 (h)                                    | 1 366                               | 1 255                            | 0,29                      | China Bond Fund (f)                                                 | 446 527                             | 6 992                            | 1,62                      |
| 4,163 % éch. 25/05/2036                                                                           | 148                                 | 125                              | 0,03                      | 0,125 % éch. 15/01/2032 (h)                                    | 4 324                               | 3 915                            | 0,91                      |                                                                     |                                     | <b>10 384</b>                    | <b>2,41</b>               |
| 4,183 % éch. 25/04/2036                                                                           | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 0,250 % éch. 15/02/2050 (h)                                    | 1 295                               | 730                              | 0,17                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,594 % éch. 19/10/2033                                                                           | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 0,500 % éch. 15/01/2028 (h)                                    | 11 068                              | 10 788                           | 2,50                      | PIMCO ETFs plc - PIMCO                                              |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           | 0,625 % éch. 15/07/2032 (h)                                    | 1 833                               | 1 699                            | 0,39                      | Advantage Euro                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/01/2036                                                                           | 114                                 | 97                               | 0,02                      | 0,750 % éch. 15/07/2028 (h)                                    | 2 255                               | 2 205                            | 0,51                      | Government Bond                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,053 % éch. 25/10/2036                                                                           | 390                                 | 335                              | 0,08                      | 1,125 % éch. 15/01/2033 (h)                                    | 4 247                               | 4 019                            | 0,93                      | UCITS ETF (f)                                                       | 147 645                             | 4 285                            | 0,99                      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                                     |                                     |                                  |                           | Billets du Trésor américain                                    |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - PIMCO                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,034 % éch. 25/12/2036                                                                           | 45                                  | 42                               | 0,01                      | 3,500 % éch. 15/02/2033 (h)                                    | 1 300                               | 1 241                            | 0,29                      | Advantage Global                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/11/2045                                                                           | 91                                  | 86                               | 0,02                      | 4,000 % éch. 29/02/2028 (h)                                    | 300                                 | 299                              | 0,07                      | Government Bond                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,144 % éch. 25/06/2042                                                                           | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,000 % éch. 15/02/2034 (h)                                    | 200                                 | 195                              | 0,04                      | UCITS ETF (f)                                                       | 230 000                             | 5 779                            | 1,34                      |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                        |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/02/2036 (h)                                    | 250                                 | 244                              | 0,06                      |                                                                     |                                     | <b>10 064</b>                    | <b>2,33</b>               |
| 6,000 % éch. 25/06/2037                                                                           | 315                                 | 291                              | 0,07                      | 4,250 % éch. 15/05/2035 (h)                                    | 300                                 | 296                              | 0,07                      | <b>TOTAL DES FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     | <b>4 444</b>                     | <b>1,03</b>               | 4,250 % éch. 15/08/2035 (h)                                    | 240                                 | 237                              | 0,05                      |                                                                     |                                     | <b>\$20 448</b>                  | <b>4,74</b>               |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     | <b>57 982</b>                    | <b>13,44</b>              |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                                               |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                               |                                     | 323 123                          | 74,89                     |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 18/09/2030 COP                                                                       | 26 065 200                          | 6 508                            | 1,51                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                               |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 24/01/2035                                                                           | 26 759 600                          | 7 622                            | 1,77                      | <b>BILLETS DE TRÉSORERIE</b>                                   |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     | <b>14 130</b>                    | <b>3,28</b>               | AutoNation, Inc                                                |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                          |                                     |                                  |                           | 4,050 % éch. 01/07/2026                                        | 1 200                               | 1 200                            | 0,28                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Fannie Mae                                                                                        |                                     |                                  |                           | Intesa Funding LLC                                             |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/03/2060                                                                           | \$ 313                              | 270                              | 0,06                      | 4,010 % éch. 28/09/2026                                        | 500                                 | 495                              | 0,11                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/01/2059                                                                           | 959                                 | 861                              | 0,20                      | 4,010 % éch. 29/09/2026                                        | 1 050                               | 1 039                            | 0,24                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,142 % éch. 25/06/2036                                                                           | 10                                  | 10                               | 0,00                      | National Bank of Kuwait SAKP                                   |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,449 % éch. 25/01/2051                                                                           | 375                                 | 377                              | 0,09                      | 4,070 % éch. 18/09/2026                                        | 1 250                               | 1 239                            | 0,29                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,778 % éch. 25/03/2055                                                                           | 756                                 | 763                              | 0,18                      | ONE Gas, Inc.                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Freddie Mac                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,030 % éch. 14/07/2026                                        | 700                                 | 699                              | 0,16                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 1,955 % éch. 15/01/2038 (a)                                                                       | 126                                 | 6                                | 0,00                      |                                                                |                                     | <b>4 672</b>                     | <b>1,08</b>               |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,114 % éch. 15/01/2038                                                                           | 126                                 | 124                              | 0,03                      | <b>BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN</b>                                 |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,578 % éch. 25/10/2054 -<br>25/04/2055                                                           | 2 736                               | 2 760                            | 0,64                      | 23,650 % éch.                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,028 % éch. 25/03/2055                                                                           | 262                                 | 265                              | 0,06                      | 13/10/2026 (c)(d) EGP                                          | 1 175                               | 22                               | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 24,000 % éch.                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 13/10/2026 (c)(d)                                              | 1 700                               | 33                               | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                       | Long  | 12/2026           | 282                | \$ (81)                           | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Long  | 09/2026           | 6                  | 2                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026           | 37                 | (40)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre           | Court | 09/2026           | 21                 | (8)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026           | 104                | 85                                | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026           | 115                | (68)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 224                | 268                               | 0,06                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 162                | (250)                             | (0,06)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 5                  | (13)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 240                | (125)                             | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026           | 72                 | (8)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026           | 64                 | (132)                             | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 49                 | 16                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 131                | 0                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 203                | 130                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 242                | 320                               | 0,07                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Court | 09/2026           | 7                  | (19)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Court | 09/2026           | 8                  | (27)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026           | 104                | 250                               | 0,06                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ 300                            | 0,07                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ 300                            | 0,07                |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG    | 1,000 %              | 20/12/2032      | € 800                            | \$ 10                             | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-44 Index à 5 ans             | (1,000) %           | 20/06/2030      | \$ 17 610                        | \$ 13                             | 0,00                |
| Indice CDX.IG-45 Index à 10 ans            | (1,000)             | 20/12/2035      | 5 291                            | (2)                               | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans            | (1,000)             | 20/06/2036      | 25 700                           | (212)                             | (0,05)              |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | (1,000)             | 20/06/2031      | € 7 300                          | (69)                              | (0,01)              |
|                                            |                     |                 |                                  | \$ (270)                          | (0,06)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 15 798                        | \$ (12)                           | (0,01)              |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 31 750                           | 79                                | 0,02                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 67                             | 0,01                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,000 %   | 17/06/2027      | £ 11 700          | \$ (119)                          | (0,03)              |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2028      | 7 200             | 11                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2028      | 54 850            | 15                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031      | 9 200             | (43)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036      | 14 000            | (150)                             | (0,03)              |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 200               | 10                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056      | 1 330             | 15                                | 0,00                |
| À payer                           | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 5,750     | 18/03/2031      | INR 771 670       | (118)                             | (0,03)              |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 17/03/2031      | ¥ 230 000         | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 19/06/2039      | 280 000           | 49                                | 0,01                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,600     | 18/12/2029      | 260 000           | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750     | 19/03/2030      | 130 000           | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/06/2030      | 130 000           | (3)                               | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 %   | 19/03/2032      | ¥ 2 020 000       | \$ (126)                          | (0,03)              |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/09/2034      | 1 436 900         | (174)                             | (0,04)              |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 19/03/2035      | 1 630 000         | (239)                             | (0,05)              |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 19/06/2044      | 862 700           | (210)                             | (0,05)              |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 17/12/2030      | 710 000           | (20)                              | 0,00                |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 17/09/2035      | 2 130 550         | (318)                             | (0,07)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2028      | 8 817 000         | (66)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/09/2054      | 238 200           | 50                                | 0,01                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/12/2054      | 30 000            | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      | 2 410 000         | 89                                | 0,02                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,250     | 17/09/2055      | 150 000           | 42                                | 0,01                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,500     | 17/12/2055      | 160 000           | 54                                | 0,01                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      | 23 035            | 85                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2031      | 11 600            | (37)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 16/09/2031      | 148 400           | (18)                              | 0,00                |
| À payer                          | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 16/09/2031      | 50 700            | 20                                | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 16/09/2031      | 103 400           | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 15/06/2027      | 3 300             | 61                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,965     | 30/11/2026      | 14 700            | 121                               | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2027      | 16 820            | (191)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      | 5 570             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,232     | 10/09/2034      | 550               | 34                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2027      | 5 900             | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031      | 20 854            | (33)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2035      | 4 600             | 29                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2055      | 170               | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 4 050             | 72                                | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,460     | 30/06/2027      | 12 400            | (109)                             | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2028      | 3 220             | (43)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2031      | 19 230            | 315                               | 0,07                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/06/2033      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055      | 500               | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,525     | 04/09/2034      | 600               | 23                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,548     | 31/08/2030      | 800               | (11)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,557     | 31/08/2030      | 900               | (12)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,564     | 31/01/2033      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,565     | 28/08/2034      | 1 600             | 55                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,574     | 31/08/2030      | 900               | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,582     | 31/08/2030      | 1 000             | (13)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,583     | 31/08/2030      | 1 100             | (14)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,587     | 31/08/2030      | 800               | (10)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,599     | 31/08/2030      | 800               | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,600     | 28/08/2034      | 1 200             | 38                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,611     | 28/08/2034      | 200               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,637     | 31/08/2030      | 700               | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,643     | 31/08/2030      | 2 100             | (21)                              | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,649     | 31/08/2030      | 1 500             | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,655     | 31/05/2028      | 800               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,662     | 31/05/2028      | 2 300             | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,672     | 31/01/2033      | 400               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,678     | 31/01/2033      | 600               | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/05/2028      | 5 600             | 33                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/01/2033      | 700               | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,693     | 31/01/2033      | 700               | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,698     | 31/01/2033      | 500               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 31/01/2033      | 500               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,714     | 31/01/2033      | 600               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 07/08/2034      | 1 560             | 39                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 4 533             | 84                                | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,735     | 31/01/2033      | 1 200             | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 31/01/2033      | 300               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2026      | 15 300            | (100)                             | (0,02)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      | 29 100            | (284)                             | (0,07)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 3 500             | (76)                              | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 5 712             | 55                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2034      | 7 880             | (99)                              | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 4 200             | 22                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035      | 7 200             | 283                               | 0,07                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 18 800            | 483                               | 0,11                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 14 529            | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 3 500             | (72)                              | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,753     | 31/01/2033      | 1 000             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,755     | 15/02/2036      | 300               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,772     | 15/02/2055      | 500               | 36                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,773     | 04/03/2055      | 800               | 57                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,804     | 15/02/2055      | 800               | 53                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,806     | 15/02/2055      | 700               | 46                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,807     | 31/05/2028      | 400               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,836     | 15/05/2034      | 1 600             | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,847     | 15/05/2034      | 900               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,851     | 28/02/2029      | 1 500             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,860     | 15/05/2034      | 1 600             | 10                                | 0,00                |



# Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,861 %   | 15/02/2055      | \$ 100            | \$ 6                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,862     | 28/02/2029      | 3 700             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,884     | 25/03/2035      | 1 100             | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 15/08/2026      | 4 500             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 25/06/2055      | 789               | 33                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,959     | 15/11/2054      | 1 000             | 40                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 27/06/2055      | 946               | 39                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2054      | 1 200             | 40                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 1 660             | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 26/02/2035      | 800               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir(4)                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 5 200             | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 2 390             | 40                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 730               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,005     | 29/09/2055      | 374               | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,065     | 26/06/2055      | 532               | 21                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,115     | 15/11/2054      | 1 200             | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,130     | 15/11/2054      | 730               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,222     | 15/11/2052      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,224     | 15/11/2052      | 300               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,225     | 15/11/2052      | 500               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,227     | 15/11/2052      | 700               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,228     | 15/11/2052      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,232     | 15/11/2052      | 300               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,233     | 15/11/2052      | 500               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,238     | 15/11/2052      | 400               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,244     | 15/11/2052      | 400               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,245     | 15/11/2052      | 900               | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,248     | 15/11/2052      | 700               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CDI BRL à un an                   | 6,291     | 04/01/2027      | BRL 1 600         | 68                                | 0,02                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 12,970    | 02/01/2029      | 59 500            | (281)                             | (0,06)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,268    | 02/01/2029      | 66 000            | (216)                             | (0,05)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,402    | 02/01/2029      | 22 600            | (87)                              | (0,02)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,500     | 17/06/2030      | CAD 400           | 21                                | 0,01                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,750     | 16/12/2046      | 1 400             | (35)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,900     | 18/12/2029      | 3 700             | 157                               | 0,04                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | 9 200             | (25)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/09/2029      | 3 900             | 18                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/06/2033      | 400               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,880     | 01/09/2033      | 900               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      | 4 700             | (28)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2033      | 500               | (3)                               | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 18/03/2036      | 2 000             | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,180     | 01/06/2033      | 2 900             | (28)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 15/03/2033      | 1 900             | (59)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 21/06/2053      | 2 400             | 16                                | 0,00                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,000     | 18/03/2028      | CHF 13 950        | 35                                | 0,01                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 18/03/2031      | 5 100             | 29                                | 0,01                |
| À payer(4)                       | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 16/09/2031      | 4 050             | 66                                | 0,02                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,283     | 14/02/2027      | 1 700             | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,294     | 10/02/2027      | 4 400             | 27                                | 0,01                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,300     | 15/02/2027      | 1 700             | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,343     | 16/05/2027      | 1 300             | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,500     | 15/09/2026      | 900               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,665     | 18/09/2030      | COP 20 704 200    | 329                               | 0,08                |
| À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,329     | 17/12/2035      | 21 097 000        | 235                               | 0,05                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,650     | 17/12/2030      | 260 900           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,655     | 24/01/2035      | 284 800           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,695     | 07/11/2035      | 9 879 700         | (50)                              | (0,01)              |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,725     | 17/12/2030      | 127 400           | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,788     | 17/12/2030      | 254 300           | (1)                               | 0,00                |
| À payer                          | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,820     | 24/01/2035      | 4 635 400         | (13)                              | 0,00                |
| À payer                          | KORIBOR KRW à 3 mois              | 2,750     | 18/03/2036      | KRW 2 693 320     | (187)                             | (0,04)              |
| À payer(4)                       | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/12/2028      | NZD 23 800        | 58                                | 0,01                |
| À payer(4)                       | BBR NZD à 3 mois                  | 4,000     | 16/12/2031      | 5 400             | 33                                | 0,01                |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,265     | 10/01/2030      | SEK 10 200        | 7                                 | 0,00                |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,474     | 03/02/2030      | 30 400            | 30                                | 0,01                |
| À payer                          | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,500     | 18/03/2031      | 71 300            | 91                                | 0,02                |
| À payer(4)                       | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,750     | 16/09/2031      | 19 100            | 17                                | 0,00                |
| À payer(4)                       | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,300     | 08/06/2036      | ZAR 12 200        | 20                                | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 1,750     | 16/03/2027      | AUD 1 900         | (33)                              | (0,01)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,500     | 18/03/2031      | 50 000            | (1 252)                           | (0,28)              |
| À recevoir                       | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,750     | 18/03/2031      | 14 900            | (16)                              | 0,00                |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 19/03/2035      | 2 600             | (68)                              | (0,02)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 17/09/2035      | 1 200             | (42)                              | (0,01)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | 500               | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir(4)                    | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 16/09/2031      | 7 700             | (53)                              | (0,01)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 19/03/2035      | 3 100             | (63)                              | (0,01)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/06/2035      | 1 900             | (49)                              | (0,01)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 17/09/2035      | 2 500             | (78)                              | (0,02)              |
| À recevoir(4)                    | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2036      | 9 800             | (26)                              | (0,01)              |
| À recevoir(4)                    | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2056      | 400               | (6)                               | 0,00                |
| À payer(4)                       | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,485     | 02/12/2035      | CZK 58 800        | 19                                | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir                          | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,523 %   | 01/12/2035      | CZK 198 300       | \$ 72                             | 0,02                |
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,064     | 17/11/2052      | € 500             | 222                               | 0,05                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,451     | 27/05/2050      | 700               | (316)                             | (0,07)              |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 1,795     | 11/10/2029      | 900               | (22)                              | (0,01)              |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois    | 1,923     | 11/10/2029      | 3 700             | (68)                              | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,170     | 15/12/2028      | 18 600            | (60)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | 27 200            | 89                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,350     | 15/12/2028      | 19 000            | 63                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 8 350             | (111)                             | (0,03)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 26 490            | (32)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 18/03/2041      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,825     | 19/09/2055      | 13 200            | (97)                              | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 1 030             | (47)                              | (0,01)              |
| À payer                                                   | NOK-NIBOR à 6 mois      | 3,750     | 18/03/2031      | NOK 49 700        | (10)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | NOK-NIBOR à 6 mois      | 4,500     | 16/09/2031      | 2 200             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,685     | 02/12/2035      | PLN 10 500        | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,723     | 01/12/2035      | 32 000            | (56)                              | (0,01)              |
|                                                           |                         |           |                 |                   | \$ (1 725)                        | (0,39)              |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés compensés</b> |                         |           |                 |                   | <b>\$ (1 918)</b>                 | <b>(0,44)</b>       |

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

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

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

<sup>(4)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

### OPTIONS ACHETÉES

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 891                              | \$ 9  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 198                              | 1     | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre SGD hors cote  | SGD 1,315       | 05/11/2026        | 1 092                            | 8     | 3            | 0,00                |
| BPS          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 13/08/2026        | 438                              | 2     | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 2 167                            | 9     | 3            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 2 167                            | 5     | 8            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 1 697                            | 16    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 1 697                            | 13    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 63 | \$ 14        | 0,00                |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 1 310                            | \$ (17) | \$ (4)       | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 448                              | (6)     | (1)          | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 891                              | (3)     | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 198                              | (1)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre SGD hors cote | SGD 1,237       | 05/11/2026        | 1 092                            | (8)     | (1)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 2 167                            | (11)    | (22)         | (0,01)              |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 1 697                            | (5)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 1 697                            | (4)     | 0            | 0,00                |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 50                               | (1)     | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 1 700                            | (27)    | (15)         | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (83) | \$ (43)      | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.



## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %              | 20/12/2029         | \$ 700                              | \$ (23)                   | \$ 3                                    | \$ (20)         | (0,01)                 |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)                | 20/12/2030         | 1 600                               | (59)                      | 6                                       | (53)            | (0,01)                 |
|              |                                                      |                        |                    |                                     | \$ (82)                   | \$ 9                                    | \$ (73)         | (0,02)                 |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %                 | 20/12/2030         | € 100                               | \$ 23                     | \$ (2)                                  | \$ 21           | 0,01                   |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 1 500                               | 312                       | 6                                       | 318             | 0,07                   |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 100                                 | 23                        | (2)                                     | 21              | 0,01                   |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 500                                 | 104                       | 3                                       | 107             | 0,02                   |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 1 300                               | 289                       | (12)                                    | 277             | 0,06                   |
|              |                                                   |                         |                    |                                     | \$ 751                    | \$ (7)                                  | \$ 744          | 0,17                   |

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

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

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

### SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                           | À payer                                                                                                 | Date<br>d'échéanc<br>e | Montant<br>notionnel<br>de la devise<br>reçue | Montant<br>notionnel<br>de la devise<br>livrée | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|-----------------------------------------------|------------------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| CBK          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,357 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027             | \$ 19 939                                     | ¥ 2 990 900                                    | \$ 155                    | \$ 17                                   | \$ 172          | 0,04                   |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032             | 972                                           | 153 500                                        | 4                         | 7                                       | 11              | 0,01                   |
| FAR          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032             | 4 330                                         | 684 200                                        | 23                        | 29                                      | 52              | 0,01                   |
| GLM          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,301 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR GBP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 15/10/2045             | 4 358                                         | £ 3 277                                        | (1)                       | 8                                       | 7               | 0,00                   |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,315 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027             | 15 058                                        | ¥ 2 334 000                                    | (35)                      | 8                                       | (27)            | 0,00                   |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,425 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031             | 8 980                                         | 1 320 000                                      | 12                        | 53                                      | 65              | 0,01                   |
|              |                                                                                                                      |                                                                                                         |                        |                                               |                                                | \$ 158                    | \$ 122                                  | \$ 280          | 0,07                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable      | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois       | 1,500 %   | 17/03/2032      | CNY 9 400         | \$ (12)                | \$ 13                            | \$ 1         | 0,00                |
| BPS          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois       | 1,500     | 17/03/2032      | 41 200            | (52)                   | 57                               | 5            | 0,00                |
| JPM          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois       | 1,500     | 17/03/2032      | 4 860             | (3)                    | 4                                | 1            | 0,00                |
| SCX          | À recevoir                       | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 5,960     | 11/02/2029      | COP 15 800        | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
|              | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois       | 1,500     | 17/03/2032      | CNY 4 140         | (3)                    | 3                                | 0            | 0,00                |
|              |                                  |                              |           |                 |                   | \$ (70)                | \$ 78                            | \$ 8         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                 | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------------|----------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | À recevoir         | Indice SIBCSORA Index | S/O                        | 3,375 %       | SGD 40            | 26/08/2026      | \$ 0                   | \$ 1                             | \$ 1         | 0,00                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |                | Plus-value latente |    | (Moins-value) latente |   | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|----------------|--------------------|----|-----------------------|---|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 1 655      | \$                | 1 184          | \$                 | 37 | \$                    | 0 | \$                                      | 37                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | CAD             | 45         |                   | 32             |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 394        |                   | 58             |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 800      |                   | 1 063          |                    | 39 |                       | 0 |                                         | 39                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | \$              | 947        |                   | 1 676          |                    | 7  |                       | 0 |                                         | 7                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 1 676      |                   | \$ 948         |                    | 0  | (7)                   |   | (7)                                     |                     | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 32         |                   | CAD 45         |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 52         |                   | \$ 10          |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 090      |                   | 110            |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 318        |                   | CNY 2 176      |                    | 2  |                       | 0 |                                         | 2                   | 0,00   |
| BOA          | 07/2026           |                 | 126        | ¥                 | 20 035         |                    | 0  | (3)                   |   | (3)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 44         | KRW               | 66 527         |                    | 0  | (1)                   |   | (1)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 517        | NOK               | 4 791          |                    | 0  | (32)                  |   | (32)                                    |                     | (0,01) |
|              | 08/2026           | HKD             | 925        | \$                | 118            |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 538        |                   | 181            |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 847        |                   | 48             |                    | 0  |                       | 0 |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 246        | COP               | 951 727        | 26                 |    | 0                     |   | 26                                      |                     | 0,01   |
|              | 09/2026           |                 | 838        | INR               | 79 656         |                    | 0  | (2)                   |   | (2)                                     |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 250        | MXN               | 4 387          |                    | 0  | (1)                   |   | (1)                                     |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 785        | PHP               | 48 380         | 1                  |    | 0                     |   | 1                                       |                     | 0,00   |
| BPS          | 10/2026           | HUF             | 29 714     | €                 | 81             |                    | 0  | (3)                   |   | (3)                                     |                     | 0,00   |
|              | 01/2027           | ZAR             | 18 214     | \$                | 1 108          | 15                 |    | 0                     |   | 15                                      |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 072      |                   | 207            | 1                  |    | (1)                   |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 166        |                   | 120            | 3                  |    | 0                     |   | 3                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 291        |                   | 370            | 9                  |    | 0                     |   | 9                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNY             | 2 183      |                   | 320            | 0                  |    | (1)                   |   | (1)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 3 278      |                   | 3 721          | 0                  |    | (27)                  |   | (27)                                    |                     | (0,01) |
|              | 07/2026           | £               | 1 811      |                   | 2 402          | 3                  |    | (5)                   |   | (2)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 40 453 927 |                   | 2 257          | 2                  |    | (1)                   |   | 1                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 818        |                   | 277            | 3                  |    | 0                     |   | 3                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 73 956     |                   | 770            | 0                  |    | (11)                  |   | (11)                                    |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 177 327    |                   | 116            | 2                  |    | 0                     |   | 2                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 840        |                   | 85             | 1                  |    | 0                     |   | 1                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 10 559     |                   | 322            | 4                  |    | 0                     |   | 4                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | TWD             | 1 195      |                   | 38             | 0                  |    | 0                     |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 440        |                   | AUD 639        | 2                  |    | 0                     |   | 2                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 610        |                   | BRL 3 147      | 0                  |    | (2)                   |   | (2)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 9 186      |                   | CNH 62 164     | 0                  |    | (28)                  |   | (28)                                    |                     | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 599        |                   | CNY 4 085      | 1                  |    | 0                     |   | 1                                       |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 468        |                   | CZK 9 735      | 0                  |    | (9)                   |   | (9)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 887      |                   | INR 274 822    | 16                 |    | (4)                   |   | 12                                      |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 34         |                   | ¥ 5 470        | 0                  |    | (1)                   |   | (1)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 537        |                   | KRW 823 382    | 0                  |    | (5)                   |   | (5)                                     |                     | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 293      |                   | TWD 103 936    | 0                  |    | (32)                  |   | (32)                                    |                     | (0,01) |
|              | 07/2026           | ZAR             | 9 301      | \$                | 567            | 0                  |    | 0                     |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 08/2026           | CZK             | 2 497      | €                 | 102            | 0                  |    | 0                     |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 145        | \$                | 49             | 0                  |    | 0                     |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 08/2026           | TWD             | 957 502    |                   | 30 430         | 428                |    | 0                     |   | 428                                     |                     | 0,10   |
|              | 08/2026           | \$              | 4 493      |                   | INR 427 466    | 4                  |    | 0                     |   | 4                                       |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             | 959 105    | \$                | 261            | 0                  |    | (12)                  |   | (12)                                    |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 8 924 405  |                   | 492            | 0                  |    | (2)                   |   | (2)                                     |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 641        |                   | 187            | 0                  |    | 0                     |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 9 493      |                   | 293            | 5                  |    | 0                     |   | 5                                       |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 2 373      |                   | IDR 42 064 272 | 3                  |    | (45)                  |   | (42)                                    |                     | (0,01) |
|              | 09/2026           |                 | 379        |                   | INR 35 964     | 0                  |    | (1)                   |   | (1)                                     |                     | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 60         |                   | THB 1 961      | 0                  |    | 0                     |   | 0                                       |                     | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 405        |                   | IDR 7 373 359  | 1                  |    | 0                     |   | 1                                       |                     | 0,00   |

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |            | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 01/2027           | \$              | 19 462     | TWD               | 611 002    | \$ 0               | \$ (393)              | \$ (393)                                | (0,09)              |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 036      | \$                | 350        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 2 974      |                   | 732        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 614      |                   | 1 546      | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | TRY             | 4 605      |                   | 96         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 237        | CAD               | 330        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 632        | CNH               | 4 273      | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 416      | TRY               | 211 702    | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 49 721     | \$                | 3 042      | 30                 | (17)                  | 13                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 250        | INR               | 23 777     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 12/2026           | ZAR             | 3 337      | \$                | 190        | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 182        | ¥                 | 28 987     | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 640      | NZD               | 2 903      | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 2 903      | \$                | 1 642      | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 2 860 700  |                   | 783        | 0                  | (33)                  | (33)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | \$              | 349        | BRL               | 1 791      | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 02/2027           | PEN             | 3 015      | \$                | 867        | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 03/2027           |                 | 778        |                   | 225        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 2 222      |                   | 327        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 668        |                   | 779        | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | ILS             | 912        |                   | 314        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 50 535     |                   | 536        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 285      |                   | 139        | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 866        | CNH               | 5 857      | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 79         | CNY               | 544        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 288        | DKK               | 1 848      | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 344        | €                 | 300        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 248      | HUF               | 381 597    | 0                  | (23)                  | (23)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 436        | IDR               | 7 826 264  | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 522        | INR               | 50 535     | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 164        | KRW               | 247 275    | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 68         | KZT               | 36 584     | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 755        | PEN               | 2 573      | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 421        | PLN               | 1 538      | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 043      | SEK               | 46 600     | 0                  | (230)                 | (230)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 150      | TWD               | 36 371     | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 072      | VND               | 28 683 182 | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 070      | \$                | 368        | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 422 231    |                   | 4 505      | 63                 | 0                     | 63                                      | 0,02                |
|              | 08/2026           | TWD             | 181 336    |                   | 5 725      | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 109        | ILS               | 325        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 39         | KZT               | 20 320     | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP             | 5 409 345  | \$                | 6 033      | 163                | 0                     | 163                                     | 0,04                |
|              | 09/2026           | IDR             | 35 672 010 |                   | 1 976      | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 4 815      |                   | 50         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 3 863      |                   | 1 133      | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 11 398     |                   | 344        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 289      | COP               | 4 518 009  | 2                  | (4)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 510        | IDR               | 9 093 842  | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 156        | MXN               | 2 783      | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 10         | PEN               | 36         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 356        |                   | 1 231      | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 12 391     | \$                | 3 545      | 0                  | (66)                  | (66)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | \$              | 1 540      | IDR               | 27 986 775 | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN             | 7 539      | \$                | 2 228      | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR             | 1 079 503  |                   | 60         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 127 128    |                   | 1 346      | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 2 573      |                   | 761        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 493      | CNH               | 10 093     | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 505        | CZK               | 10 520     | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 898        | INR               | 86 656     | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 329        | KZT               | 176 979    | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 669        | NOK               | 6 212      | 0                  | (41)                  | (41)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 420        | PLN               | 1 560      | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 24 139     | \$                | 1 476      | 18                 | (12)                  | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 9 988 198  |                   | 554        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 356        | IDR               | 6 460 784  | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 346      | INR               | 127 990    | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2          | PEN               | 7          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 5 311      | \$                | 1 556      | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| FAR          | 12/2026           | ZAR             | 5 564      |                   | 316        | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 274 443    |                   | 40 348     | 0                  | (83)                  | (83)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | €               | 2 168      |                   | 2 473      | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 8 073      |                   | 10 856     | 142                | 0                     | 142                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | INR             | 88 230     |                   | 935        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 499 382    |                   | 3 086      | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 27 798     |                   | 2 865      | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 5 886      |                   | 4 614      | 63                 | 0                     | 63                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 9 141      | CNH               | 61 844     | 0                  | (30)                  | (30)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 925        | INR               | 88 230     | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| 07/2026      |                   | 52              | ¥          | 8 330             | 0          | (1)                | (1)                   | 0,00                                    |                     |
| 07/2026      |                   | 1 954           | PLN        | 7 173             | 0          | (46)               | (46)                  | (0,01)                                  |                     |
| 07/2026      | ZAR               | 30 429          | \$         | 1 844             | 0          | (10)               | (10)                  | 0,00                                    |                     |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 08/2026           | ILS 323         | \$ 113            | \$ 4               | \$ 0                  | \$ 4                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 2 082       | 616               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 40 348       | CNH 273 840       | 80                 | 0                     | 80                                      | 0,02                |
|              | 08/2026           | 2 476           | € 2 168           | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3 086           | ¥ 498 075         | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 865           | SEK 27 748        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 1 032 340   | \$ 284            | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 452          | INR 43 291        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 126             | MXN 2 230         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN 1 324       | \$ 384            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 4 371       | 3 072             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 23 349      | 74                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 173 748     | 113               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 51          | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 15 543       | BRL 83 891        | 682                | (16)                  | 666                                     | 0,15                |
|              | 07/2026           | 945             | CNH 6 396         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 413             | IDR 7 405 718     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 113             | KRW 173 724       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 203             | PLN 754           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 847             | RON 3 836         | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 715           | TRY 81 384        | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3 072           | CAD 4 365         | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 300             | INR 28 795        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 937 824     | \$ 263            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 7 449 086   | 413               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 555         | 32                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 44 356      | 1 375             | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$ 1 574        | IDR 28 272 504    | 3                  | (10)                  | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 388           | INR 133 517       | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
| IND          | 09/2026           | 168             | MXN 2 931         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 95              | CZK 2 000         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 516             | DKK 3 305         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 7 164       | \$ 5 107          | 144                | 0                     | 144                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | BRL 86 566      | 16 822            | 97                 | 0                     | 97                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | HUF 825         | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | ILS 2 626       | 880               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 73 235      | 776               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 53 690      | 35                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 17 432      | 1 761             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 165         | 97                | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 709        | CNH 11 538        | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 766           | HUF 1 151 950     | 0                  | (67)                  | (67)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 64              | IDR 1 149 107     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 231             | ILS 685           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 776             | INR 73 235        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 52              | KRW 80 246        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 852           | PLN 6 748         | 0                  | (57)                  | (57)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 236             | THB 7 891         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 3 649       | \$ 225            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK 6 564       | € 269             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 3 437       | \$ 439            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 633       | 559               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 761        | NOK 17 440        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | BRL 1 199       | \$ 232            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 1 155 492   | 64                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 2 097       | 119               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 36 435      | 1 117             | 16                 | (2)                   | 14                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 494        | INR 142 300       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 9 543           | MXN 165 832       | 0                  | (113)                 | (113)                                   | (0,03)              |
|              | 09/2026           | 695             | THB 22 667        | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | 16 822          | BRL 88 472        | 0                  | (97)                  | (97)                                    | (0,02)              |
|              | 12/2026           | MXN 618         | \$ 35             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 1 023        | MXN 18 055        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 30          | \$ 21             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 1 193       | 1 491             | 15                 | (3)                   | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 6 689       | 1 020             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 4 903         | 5 696             | 90                 | 0                     | 90                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | IDR 101 661     | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 127 631     | 1 352             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 5 622       | 566               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 16 975      | 1 744             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 127        | AUD 4 532         | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 053           | CHF 825           | 0                  | (31)                  | (31)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 7 870           | € 6 907           | 37                 | (10)                  | 27                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 936             | £ 700             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 084           | INR 200 858       | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 825             | ¥ 131 221         | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 755             | KRW 1 145 081     | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 664           | NOK 15 463        | 0                  | (103)                 | (103)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 11              | SEK 103           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 4 532       | \$ 3 125          | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD 756 744     | 23 933            | 221                | 0                     | 221                                     | 0,05                |
|              | 08/2026           | \$ 1 020        | DKK 6 677         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MYI          | 08/2026           | \$ 566          | NOK 5 624         | \$ 2               | \$ 0                  | \$ 2                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | SEK 16 945        | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 6 580       | \$ 197            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 814        | INR 268 701       | 9                  | (5)                   | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 57            | \$ 66             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 344          | CHF 275           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 269             | € 232             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 549             | ¥ 87 600          | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 21              | KZT 11 369        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | 40 428          | TWD 1 265 343     | 0                  | (937)                 | (937)                                   | (0,22)              |
|              | 07/2026           | 384             | IDR 6 854 878     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 107           | INR 202 723       | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 415             | TRY 19 534        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| RYL          | 09/2026           | IDR 6 893 322   | \$ 384            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 312          | IDR 5 551 991     | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 167             | € 145             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 668             | £ 499             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT 11 395      | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 946          | CNH 6 392         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7               | CNY 48            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | 824             | £ 613             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 149             | IDR 2 665 281     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 773           | INR 265 823       | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | HKD 3 243       | \$ 415            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 746          | INR 71 522        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 7 888 538   | \$ 437            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 17 640      | 545               | 11                 | (1)                   | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 850          | IDR 15 269 308    | 1                  | (5)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 24              | KZT 11 676        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 73              | THB 2 403         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 49 304        | \$ 57 515         | 1 147              | 0                     | 1 147                                   | 0,27                |
|              | 07/2026           | \$ 2 537        | AUD 3 677         | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15 709          | CNH 106 266       | 0                  | (54)                  | (54)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 540             | DKK 3 469         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 60 072          | € 52 811          | 307                | 0                     | 307                                     | 0,07                |
| SSB          | 07/2026           | 1 371           | ¥ 217 801         | 0                  | (31)                  | (31)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 4 552           | SGD 5 895         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 3 677       | \$ 2 536          | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 52 800        | 60 142            | 0                  | (307)                 | (307)                                   | (0,07)              |
|              | 08/2026           | SGD 5 882       | 4 552             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 40          | 28                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 135         | 171               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 140        | CAD 4 329         | 0                  | (88)                  | (88)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 10 508          | £ 7 949           | 43                 | 0                     | 43                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | COP 16 903 221  | \$ 4 432          | 0                  | (420)                 | (420)                                   | (0,10)              |
| UAG          | 08/2026           | £ 7 949         | 10 507            | 0                  | (43)                  | (43)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 28           | CAD 40            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 127           | \$ 170            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 144          | CHF 115           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 331             | £ 250             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 428             | PLN 1 564         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 869         | \$ 50             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 1 267       | 39                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 320        | CLP 1 174 665     | 0                  | (45)                  | (45)                                    | (0,01)              |
|              | 10/2026           | HUF 3 439       | € 9               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | 140 940         | 391               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 333          | COP 1 299 493     | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 500             | CHF 403           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 402         | \$ 500            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 726           | \$ (4 080)            | \$ 646                                  | 0,15                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 452         | \$ 323            | \$ 10              | \$ 0                  | \$ 10                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 199         | 117               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 19           | CAD 27            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 101             | NZD 178           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 27          | \$ 19             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | NZD 178         | 101               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 8 597         | 54                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 541         | 58                | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | ¥ 29 080        | 183               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | NZD 288         | 171               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ¥ 154 102       | 969               | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 174          | NZD 309           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 309         | \$ 175            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| CBK          | 07/2026           | DKK 569         | \$ 89             | \$ 2               | \$ 0                  | \$ 2                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 5 459       | \$ 591            | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 94           | € 81              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | NOK 1 344       | \$ 145            | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 2 288         | 3 077             | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ¥ 3 574         | 22                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 4 405        | ¥ 712 769         | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 335             | SEK 3 249         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 710 903       | \$ 4 405          | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | SEK 3 244       | 335               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 847        | CAD 2 629         | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 2 625       | \$ 1 847          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | DKK 1 018       | 159               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 1 956       | 1 394             | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 4 250        | CHF 3 322         | 0                  | (132)                 | (132)                                   | (0,03)              |
| JPM          | 07/2026           | 385             | NOK 3 808         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 3 810       | \$ 385            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 8           | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | ¥ 143 592       | 904               | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | NOK 3 194       | 344               | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 920          | AUD 1 334         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 31 475          | CHF 24 653        | 0                  | (912)                 | (912)                                   | (0,21)              |
|              | 07/2026           | 314             | DKK 2 060         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 124             | NOK 1 228         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 204             | SEK 1 984         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 334       | 920               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 2 056       | 314               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | NOK 1 229       | 124               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 1 981       | 204               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 10 778      | 13 322            | 0                  | (39)                  | (39)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | DKK 1 068       | 166               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 15 295        | 17 842            | 355                | 0                     | 355                                     | 0,08                |
|              | 07/2026           | ¥ 373 911       | 2 354             | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 747          | AUD 1 082         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 17 306          | € 15 214          | 88                 | 0                     | 88                                      | 0,02                |
|              | 08/2026           | AUD 1 082       | \$ 746            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | € 15 214        | 17 330            | 0                  | (88)                  | (88)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 13 322       | CHF 10 739        | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD 2 702       | \$ 1 960          | 55                 | 0                     | 55                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 17           | CAD 24            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 29 790          | CHF 23 417        | 0                  | (760)                 | (760)                                   | (0,18)              |
|              | 07/2026           | 3 025           | £ 2 288           | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 24          | \$ 17             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 2 288         | 3 025             | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 25 323      | 31 365            | 0                  | (29)                  | (29)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 31 365       | CHF 25 233        | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 887             | \$ (2 012)            | \$ (1 125)                              | (0,26)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 1 308       | \$ 935            | \$ 29              | \$ 0                  | \$ 29                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | NZD 500         | 296               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 54           | CAD 77            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 254             | NZD 449           | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 77          | \$ 54             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 449         | 254               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | ¥ 24 412        | 153               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 533       | 166               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 108 995       | 684               | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$ 45 675       | € 39 205          | 0                  | (851)                 | (851)                                   | (0,20)              |
|              | 07/2026           | NZD 727         | \$ 430            | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 437 582       | 2 752             | 60                 | 0                     | 60                                      | 0,01                |
| BSH          | 07/2026           | \$ 440          | NZD 778           | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 778         | \$ 440            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 1 348       | 210               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 36            | 42                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 15 582      | 1 686             | 76                 | 0                     | 76                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 1 271        | € 1 090           | 0                  | (25)                  | (25)                                    | (0,01)              |
| DUB          | 07/2026           | NOK 3 807       | \$ 410            | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 6 492         | 8 730             | 114                | 0                     | 114                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | ¥ 10 150        | 64                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 12 672       | ¥ 2 050 366       | 0                  | (57)                  | (57)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 956             | SEK 9 274         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 2 045 000     | \$ 12 672         | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,01                |
| GLM          | 08/2026           | SEK 9 258       | 956               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 240        | CAD 7 457         | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 7 446       | \$ 5 240          | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | DKK 2 410       | 376               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | AUD 5 662       | \$ 4 036          | \$ 114             | \$ 0                  | \$ 114                                  | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$ 1 090        | NOK 10 787        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 10 791      | \$ 1 090          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 24          | 17                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 1 983       | 2 533             | 74                 | 0                     | 74                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | € 39 594        | 44 971            | 1                  | (297)                 | (296)                                   | (0,07)              |
|              | 07/2026           | ¥ 407 738       | 2 566             | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | NOK 9 048       | 976               | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 4 754        | AUD 6 889         | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 744             | DKK 4 879         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 822           | € 1 570           | 0                  | (27)                  | (27)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 350             | NOK 3 479         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 582             | SEK 5 664         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 6 889       | \$ 4 751          | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 4 870       | 744               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 3 480       | 350               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 5 654       | 582               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 46 755       | € 41 103          | 301                | 0                     | 301                                     | 0,07                |
| SOG          | 07/2026           | DKK 2 531       | \$ 394            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 79 507        | 90 440            | 0                  | (461)                 | (461)                                   | (0,11)              |
|              | 07/2026           | ¥ 1 061 743     | 6 683             | 150                | 0                     | 150                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | \$ 72           | AUD 104           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 90 141          | € 77 272          | 0                  | (1 795)               | (1 795)                                 | (0,42)              |
|              | 08/2026           | AUD 104         | \$ 72             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 90 562       | € 79 507          | 460                | 0                     | 460                                     | 0,11                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 7 665       | \$ 5 559          | 156                | 0                     | 156                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | \$ 48           | CAD 68            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 582           | £ 6 492           | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 68          | \$ 48             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 6 492         | 8 581             | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,01)              |
| WST          | 07/2026           | \$ 2 454        | CHF 1 982         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 1 974       | \$ 2 454          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 899           | \$ (3 600)            | \$ (1 701)                              | (0,39)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (partiellement couverte) de Capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 354         | \$ 253            | \$ 8               | \$ 0                  | \$ 8                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 134         | 79                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 15           | CAD 22            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 68              | NZD 120           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 22          | \$ 15             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 120         | 68                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | ¥ 6 835         | 43                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 18 241       | NOK 168 875       | 0                  | (1 175)               | (1 175)                                 | (0,27)              |
| BPS          | 07/2026           | ¥ 23 119        | \$ 145            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 113          | € 99              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | NZD 195         | \$ 115            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ¥ 122 511       | 771               | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 118          | NZD 208           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 208         | 118               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | DKK 338         | 53                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 3 930       | 425               | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,01                |
| DUB          | 07/2026           | \$ 17 677       | NOK 164 243       | 0                  | (1 079)               | (1 079)                                 | (0,25)              |
| FAR          | 07/2026           | £ 1 837         | \$ 2 470          | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ¥ 2 842         | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 502        | ¥ 566 649         | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 241             | SEK 2 339         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 565 166       | \$ 3 502          | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 2 335       | 241               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | \$ 1 483        | CAD 2 110         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 2 107       | \$ 1 483          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | DKK 604         | 94                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 1 531       | 1 091             | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | NOK 178 462     | 18 029            | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 18 029       | NOK 178 540       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 6           | \$ 5              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 477         | 609               | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 114 155       | 718               | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 228 890     | 23 032            | 0                  | (99)                  | (99)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$ 720          | AUD 1 044         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 187             | DKK 1 223         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 195             | € 170             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15 476          | NOK 143 551       | 0                  | (969)                 | (969)                                   | (0,22)              |
|              | 07/2026           | 147             | SEK 1 428         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 044       | \$ 720            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 1 221       | 187               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 1 426       | 147               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | \$ 23 032       | NOK 228 988       | 99                 | 0                     | 99                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | 219             | 2 084             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | DKK             | 634               | \$ 2               | \$ 0                  | \$ 2                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 11 894            | 276                | 0                     | 276                                     | 0,06                |
|              | 07/2026           | ¥               | 297 258           | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 584               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 337            | 68                 | 0                     | 68                                      | 0,02                |
|              | 08/2026           | AUD             | 847               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 11 724            | 0                  | (68)                  | (68)                                    | (0,02)              |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 2 169             | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 99                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 14                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 428             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 19                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 1 837             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 113               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           |                 | 590               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 474               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 730             | \$ (3 443)            | \$ (2 713)                              | (0,63)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (3 962) (0,92)

## DESCRIPTION

## AUTRES ACTIFS FINANCIERS

Credit Suisse AG AT1 Claim

| VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| \$ 300                        | \$ 106                     | 0,02                |
| \$ 106                        |                            | 0,02                |

Total des Autres actifs financiers

## TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

## AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN

Ginnie Mae, TBA

3,000 % éch. 01/07/2056

2 500 (2 219) (0,51)

Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA

2,000 % éch. 01/07/2041

6 700 (6 104) (1,42)

2,000 % éch. 01/08/2056

31 650 (25 271) (5,86)

3,000 % éch. 01/08/2056

1 200 (1 046) (0,24)

3,500 % éch. 01/08/2056

2 000 (1 813) (0,42)

6,000 % éch. 01/09/2056

7 800 (7 942) (1,84)

Total des Titres vendus à découvert

\$ (44 395) (10,29)

Total des Investissements

\$ 618 582 143,36

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (187 105) (43,36)

Actif net

\$ 431 477 100,00

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,08 %) :

| Description de l'émetteur                                    | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| DrillCo Holding Lux S.A.                                     | 08/06/2023   | \$ 321   | \$ 368       | 0,08                |
| Kuwait Government International Bond 4,804 % éch. 20/04/2033 | 13/04/2026   | 1 100    | 1 098        | 0,26                |
|                                                              |              | \$ 1 421 | \$ 1 466     | 0,34                |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 58 854 \$ (31 décembre 2025 : 52 159 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 384 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 10 936 \$ (31 décembre 2025 : 9 295 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 6 530 \$ (31 décembre 2025 : 730 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 627 467                                           | \$ 20 536                                         | \$ 648 003        |
| Fonds d'investissement                        | 20 448                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 20 448            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (119)                                                                             | (5 461)                                              | 0                                                 | (5 580)           |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 106                                                  | 0                                                 | 106               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (44 395)                                             | 0                                                 | (44 395)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 20 329</b>                                                                  | <b>\$ 577 717</b>                                    | <b>\$ 20 536</b>                                  | <b>\$ 618 582</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 678 011                                           | \$ 5 334                                          | \$ 683 345        |
| Fonds d'investissement                        | 16 769                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 16 769            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 013                                                                             | (554)                                                | 11                                                | 470               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 89                                                   | 0                                                 | 89                |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (37 228)                                             | 0                                                 | (37 228)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 17 782</b>                                                                  | <b>\$ 640 318</b>                                    | <b>\$ 5 345</b>                                   | <b>\$ 663 445</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance          | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BRC                                           | 1,950 %        | 17/06/2026        | À définir <sup>(1)</sup> | € (315)          | \$ (360)                                 | (0,08)              |
|                                               | 2,050          | 17/06/2026        | À définir <sup>(1)</sup> | (278)            | (318)                                    | (0,07)              |
| BSN                                           | 3,720          | 09/06/2026        | 15/07/2026               | \$ (809)         | (811)                                    | (0,19)              |
| CIB                                           | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026               | (55 290)         | (55 444)                                 | (12,85)             |
| DEU                                           | 3,730          | 29/06/2026        | 06/07/2026               | (303)            | (303)                                    | (0,07)              |
|                                               | 3,740          | 22/06/2026        | 06/07/2026               | (536)            | (537)                                    | (0,12)              |
|                                               | 3,740          | 29/06/2026        | 06/07/2026               | (194)            | (194)                                    | (0,04)              |
|                                               | 3,750          | 29/06/2026        | 06/07/2026               | (410)            | (410)                                    | (0,10)              |
| JPS                                           | 3,670          | 29/06/2026        | 06/07/2026               | (249)            | (249)                                    | (0,06)              |
|                                               | 3,720          | 22/06/2026        | 06/07/2026               | (293)            | (293)                                    | (0,07)              |
| MYI                                           | 3,600          | 12/12/2025        | À définir <sup>(1)</sup> | (202)            | (207)                                    | (0,05)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                          |                  | <b>\$ (59 126)</b>                       | <b>(13,70)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 141                                                     | \$ 0                    | \$ 141                            | \$ 3                                                       | \$ 0                    | \$ 3                              |
| BOA          | (1 134)                                                    | 1 190                   | 56                                | 43                                                         | 0                       | 43                                |
| BPS          | (599)                                                      | 800                     | 201                               | (415)                                                      | 380                     | (35)                              |
| BRC          | 140                                                        | 0                       | 140                               | 198                                                        | 0                       | 198                               |
| BSH          | 42                                                         | 0                       | 42                                | (90)                                                       | 220                     | 130                               |
| CBK          | 342                                                        | 0                       | 342                               | (2)                                                        | 90                      | 88                                |
| DUB          | (1 052)                                                    | 990                     | (62)                              | (52)                                                       | 0                       | (52)                              |
| FAR          | 368                                                        | (560)                   | (192)                             | (126)                                                      | 0                       | (126)                             |
| GLM          | 738                                                        | (640)                   | 98                                | 557                                                        | (660)                   | (103)                             |
| GST          | 107                                                        | 0                       | 107                               | 73                                                         | 0                       | 73                                |
| IND          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 7                                                          | 0                       | 7                                 |
| JPM          | 247                                                        | (270)                   | (23)                              | 658                                                        | (740)                   | (82)                              |
| MBC          | (1 418)                                                    | 1 580                   | 162                               | 366                                                        | (440)                   | (74)                              |
| MYC          | (73)                                                       | 0                       | (73)                              | (80)                                                       | 0                       | (80)                              |
| MYI          | (957)                                                      | 770                     | (187)                             | 19                                                         | 30                      | 49                                |
| NSL          | 31                                                         | 0                       | 31                                | 65                                                         | 0                       | 65                                |
| RYL          | (7)                                                        | 0                       | (7)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 29                                                         | 0                       | 29                                | 97                                                         | 0                       | 97                                |
| SOG          | 143                                                        | 0                       | 143                               | 436                                                        | (530)                   | (94)                              |
| SSB          | (1 009)                                                    | 1 200                   | 191                               | 67                                                         | 0                       | 67                                |
| UAG          | (43)                                                       | 0                       | (43)                              | (179)                                                      | 0                       | (179)                             |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (1)                                                        | 10                      | 9                                 |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 31,98            | 33,93                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 26,35            | 25,45                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 2,10             | 0,71                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,91             | 1,47                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,10             | 0,11                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,44             | 0,50                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,87             | 0,56                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Autres actifs                                                    | 36,24            | 37,26                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Argentine                                                                                             | 0,05             | 0,05                 |
| Australie                                                                                             | 6,59             | 5,94                 |
| Belgique                                                                                              | 0,45             | 0,45                 |
| Bésil                                                                                                 | 1,12             | S/O                  |
| Bulgarie                                                                                              | 0,28             | 0,31                 |
| Canada                                                                                                | 1,95             | 3,43                 |
| Îles Caïmans                                                                                          | 2,98             | 2,41                 |
| Chili                                                                                                 | 1,43             | 1,70                 |
| Chine                                                                                                 | 2,21             | 2,22                 |
| Colombie                                                                                              | 1,74             | 3,04                 |
| Costa Rica                                                                                            | 0,42             | 0,41                 |
| République tchèque                                                                                    | 0,59             | 0,35                 |
| Danemark                                                                                              | 0,19             | 0,08                 |
| République dominicaine                                                                                | S/O              | 0,47                 |
| Équateur                                                                                              | 0,15             | S/O                  |
| Égypte                                                                                                | 0,33             | 0,22                 |
| Finlande                                                                                              | 0,11             | 0,11                 |
| France                                                                                                | 4,65             | 6,33                 |
| Guatemala                                                                                             | 0,29             | 0,28                 |
| Hongrie                                                                                               | 1,02             | 1,13                 |
| Inde                                                                                                  | 0,26             | 0,26                 |
| Indonésie                                                                                             | 0,32             | 0,56                 |
| Irlande                                                                                               | 4,21             | 3,12                 |
| Israël                                                                                                | 1,53             | 1,53                 |
| Italie                                                                                                | 0,76             | 0,95                 |
| Côte d'Ivoire                                                                                         | 0,62             | 0,61                 |
| Japon                                                                                                 | 6,31             | 6,76                 |
| Kazakhstan                                                                                            | 0,44             | 0,42                 |
| Koweït                                                                                                | 0,64             | 0,54                 |
| Luxembourg                                                                                            | 0,95             | 0,95                 |
| Malaisie                                                                                              | 0,67             | 0,66                 |
| Mexique                                                                                               | 0,89             | 0,89                 |
| Maroc                                                                                                 | 0,69             | S/O                  |
| Multinationales                                                                                       | 0,08             | 0,10                 |
| Pays-Bas                                                                                              | 1,33             | 1,50                 |
| Nouvelle-Zélande                                                                                      | 0,02             | 0,37                 |
| Norvège                                                                                               | 0,06             | 0,59                 |
| Pérou                                                                                                 | 2,74             | 2,35                 |
| Philippines                                                                                           | 0,07             | 0,08                 |
| Pologne                                                                                               | 0,30             | 0,38                 |
| Portugal                                                                                              | 0,16             | 0,16                 |
| Qatar                                                                                                 | 0,25             | S/O                  |
| Roumanie                                                                                              | 0,65             | 1,42                 |
| Arabie saoudite                                                                                       | 0,40             | 1,00                 |
| Sénégal                                                                                               | S/O              | 0,19                 |
| Serbie                                                                                                | 0,65             | 1,30                 |
| Singapour                                                                                             | 0,58             | 0,58                 |
| Afrique du Sud                                                                                        | 2,78             | 2,36                 |
| Corée du Sud                                                                                          | 1,88             | 1,71                 |
| Espagne                                                                                               | 1,37             | 2,20                 |
| Supranationales                                                                                       | 0,76             | 0,67                 |
| Suisse                                                                                                | 1,06             | 1,74                 |
| Thaïlande                                                                                             | 0,67             | 0,57                 |
| Émirats arabes unis                                                                                   | 1,72             | 1,12                 |
| Royaume-Uni                                                                                           | 10,58            | 10,51                |
| États-Unis                                                                                            | 74,89            | 76,17                |
| Instruments à court terme                                                                             | 2,34             | 1,45                 |
| Fonds d'investissement                                                                                | 4,74             | 3,80                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | 0,07             | 0,21                 |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O              | (0,01)               |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,06)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,39)           | (0,47)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,02                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,02)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O              | 0,02                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,17             | 0,07                 |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | 0,07             | 0,03                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,15             | (0,18)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,28)           | 0,45                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,02             | 0,02                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (10,29)          | (8,43)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (43,36)          | (50,19)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                                     |                                     |                                  |                           | <b>CANADA</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>SANDS CHINA LTD.</b>                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>5,400 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Bank of Queensland Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           | Bank of Nova Scotia                                                                           |                                     |                                  |                           | 08/08/2028                                                             | \$ 9 500                            | \$ 9 575                         | 0,05                      |
| 3,300 % éch. 30/07/2029                                                                       | € 18 000                            | \$ 20 744                        | 0,12                      | 3,084 % éch. 17/06/2030                                                                       | € 38 500                            | \$ 44 324                        | 0,25                      | Suci Second Investment Co.                                             |                                     |                                  |                           |
| Commonwealth Bank of Australia                                                                |                                     |                                  |                           | Canadian Imperial Bank of Commerce                                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch.                                                           |                                     |                                  |                           |
| 2,907 % éch. 11/11/2030                                                                       | 24 000                              | 27 410                           | 0,16                      | 2,625 % éch. 01/10/2029                                                                       | 26 100                              | 29 621                           | 0,17                      | 25/10/2028                                                             | 29 600                              | 30 354                           | 0,17                      |
| Lonsdale Finance Pty. Ltd.                                                                    |                                     |                                  |                           | Fairfax Financial Holdings Ltd.                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     | 398 177                          | 2,26                      |
| 5,500 % éch. 19/11/2031 AUD                                                                   | 10 800                              | 7 487                            | 0,04                      | 2,750 % éch. 29/03/2028                                                                       | 12 300                              | 13 975                           | 0,08                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| Macquarie Bank Ltd.                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,696 % éch. 06/08/2031                                                                       | \$ 41 500                           | 41 321                           | 0,23                      | <b>KSA Sukuk Ltd.</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,778 % éch. 25/02/2030                                                                       | € 22 500                            | 25 560                           | 0,14                      | 4,969 % éch. 02/08/2030                                                                       | 8 000                               | 8 064                            | 0,05                      | <b>5,268 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Westpac Banking Corp.                                                                         |                                     |                                  |                           | Toronto-Dominion Bank                                                                         |                                     |                                  |                           | 25/10/2028                                                             | 8 500                               | 8 606                            | 0,05                      |
| 3,038 % éch. 01/03/2030                                                                       | 4 900                               | 5 631                            | 0,03                      | 2,582 % éch. 16/02/2027                                                                       | € 36 610                            | 41 901                           | 0,24                      | <b>RAK Capital</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,131 % éch. 15/04/2031                                                                       | 43 800                              | 50 398                           | 0,29                      | 3,191 % éch. 16/02/2029                                                                       | 41 400                              | 47 750                           | 0,27                      | <b>5,000 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     | 137 230                          | 0,78                      | 4,347 % éch. 11/06/2029                                                                       | £ 30 300                            | 40 362                           | 0,23                      | <b>12/03/2035 (j)</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | 4,814 % éch. 16/07/2027                                                                       | \$ 39 200                           | 39 444                           | 0,22                      | 24 500                                                                 | 24 724                              | 0,14                             |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     | 306 762                          | 1,74                      |                                                                        |                                     | 33 330                           | 0,19                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>CHILI</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>Household Capital RMBS</b>                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>Real Estate Asset Liquidity Trust</b>                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 20/07/2086 AUD                                                                   | 17 126                              | 11 930                           | 0,07                      | 3,650 % éch. 12/08/2053                                                                       | CAD 2 843                           | 2 003                            | 0,01                      | <b>Obligation internationale du gouvernement chilien</b>               |                                     |                                  |                           |
| 7,581 % éch. 20/07/2086                                                                       | 3 800                               | 2 647                            | 0,01                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>4,850 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                                                              |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement canadien</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>22/01/2029</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>2,000 % éch. 01/06/2028</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>13 300</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| 30/12/2057 (a)                                                                                | 237 245                             | 163 826                          | 0,93                      | <b>3,000 % éch. 01/06/2034</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>13 422</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,713 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>3,250 % éch. 01/12/2033</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>CHINE</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| 30/12/2057 (a)                                                                                | 13 368                              | 9 240                            | 0,05                      | <b>4,000 % éch. 01/03/2029</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,863 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>Obligation à rendement réel du gouvernement canadien</b>                                   |                                     |                                  |                           | <b>Banque de développement chinoise</b>                                |                                     |                                  |                           |
| 30/12/2057 (a)                                                                                | 9 407                               | 6 502                            | 0,04                      | <b>1,500 % éch.</b>                                                                           |                                     |                                  |                           | <b>2,630 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,163 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>01/12/2044 (d)</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | <b>08/01/2034 CNY</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| 30/12/2057 (a)                                                                                | 4 984                               | 3 445                            | 0,02                      | <b>11 334</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>2,820 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,563 % éch.                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>7 813</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>22/05/2033</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 30/12/2057 (a)                                                                                | 3 596                               | 2 486                            | 0,01                      | <b>0,750 % éch. 02/02/2037</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>1 647 150</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     | 200 076                          | 1,13                      | <b>€ 2 200</b>                                                                                |                                     |                                  |                           | <b>261 142</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>CPPIB Capital, Inc.</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement chinois</b>               |                                     |                                  |                           |
| <b>Obligation internationale du gouvernement australien</b>                                   |                                     |                                  |                           | <b>Exportation et Développement Canada</b>                                                    |                                     |                                  |                           | <b>1,920 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 21/06/2051                                                                       | 16 900                              | 6 017                            | 0,03                      | <b>4,500 % éch. 28/01/2030</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>15/01/2055</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 21/05/2030                                                                       | 17 800                              | 11 520                           | 0,06                      | <b>7,130 % éch. 11/03/2029</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>2,190 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| New South Wales Treasury Corp.                                                                |                                     |                                  |                           | <b>INR 0</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>25/09/2054</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 20/03/2034                                                                       | 153 250                             | 83 728                           | 0,48                      | <b>Ontario Teachers' Finance Trust</b>                                                        |                                     |                                  |                           | <b>3,190 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 08/03/2033                                                                       | 51 200                              | 29 553                           | 0,17                      | <b>0,900 % éch. 20/05/2041</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>15/04/2053</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| Queensland Treasury Corp.                                                                     |                                     |                                  |                           | <b>Province de Colombie Britannique</b>                                                       |                                     |                                  |                           | <b>61 240</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 20/08/2032                                                                       | 35 700                              | 20 339                           | 0,12                      | <b>4,150 % éch. 18/06/2034</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>844 078</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 20/07/2034                                                                       | 45 000                              | 24 243                           | 0,14                      | <b>Province de l'Ontario</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>COLOMBIE</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 22/08/2033                                                                       | 11 482                              | 6 526                            | 0,04                      | <b>0,010 % éch. 25/11/2030</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 22/08/2035                                                                       | 68 000                              | 44 564                           | 0,25                      | <b>4,150 % éch. 02/06/2034</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>TES colombien</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 21/07/2036                                                                       | 102 900                             | 70 810                           | 0,40                      | <b>Province du Québec</b>                                                                     |                                     |                                  |                           | <b>11,000 % éch.</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| Treasury Corp. of Victoria                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>3,600 % éch. 01/09/2033</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>22/08/2029 COP</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 17/09/2035                                                                       | 74 300                              | 39 115                           | 0,22                      | <b>4,450 % éch. 01/09/2034</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>11,750 % éch.</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                                                                       | 45 500                              | 22 128                           | 0,13                      | <b>82 400</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>24/01/2035</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 15/09/2033                                                                       | 148 150                             | 85 317                           | 0,48                      | <b>28 487</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>12,750 % éch.</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 20/11/2034                                                                       | 37 100                              | 20 564                           | 0,12                      | <b>669 879</b>                                                                                |                                     |                                  |                           | <b>28/11/2040</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 20/12/2032                                                                       | 36 700                              | 24 463                           | 0,14                      | <b>978 644</b>                                                                                |                                     |                                  |                           | <b>13,250 % éch.</b>                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     | 488 887                          | 2,78                      | <b>Total Canada</b>                                                                           |                                     |                                  |                           | <b>09/02/2033</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| Total Australie                                                                               |                                     | 826 193                          | 4,69                      | <b>ILES CAÏMANS</b>                                                                           |                                     |                                  |                           | <b>179 282 400</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>BELGIQUE</b>                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | <b>Total Colombie</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>BlueMountain CLO Ltd.</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>COSTA RICA</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| ING Belgium S.A.                                                                              |                                     |                                  |                           | <b>5,015 % éch. 15/07/2031</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/02/2031                                                                       | € 27 000                            | 30 968                           | 0,18                      | <b>Sound Point CLO Ltd.</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement costaricain</b>           |                                     |                                  |                           |
| <b>BRÉSIL</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>5,028 % éch. 26/07/2031</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>5,500 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>Valerie Asset Ltd.</b>                                                                     |                                     |                                  |                           | <b>21/11/2030</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>Obligation internationale du gouvernement brésilien</b>                                    |                                     |                                  |                           | <b>5,219 % éch.</b>                                                                           |                                     |                                  |                           | <b>€ 26 500</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 23/04/2030                                                                       | 24 100                              | 27 654                           | 0,16                      | <b>15/09/2050 (j)</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | <b>6,001 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>BULGARIE</b>                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>5,267 % éch.</b>                                                                           |                                     |                                  |                           | <b>16/01/2036</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>15/09/2050 (i)</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | <b>7 250</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>Obligation internationale du gouvernement bulgare</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>9 856</b>                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>40 653</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 18/07/2035                                                                       | 14 300                              | 15 944                           | 0,09                      | <b>78 074</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 18/07/2045                                                                       | 22 500                              | 24 720                           | 0,14                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                   |                                     |                                  |                           |
| Total Bulgarie                                                                                |                                     | 40 664                           | 0,23                      | <b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>                                                           |                                     |                                  |                           | <b>Komerční Banka A/S</b>                                              |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>2,528 % éch. 18/11/2027</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>3,250 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>Gaci First Investment Co.</b>                                                              |                                     |                                  |                           | <b>10/10/2031</b>                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>4,750 % éch. 14/02/2030</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>41 770</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>4,875 % éch. 14/05/2029</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>5,000 % éch. 29/01/2029</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>Obligation internationale du gouvernement de République tchèque</b> |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>5,250 % éch. 29/01/2030</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>2,500 % éch.</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>5,250 % éch. 14/05/2033</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>25/08/2028 CZK</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>5,250 % éch. 29/01/2034</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>2 900</b>                                                           |                                     | 133                              | 0,00                      |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>5,625 % éch. 29/07/2034</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>Total République tchèque</b>                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>QNB Finance Ltd.</b>                                                                       |                                     |                                  |                           | <b>48 306</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>4,538 % éch. 19/09/2027</b>                                                                |                                     |                                  |                           | <b>0,27</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | <b>4,875 % éch. 30/01/2029</b>                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                        |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>DANEMARK</b>                                    |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Jyske Realkredit A/S                               |                                     |                                  |                           | Dexia S.A.                                           |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 DKK 0 \$ 0 0,00            |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 3,054 % éch. 15/01/2032 € 12 737 \$ 14 567 0,08     |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2037 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 21/01/2028 (b) € 9 100 \$ 9 969 0,06                 |                                     |                                  |                           | 3,144 % éch. 15/01/2034 7 795 8 922 0,05            |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/07/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 320 244 1,82                     |                           | 3,154 % éch. 21/10/2034 10 550 12 071 0,07          |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,464 % éch. 15/10/2038 3 000 3 435 0,02            |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement français   |                                     |                                  |                           | Hayfin Emerald CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 25/02/2029 220 600 252 240 1,43         |                                     |                                  |                           | 3,054 % éch. 27/05/2034 5 004 5 726 0,03            |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 25/02/2030 353 200 402 562 2,29         |                                     |                                  |                           | 3,449 % éch. 17/11/2037 16 700 19 124 0,11          |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 654 802 3,72                     |                           | 3,454 % éch. 15/10/2038 26 700 30 552 0,17          |                                     |                                  |                           |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab               |                                     |                                  |                           | Total France                                         |                                     | 975 046 5,54                     |                           | 3,498 % éch. 18/10/2039 21 900 25 059 0,14          |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | <b>ALLEMAGNE</b>                                     |                                     |                                  |                           | Indigo Credit Management DAC                        |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2037 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                 |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/07/2038 4 800 5 496 0,03            |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Amprion GmbH                                         |                                     |                                  |                           | 3,464 % éch. 15/10/2037 3 500 4 006 0,02            |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 36 829 4 636 0,02          |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 30/09/2029 600 677 0,00                 |                                     |                                  |                           | Invesco Euro CLO DAC                                |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2037 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Commerzbank AG                                       |                                     |                                  |                           | 3,277 % éch. 15/07/2037 27 100 31 020 0,18          |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 14/01/2032 14 000 16 095 0,09           |                                     |                                  |                           | Jubilee CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2037 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Deutsche Bank AG                                     |                                     |                                  |                           | 3,164 % éch. 15/10/2035 14 500 16 590 0,09          |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 23/02/2028 5 900 6 702 0,04             |                                     |                                  |                           | Madison Park Euro Funding DAC                       |                                     |                                  |                           |
| Nykredit Realkredit A/S                            |                                     |                                  |                           | Volkswagen Financial Services AG                     |                                     |                                  |                           | 3,004 % éch. 15/07/2032 24 063 27 545 0,16          |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 3,131 % éch. 10/06/2027 8 500 9 744 0,06             |                                     |                                  |                           | Montmartre Euro CLO DAC                             |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2037 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 10/09/2026 5 900 6 757 0,04             |                                     |                                  |                           | 3,164 % éch. 15/07/2034 8 460 9 684 0,06            |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Total Allemagne                                      |                                     | 39 975 0,23                      |                           | MV Credit Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 7 432 924 0,01             |                                     |                                  |                           | <b>HONGRIE</b>                                       |                                     |                                  |                           | 3,583 % éch. 15/02/2038 10 000 11 442 0,07          |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement hongrois   |                                     |                                  |                           | 3,468 % éch. 20/10/2039 8 000 9 154 0,05            |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2036 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 25/07/2029 26 500 31 042 0,18           |                                     |                                  |                           | 3,478 % éch. 20/07/2036 7 000 8 009 0,05            |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 16/06/2034 14 900 17 838 0,10           |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 3,189 % éch. 20/05/2034 14 500 16 599 0,09          |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 26/09/2033 € 4 900 5 590 0,03         |                                     |                                  |                           | 22/03/2040 (j) 1 800 2 158 0,01                      |                                     |                                  |                           | 3,374 % éch. 15/07/2038 8 400 9 605 0,05            |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/10/2053 DKK 191 906 29 430 0,17    |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 26/03/2036 \$ 2 000 2 011 0,01          |                                     |                                  |                           | RRE Loan Management DAC                             |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/10/2053 94 652 15 076 0,08         |                                     |                                  |                           | Magyar Export-Import Bank                            |                                     |                                  |                           | 3,154 % éch. 15/01/2037 10 000 11 446 0,07          |                                     |                                  |                           |
| Realkredit Danmark A/S                             |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 16/05/2029 € 14 000 17 038 0,10         |                                     |                                  |                           | Sculptor European CLO DAC                           |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Total Hongrie                                        |                                     | 70 087 0,40                      |                           | 3,082 % éch. 10/10/2034 10 000 11 441 0,07          |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2037 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | <b>INDONÉSIE</b>                                     |                                     |                                  |                           | Tikehau CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 7 798 969 0,01             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/10/2038 17 000 19 469 0,11          |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement indonésien |                                     |                                  |                           | 3,483 % éch. 20/04/2038 10 900 12 480 0,07          |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/04/2036 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/01/2037 8 400 9 230 0,05             |                                     |                                  |                           | Toro European CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/10/2047 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | 5,600 % éch. 15/01/2035 \$ 6 700 6 826 0,04          |                                     |                                  |                           | 3,070 % éch. 12/01/2032 4 806 5 501 0,03            |                                     |                                  |                           |
| 3,437 % éch. 01/01/2038 0 0 0,00                   |                                     |                                  |                           | Total Indonésie                                      |                                     | 16 056 0,09                      |                           | 3,093 % éch. 15/02/2034 16 548 18 935 0,11          |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/10/2056 92 889 14 196 0,08         |                                     |                                  |                           | <b>IRLANDE</b>                                       |                                     |                                  |                           | 3,155 % éch. 25/07/2034 17 141 19 612 0,11          |                                     |                                  |                           |
| Total Danemark                                     |                                     | 70 821                           | 0,40                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                    |                                     |                                  |                           | 3,194 % éch. 15/07/2034 11 696 13 385 0,08          |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉGYPTE</b>                                      |                                     |                                  |                           | Anchorage Capital Europe CLO DAC                     |                                     |                                  |                           | 3,474 % éch. 15/04/2037 9 900 11 332 0,06           |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | 3,424 % éch. 15/10/2038 € 42 000 48 117 0,27         |                                     |                                  |                           | Trinitas Euro CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien |                                     |                                  |                           | Arcano Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           | 3,414 % éch. 15/07/2039 7 500 8 591 0,05            |                                     |                                  |                           |
| 19,698 % éch. 14/10/2030 EGP 70 400 1 364 0,01     |                                     |                                  |                           | 3,415 % éch. 25/07/2039 7 500 8 583 0,05             |                                     |                                  |                           | Voya Euro CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| 21,954 % éch. 04/03/2028 1 673 600 33 024 0,19     |                                     |                                  |                           | Ares European CLO DAC                                |                                     |                                  |                           | 3,174 % éch. 15/10/2034 3 700 4 233 0,02            |                                     |                                  |                           |
| Total Égypte                                       |                                     | 34 388                           | 0,20                      | 2,984 % éch. 15/10/2031 1 965 2 247 0,01             |                                     |                                  |                           |                                                     | 558 495 3,17                        |                                  |                           |
| <b>FRANCE</b>                                      |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 20/04/2032 5 289 6 051 0,03             |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | Aurium CLO DAC                                       |                                     |                                  |                           | AerCap Ireland Capital DAC                          |                                     |                                  |                           |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.            |                                     |                                  |                           | 2,973 % éch. 16/01/2031 11 835 13 548 0,08           |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 29/10/2026 \$ 200 199 0,00             |                                     |                                  |                           |
| 5,088 % éch. 23/01/2027 \$ 16 400 16 469 0,09      |                                     |                                  |                           | Black Diamond CLO DAC                                |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 29/10/2028 900 866 0,01                |                                     |                                  |                           |
| BNP Paribas S.A.                                   |                                     |                                  |                           | 3,263 % éch. 15/05/2032 416 476 0,00                 |                                     |                                  |                           | Iridium Capital PLC                                 |                                     |                                  |                           |
| 2,871 % éch. 19/04/2032 12 000 10 906 0,06         |                                     |                                  |                           | Blackrock European CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | 3,886 % éch. 07/03/2027 € 26 800 30 683 0,17        |                                     |                                  |                           |
| 5,786 % éch. 13/01/2033 39 600 40 920 0,23         |                                     |                                  |                           | 3,158 % éch. 20/01/2036 4 000 4 578 0,03             |                                     |                                  |                           |                                                     | 31 748 0,18                         |                                  |                           |
| BPCE S.A.                                          |                                     |                                  |                           | BNPP AM Euro CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           | Total Irlande                                       |                                     | 590 243 3,35                     |                           |
| 5,876 % éch. 14/01/2031 5 100 5 241 0,03           |                                     |                                  |                           | 3,014 % éch. 22/07/2032 11 302 12 919 0,07           |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| 6,293 % éch. 14/01/2036 5 800 6 062 0,03           |                                     |                                  |                           | Cairn CLO DAC                                        |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.          |                                     |                                  |                           | 3,170 % éch. 29/10/2034 3 000 3 434 0,02             |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.                           |                                     |                                  |                           |
| 2,875 % éch. 25/03/2031 € 23 300 26 522 0,15       |                                     |                                  |                           | Capital Four CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           | 3,197 % éch. 22/01/2032 35 500 40 233 0,23          |                                     |                                  |                           |
| CCF SFH SACA                                       |                                     |                                  |                           | 3,415 % éch. 25/10/2038 2 300 2 633 0,02             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 09/04/2029 15 400 17 406 0,10         |                                     |                                  |                           | Carlyle Euro CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement israélien |                                     |                                  |                           |
| Cie de Financement Foncier S.A.                    |                                     |                                  |                           | 3,173 % éch. 15/08/2032 604 691 0,00                 |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 17/01/2033 \$ 11 300 10 913 0,06       |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 24/04/2032 28 700 32 626 0,19         |                                     |                                  |                           | CVC Cordatus Loan Fund DAC                           |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/10/2026 € 80 700 92 889 0,53        |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 24/04/2027 54 800 62 932 0,36         |                                     |                                  |                           | 3,066 % éch. 25/04/2036 11 600 13 271 0,08           |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 12/03/2029 \$ 13 750 13 899 0,08       |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 06/06/2030 12 800 14 732 0,08         |                                     |                                  |                           | 3,285 % éch. 23/01/2039 11 500 13 167 0,08           |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 19/02/2030 10 000 10 141 0,06          |                                     |                                  |                           |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                 |                                     |                                  |                           | 3,528 % éch. 15/05/2037 5 000 5 731 0,03             |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 12/03/2034 16 600 16 851 0,10          |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/12/2030 22 900 26 256 0,15         |                                     |                                  |                           | Dryden Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 19/02/2035 21 400 21 903 0,12          |                                     |                                  |                           |
| Crédit Agricole S.A.                               |                                     |                                  |                           | 2,864 % éch. 15/04/2033 2 037 2 330 0,01             |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 12/03/2054 15 700 15 033 0,08          |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 22/01/2034 19 800 23 015 0,13         |                                     |                                  |                           | 3,143 % éch. 15/05/2034 6 515 7 449 0,04             |                                     |                                  |                           |                                                     | 181 629 1,03                        |                                  |                           |
| 5,862 % éch. 09/01/2036 \$ 26 388 27 188 0,16      |                                     |                                  |                           | 3,498 % éch. 18/10/2039 7 200 8 239 0,05             |                                     |                                  |                           | Total Israël                                        |                                     | 221 862 1,26                     |                           |

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ITALIE</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>KOWEÏT</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>CTP NV</b>                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                  |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>0,625 % éch. 27/09/2026</b>                          |                                     |                                  |                           |
| Golden Bar Securitisation SRL                      | €                                   | 17 216                           | \$                        | Obligation internationale du gouvernement du Koweït | \$                                  | 45 800                           | \$                        | ING Groep NV                                            | €                                   | 2 128                            | \$                        |
| 3,436 % éch. 22/09/2043                            |                                     | 19 796                           | 0,11                      | 4,016 % éch. 09/10/2028                             |                                     | 45 212                           | 0,26                      | 3,875 % éch. 12/08/2029                                 |                                     | 19 200                           | 22 288                    |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 4,136 % éch. 09/10/2030                             |                                     | 24 247                           | 0,14                      | 4,000 % éch. 12/02/2035                                 |                                     | 11 000                           | 12 882                    |
| AMCO - Asset Management Co. SpA                    |                                     |                                  |                           | 4,804 % éch. 20/04/2033 (i)                         |                                     | 52 100                           | 0,29                      | 5,550 % éch. 19/03/2035                                 | \$                                  | 4 000                            | 4 077                     |
| 0,750 % éch. 20/04/2028                            | 300                                 | 330                              | 0,00                      | Total Koweït                                        |                                     | 121 471                          | 0,69                      |                                                         |                                     |                                  | 74 707                    |
| 4,625 % éch. 06/02/2027                            | 17 500                              | 20 207                           | 0,12                      | <b>LUXEMBOURG</b>                                   |                                     |                                  |                           | Total Pays-Bas                                          |                                     |                                  | 90 274                    |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>              |                                     |                                  |                           | <b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| 0,875 % éch. 08/10/2027                            | 8 000                               | 9 109                            | 0,05                      | Project Fenno                                       | €                                   | 3 196                            | 0,02                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 05/09/2027                            | 12 000                              | 13 815                           | 0,08                      | 0,600 % éch. 10/07/2028 µ(i)                        | €                                   | 3 196                            | 0,02                      | Auckland Council                                        |                                     |                                  |                           |
| Intesa Sanpaolo SpA                                |                                     |                                  |                           | 4,641 % éch. 10/07/2028 (i)                         |                                     | 6 137                            | 0,04                      | 1,000 % éch. 19/01/2027                                 | €                                   | 5 800                            | 6 571                     |
| 6,625 % éch. 20/06/2033                            | \$                                  | 10 500                           | 0,06                      | 4,680 % éch. 10/07/2028 (i)                         |                                     | 2 915                            | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais |                                     |                                  | 0,04                      |
|                                                    |                                     | 54 848                           | 0,31                      | Telecom Serbia                                      |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 15/05/2031                                 | NZD                                 | 16 500                           | 8 419                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | 3,967 % éch. 11/06/2029                             | 17 397                              | 19 620                           | 0,11                      | Total Nouvelle-Zélande                                  |                                     |                                  | 14 990                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                  | €                                   | 206 300                          | 238 778                   |                                                     |                                     | 33 705                           | 0,19                      | <b>NIGERIA</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 01/04/2028                            |                                     |                                  | 1,36                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement italien  | £                                   | 5 684                            | 7 737                     | Eagle Funding Luxco SARL                            | \$                                  | 94 200                           | 0,54                      | Bank of Industry Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 04/08/2028                            |                                     |                                  | 0,04                      | 5,500 % éch. 17/08/2030                             |                                     | 94 699                           | 0,54                      | 3,895 % éch. 23/08/2027                                 | €                                   | 7 750                            | 8 841                     |
|                                                    |                                     | 246 515                          | 1,40                      | Total Luxembourg                                    |                                     | 128 404                          | 0,73                      |                                                         |                                     |                                  | 0,05                      |
| Total Italie                                       |                                     |                                  | 321 159                   | <b>MALAISIE</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>NORVÈGE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| <b>JAPON</b>                                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.               | \$                                  | 3 800                            | 3 752                     | Petronas Capital Ltd.                               |                                     |                                  |                           | Sparebanken Norge Boligkredit A/S                       |                                     |                                  |                           |
| 4,527 % éch. 12/09/2031                            |                                     | 18 000                           | 0,02                      | 2,480 % éch. 28/01/2032                             | 10 400                              | 9 289                            | 0,05                      | 2,500 % éch. 15/10/2030                                 | 15 900                              | 17 894                           | 0,10                      |
| 5,017 % éch. 20/07/2028                            |                                     | 22 500                           | 0,10                      | 3,500 % éch. 21/04/2030                             | 8 600                               | 8 275                            | 0,05                      | SR-Boligkredit A/S                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,188 % éch. 12/09/2036                            |                                     | 8 000                            | 0,13                      | 4,550 % éch. 21/04/2050                             | 6 100                               | 5 333                            | 0,03                      | 3,125 % éch. 19/02/2032                                 | 30 500                              | 35 203                           | 0,20                      |
| 5,354 % éch. 13/09/2028                            |                                     |                                  | 0,05                      | 4,800 % éch. 21/04/2060                             | 5 000                               | 4 438                            | 0,03                      |                                                         |                                     | 53 097                           | 0,30                      |
| Nomura Holdings, Inc.                              |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 27 335                           | 0,16                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| 2,329 % éch. 22/01/2027                            | 11 100                              | 10 976                           | 0,06                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | Kommunalbanken A/S                                      |                                     |                                  |                           |
| Norinchukin Bank                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement malaisien |                                     |                                  |                           | 1,900 % éch. 19/01/2027                                 | AUD                                 | 22 000                           | 15 006                    |
| 4,674 % éch. 09/09/2030                            | 1 500                               | 1 484                            | 0,01                      | 2,632 % éch. 15/04/2031                             | MYR                                 | 85 560                           | 0,11                      | Obligation internationale du gouvernement norvégien     |                                     |                                  | 0,09                      |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.                      | €                                   | 26 500                           | 27 844                    | 3,519 % éch. 20/04/2028                             |                                     | 394 244                          | 0,55                      | 1,750 % éch. 17/02/2027                                 | NOK                                 | 1 100                            | 109                       |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.              | \$                                  | 14 500                           | 14 403                    | 3,582 % éch. 15/07/2032                             |                                     | 12 630                           | 0,02                      | 2,000 % éch. 26/04/2028                                 |                                     | 7 300                            | 706                       |
| 4,954 % éch. 08/07/2033                            |                                     | 35 700                           | 0,08                      | Émission d'investissement du gouvernement malaisien |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  | 15 821                    |
| 5,520 % éch. 13/01/2028                            |                                     | 16 700                           | 0,20                      | 4,193 % éch. 07/10/2032                             |                                     | 68 050                           | 0,10                      | Total Norvège                                           |                                     |                                  | 68 918                    |
| 5,558 % éch. 09/07/2034                            |                                     |                                  | 0,10                      |                                                     |                                     | 137 984                          | 0,78                      | <b>PÉROU</b>                                            |                                     |                                  |                           |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.                    | €                                   | 34 800                           | 38 321                    | Total Malaisie                                      |                                     | 165 319                          | 0,94                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| 0,010 % éch. 15/10/2027                            |                                     | 5 000                            | 0,22                      | <b>MEXIQUE</b>                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien      |                                     |                                  |                           |
| 4,350 % éch. 11/09/2030                            | \$                                  | 14 100                           | 0,03                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                        |                                     |                                  |                           | 2,780 % éch. 01/12/2060                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,388 % éch. 11/09/2028                            |                                     |                                  | 0,08                      | Obligation internationale du gouvernement mexicain  |                                     |                                  |                           | (i)                                                     | \$                                  | 6 000                            | 3 291                     |
|                                                    |                                     | 217 761                          | 1,24                      | 4,000 % éch. 15/03/2115                             | €                                   | 800                              | 0,00                      | 3,230 % éch. 28/07/2121                                 |                                     | 4 200                            | 2 342                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 27/04/2051                             | \$                                  | 7 800                            | 0,04                      | 5,400 % éch. 12/08/2034                                 | PEN                                 | 46 600                           | 13 356                    |
| Obligation internationale du gouvernement japonais | ¥                                   | 18 145 832                       | 112 096                   | 5,850 % éch. 02/07/2032                             |                                     | 10 500                           | 0,06                      | 6,150 % éch. 12/08/2032                                 |                                     | 119 448                          | 37 940                    |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (d)                        |                                     | 6 660 000                        | 0,22                      | 6,625 % éch. 29/01/2038                             |                                     | 7 200                            | 0,04                      | 6,850 % éch. 12/08/2035                                 |                                     |                                  |                           |
| 0,400 % éch. 20/06/2029                            |                                     | 8 768 900                        | 0,21                      | Total Mexique                                       |                                     | 24 804                           | 0,14                      | (j)                                                     |                                     | 387 890                          | 119 723                   |
| 0,400 % éch. 20/06/2040                            |                                     | 10 768 000                       | 0,21                      | <b>MULTINATIONALES</b>                              |                                     |                                  |                           | 6,900 % éch. 12/08/2037                                 |                                     | 42 600                           | 12 802                    |
| 0,500 % éch. 20/09/2046                            |                                     | 10 147 000                       | 0,18                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 12/08/2031                                 |                                     | 49 601                           | 16 548                    |
| 0,500 % éch. 20/03/2049                            |                                     | 6 077 650                        | 0,11                      | Preferred Term Securities Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 7,300 % éch. 12/08/2033                                 |                                     | 505 500                          | 166 084                   |
| 0,700 % éch. 20/12/2048                            |                                     | 2 610 000                        | 0,05                      | 4,326 % éch. 22/03/2038                             | 2 074                               | 2 001                            | 0,01                      | 7,600 % éch. 12/08/2039                                 |                                     | 37 800                           | 11 908                    |
| 0,700 % éch. 20/03/2051                            |                                     | 2 610 000                        | 0,04                      | <b>PAYS-BAS</b>                                     |                                     |                                  |                           | Total Pérou                                             |                                     |                                  | 383 994                   |
| 0,700 % éch. 20/06/2051                            |                                     | 202 000                          | 0,00                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                   |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                          |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 20/03/2052                            |                                     | 70 000                           | 0,00                      | Contego CLO BV                                      | €                                   | 13 600                           | 0,09                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                           |
| 1,300 % éch. 20/06/2052                            |                                     | 1 800 000                        | 0,04                      | 3,454 % éch. 15/04/2038                             |                                     | 15 567                           | 0,09                      | Obligation internationale du gouvernement polonais      |                                     |                                  |                           |
| 1,600 % éch. 20/12/2053                            |                                     | 2 420 000                        | 0,06                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 12/02/2030                                 | \$                                  | 9 500                            | 9 613                     |
| 1,800 % éch. 20/09/2044                            |                                     | 2 858 000                        | 0,08                      | ABN AMRO Bank NV                                    |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 04/10/2033                                 |                                     | 4 900                            | 4 885                     |
| 2,000 % éch. 20/12/2044                            |                                     | 708 450                          | 0,02                      | 1,125 % éch. 12/01/2032                             | 300                                 | 312                              | 0,00                      | 5,375 % éch. 12/02/2035                                 |                                     | 6 800                            | 6 953                     |
| 2,200 % éch. 20/03/2064                            |                                     | 5 017 000                        | 0,12                      | 5,515 % éch. 03/12/2035                             | \$                                  | 7 600                            | 0,05                      | Total Pologne                                           |                                     |                                  | 21 451                    |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                            |                                     | 1 018 800                        | 0,03                      | Achmea Bank NV                                      | €                                   | 14 000                           | 0,09                      | <b>PORTUGAL</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| 2,400 % éch. 20/03/2045                            |                                     | 11 959 000                       | 0,35                      | 3,125 % éch. 11/06/2036                             |                                     | 15 849                           | 0,09                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                            |                                     | 615 000                          | 0,02                      | ASN Bank NV                                         |                                     |                                  |                           | Banco Espírito Santo S.A.                               |                                     |                                  |                           |
| 3,700 % éch. 20/03/2056                            |                                     | 4 117 600                        | 0,14                      | 3,000 % éch. 26/03/2031                             | 8 000                               | 9 150                            | 0,05                      | 4,000 % éch. 21/01/2019 ^                               | €                                   | 6 900                            | 1 854                     |
|                                                    |                                     | 445 873                          | 2,53                      |                                                     |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^                               |                                     | 1 900                            | 510                       |
| Total Japon                                        |                                     |                                  | 663 634                   |                                                     |                                     |                                  |                           | Total Portugal                                          |                                     |                                  | 2 364                     |
| <b>KAZAKHSTAN</b>                                  |                                     |                                  |                           | <b>QATAR</b>                                        |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | <b>QatarEnergy</b>                                  |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 12/07/2031                                 | \$                                  | 9 400                            | 8 360                     |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                 | KZT                                 | 4 051 500                        | 8 824                     | 3,300 % éch. 12/07/2051                             |                                     | 5 900                            | 0,02                      |                                                         |                                     |                                  | 4 044                     |
| 18,400 % éch. 16/10/2028                           |                                     |                                  | 0,05                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  | 12 404                    |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  | 0,07                      |



## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement qatari       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen                                              |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 12/10/2045                                           | € 700                               | \$ 790                           | 0,00                      |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                | \$ 48 000                           | \$ 48 258                        | 0,28                      | 1,375 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Total Qatar                                            |                                     | 60 662                           | 0,35                      | 10/06/2030                                                                                        | KRW 26 604 840                      | \$ 15 640                        | 0,09                      |                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>ROUMANIE</b>                                        |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | 10/12/2028                                                                                        | 77 823 640                          | 48 769                           | 0,28                      | Total Supranationales                                             |                                     | 173 259                          | 0,98                      |
| Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     | 214 931                          | 1,22                      |
| 1,375 % éch.                                           |                                     |                                  |                           | 10/06/2028                                                                                        | 144 280 900                         | 91 474                           | 0,52                      | <b>SUISSE</b>                                                     |                                     |                                  |                           |
| 02/12/2029 (j)                                         | € 6 560                             | 6 886                            | 0,04                      |                                                                                                   |                                     | 231 989                          | 1,32                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                                | 16 600                              | 17 244                           | 0,10                      | Total Corée du Sud                                                                                |                                     | 265 023                          | 1,51                      | UBS Group AG                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 28/01/2032                                | 1 000                               | 992                              | 0,01                      | <b>ESPAGNE</b>                                                                                    |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 02/04/2032                                           | 19 700                              | 21 960                           | 0,12                      |
| 2,125 % éch. 07/03/2028                                | 20 150                              | 22 596                           | 0,13                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                              |                                     |                                  |                           | 3,091 % éch. 14/05/2032                                           | \$ 27 800                           | 25 519                           | 0,15                      |
| 5,000 % éch. 27/09/2026                                | 4 988                               | 5 730                            | 0,03                      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                                                              |                                     |                                  |                           | 3,869 % éch. 12/01/2029                                           | 12 550                              | 12 408                           | 0,07                      |
| 5,125 % éch. 24/09/2031                                | 15 610                              | 18 255                           | 0,10                      | 3,125 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 09/06/2033                                           | € 22 500                            | 26 515                           | 0,15                      |
| 5,250 % éch. 30/05/2032                                | 17 400                              | 20 311                           | 0,11                      | 23/06/2033                                                                                        | € 20 100                            | 23 093                           | 0,13                      | 4,194 % éch. 01/04/2031                                           | \$ 11 400                           | 11 132                           | 0,06                      |
| 6,625 % éch. 27/09/2029                                | 8 700                               | 10 746                           | 0,06                      | Banco Santander S.A.                                                                              |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 07/09/2033                                           | £ 6 900                             | 10 193                           | 0,06                      |
| Total Roumanie                                         |                                     | 102 760                          | 0,58                      | 6,607 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | UBS Switzerland AG                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                 |                                     |                                  |                           | 07/11/2028                                                                                        | \$ 12 800                           | 13 378                           | 0,08                      | 3,304 % éch. 05/03/2029                                           | € 22 800                            | 26 341                           | 0,15                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     | 36 471                           | 0,21                      | Total Suisse                                                      |                                     | 134 068                          | 0,76                      |
| Saudi Arabian Oil Co.                                  |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br/>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>THAÏLANDE</b>                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 24/11/2070                                | \$ 1 600                            | 979                              | 0,01                      | Fondo de Titulización de Activos Santander Hipotecario                                            |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | 2,388 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement thaïlandais             |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien     |                                     |                                  |                           | 18/01/2049                                                                                        | € 68                                | 78                               | 0,00                      | 2,700 % éch. 17/06/2040                                           | THB3 749 587                        | 115 791                          | 0,66                      |
| 3,750 % éch. 05/03/2037                                | € 4 500                             | 5 052                            | 0,03                      | Santander Residential FT                                                                          |                                     |                                  |                           | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 18/01/2028                                | \$ 32 600                           | 32 620                           | 0,18                      | 3,088 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 13/01/2028                                | 57 800                              | 58 205                           | 0,33                      | 18/10/2068                                                                                        | 33 569                              | 38 477                           | 0,22                      | Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC                          |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     | 95 877                           | 0,54                      |                                                                                                   |                                     | 38 555                           | 0,22                      | 4,500 % éch. 06/05/2030                                           | \$ 2 800                            | 2 777                            | 0,02                      |
| Total Arabie saoudite                                  |                                     | 96 856                           | 0,55                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 06/05/2035                                           | 12 100                              | 11 925                           | 0,07                      |
| <b>SINGAPOUR</b>                                       |                                     |                                  |                           | Adif Alta Velocidad                                                                               |                                     |                                  |                           | Emirates NBD Bank PJSC                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                      |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 29/06/2031                                           | 16 700                              | 16 647                           | 0,09                      |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.               |                                     |                                  |                           | 31/01/2030                                                                                        | 1 600                               | 1 840                            | 0,01                      | First Abu Dhabi Bank PJSC                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,051 % éch. 11/04/2043                                | 3 468                               | 3 470                            | 0,02                      | Communauté autonome de Catalogne                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,789 % éch. 03/06/2031                                           | 43 200                              | 43 211                           | 0,25                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 26/04/2035                                                                                        | 3 900                               | 4 643                            | 0,03                      | MDGH GMTN RSC Ltd.                                                |                                     |                                  |                           |
| Clifford Capital Credit Solutions Pte. Ltd.            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement espagnol                                                |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 28/04/2033                                           | 7 000                               | 7 185                            | 0,04                      |
| 4,781 % éch. 14/01/2030                                | 14 600                              | 14 840                           | 0,08                      | 1,450 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                   |                                     | 81 745                           | 0,47                      |
| DBS Bank Ltd.                                          |                                     |                                  |                           | 30/04/2029                                                                                        | 16 427                              | 18 189                           | 0,10                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,209 % éch. 19/08/2026                                | € 37 900                            | 43 386                           | 0,25                      | 2,400 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                           |
| 3,989 % éch. 28/08/2028                                | \$ 5 700                            | 5 665                            | 0,03                      | 31/05/2028                                                                                        | 88 300                              | 100 587                          | 0,57                      | 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 49 800                              | 49 638                           | 0,28                      |
|                                                        |                                     | 63 891                           | 0,36                      | 30/04/2035                                                                                        | 51 826                              | 58 991                           | 0,33                      | Total Émirats arabes unis                                         |                                     | 131 383                          | 0,75                      |
| Total Singapour                                        |                                     | 67 361                           | 0,38                      | 3,200 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>ROYAUME-UNI</b>                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>SLOVAQUIE</b>                                       |                                     |                                  |                           | 31/10/2035                                                                                        | 24 900                              | 28 354                           | 0,16                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 3,450 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | Curzon Mortgages PLC                                              |                                     |                                  |                           |
| 365 bank A/S                                           |                                     |                                  |                           | 31/10/2034                                                                                        | 153 420                             | 179 057                          | 1,02                      | 4,592 % éch. 28/07/2049                                           | £ 1 300                             | 1 726                            | 0,01                      |
| 7,125 % éch. 04/07/2028                                | € 17 500                            | 20 735                           | 0,12                      | 3,500 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |                                     |                                  |                           | 31/05/2029                                                                                        | 65 500                              | 76 649                           | 0,43                      | Anglian Water Services Financing PLC                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 23/06/2036                                           | € 1 700                             | 1 946                            | 0,01                      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           | 06/04/2029                                                                                        | £ 800                               | 1 078                            | 0,01                      | Barclays PLC                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 31/03/2036                                | ZAR 245 600                         | 12 846                           | 0,07                      |                                                                                                   |                                     | 469 388                          | 2,66                      | 6,496 % éch. 13/09/2027                                           | \$ 23 600                           | 23 689                           | 0,13                      |
| 7,000 % éch. 28/02/2031                                | 308 700                             | 18 193                           | 0,10                      | Total Espagne                                                                                     |                                     | 544 414                          | 3,09                      | 8,875 % éch.                                                      |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                | 772 500                             | 47 528                           | 0,27                      | <b>SUPRANATIONALES</b>                                                                            |                                     |                                  |                           | 15/09/2027 (e)(g)                                                 | £ 4 900                             | 6 741                            | 0,04                      |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                | 187 400                             | 11 390                           | 0,07                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                              |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch.                                                      |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 31/01/2044                                | 68 700                              | 4 115                            | 0,02                      | Banque européenne d'investissement                                                                |                                     |                                  |                           | 15/09/2028 (e)(g)                                                 | 7 677                               | 10 834                           | 0,06                      |
| 8,750 % éch. 28/02/2048                                | 366 100                             | 21 971                           | 0,13                      | 4,500 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                                                 |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 3 533 900                           | 223 449                          | 1,27                      | 31/01/2028                                                                                        | 22 900                              | 30 550                           | 0,17                      | 2,848 % éch. 04/06/2031                                           | \$ 17 000                           | 15 752                           | 0,09                      |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 465 000                             | 28 700                           | 0,16                      | 4,600 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,445 % éch. 25/09/2030                                           | € 9 200                             | 10 573                           | 0,06                      |
| 10,500 % éch. 21/12/2021                               | 207 800                             | 12 865                           | 0,07                      | 30/01/2037                                                                                        | CAD 1 050                           | 767                              | 0,01                      | 3,973 % éch. 22/05/2030                                           | \$ 21 700                           | 21 175                           | 0,12                      |
| Total Afrique du Sud                                   |                                     | 381 057                          | 2,16                      | Banque interaméricaine de développement                                                           |                                     |                                  |                           | 4,041 % éch. 13/03/2028                                           | 7 300                               | 7 274                            | 0,04                      |
| <b>CORÉE DU SUD</b>                                    |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,583 % éch. 19/06/2029                                           | 19 600                              | 19 546                           | 0,11                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 14/04/2027                                                                                        | AUD 15 200                          | 10 355                           | 0,06                      | 4,755 % éch. 09/06/2028                                           | 11 200                              | 11 215                           | 0,06                      |
| KEB Hana Bank                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     | 41 672                           | 0,24                      | 4,787 % éch. 10/03/2032                                           | € 7 900                             | 9 546                            | 0,05                      |
| 3,125 % éch. 20/01/2031                                | € 28 800                            | 33 034                           | 0,19                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,210 % éch. 11/08/2028                                           | \$ 19 400                           | 19 535                           | 0,11                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | Union européenne                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,290 % éch. 16/09/2032                                           | £ 12 400                            | 16 546                           | 0,09                      |
| Korea Housing Finance Corp.                            |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,733 % éch. 02/07/2028                                | 31 700                              | 36 106                           | 0,20                      | 12/12/2036                                                                                        | € 52 800                            | 60 074                           | 0,34                      | 7,875 % éch.                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,742 % éch. 05/03/2030                                | 35 300                              | 40 000                           | 0,23                      | 3,375 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 27/06/2029 (e)(g)                                                 | 3 700                               | 5 126                            | 0,03                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 12/12/2035                                                                                        | 87 515                              | 101 498                          | 0,58                      | 8,500 % éch.                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 27/09/2027 (e)(g)                                                 | 1 200                               | 1 650                            | 0,01                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 12/12/2040                                                                                        | 9 550                               | 10 897                           | 0,06                      | Mitsubishi HC Capital UK PLC                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,733 % éch. 02/02/2027                                           | € 9 700                             | 11 141                           | 0,06                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           | Nationwide Building Society                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 2,972 % éch. 16/02/2028                                           | \$ 8 800                            | 8 711                            | 0,05                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 24/03/2032                                           | € 27 400                            | 31 271                           | 0,18                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           | NatWest Group PLC                                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 5,076 % éch. 27/01/2030                                           | \$ 19 200                           | 19 328                           | 0,11                      |

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 5,125 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           | Mansard Mortgages PLC                                         |                                     |                                  |                           | Argent Securities Trust                              |                                     |                                  |                           |
| 12/05/2027 (e)(g)                                                                      | £ 4 600                             | \$ 6 088                         | 0,04                      | 4,516 % éch. 15/12/2049                                       | £ 1 855                             | \$ 2 463                         | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                              | \$ 4 784                            | \$ 4 360                         | 0,03                      |
| 5,778 % éch. 01/03/2035                                                                | \$ 20 000                           | 20 748                           | 0,12                      | Mortimer Mix PLC                                              |                                     |                                  |                           | Asset-Backed Funding Certificates Trust              |                                     |                                  |                           |
| NatWest Markets PLC                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,579 % éch. 22/09/2067                                       | 14 968                              | 19 877                           | 0,11                      | 4,463 % éch. 25/06/2034                              | 148                                 | 144                              | 0,00                      |
| 4,827 % éch. 21/03/2030                                                                | 600                                 | 606                              | 0,00                      | Mortimer PLC                                                  |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust           |                                     |                                  |                           |
| 5,022 % éch. 21/03/2030                                                                | 11 500                              | 11 595                           | 0,07                      | 4,556 % éch. 22/09/2070                                       | 22 080                              | 29 313                           | 0,17                      | 4,378 % éch. 25/02/2036                              | 1 159                               | 1 153                            | 0,01                      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                                         |                                     |                                  |                           | Newgate Funding PLC                                           |                                     |                                  |                           | 4,763 % éch. 25/11/2042                              | 6                                   | 6                                | 0,00                      |
| 0,000 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           | 2,362 % éch. 01/12/2050                                       | € 1 493                             | 1 658                            | 0,01                      | 4,768 % éch. 25/06/2035                              | 230                                 | 228                              | 0,00                      |
| 05/04/2032 (b)                                                                         | 36 330                              | 29 593                           | 0,17                      | 2,498 % éch. 01/12/2050                                       | 371                                 | 419                              | 0,00                      | 4,813 % éch. 25/08/2037                              | 1 720                               | 1 562                            | 0,01                      |
| Santander UK Group Holdings PLC                                                        |                                     |                                  |                           | 3,001 % éch. 15/12/2050                                       | 323                                 | 368                              | 0,00                      | Centex Home Equity Loan Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 6,534 % éch. 10/01/2029                                                                | 1 900                               | 1 951                            | 0,01                      | 3,651 % éch. 15/12/2050                                       | 1 467                               | 1 604                            | 0,01                      | 4,223 % éch. 25/07/2032                              | 9                                   | 8                                | 0,00                      |
| 7,482 % éch. 29/08/2029                                                                | £ 23 600                            | 32 911                           | 0,19                      | 3,901 % éch. 15/12/2050                                       | 2 561                               | 2 806                            | 0,02                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                  |                                     |                                  |                           |
| Santander UK PLC                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,026 % éch. 01/12/2050                                       | £ 274                               | 361                              | 0,00                      | 3,823 % éch. 25/07/2045                              | 51                                  | 37                               | 0,00                      |
| 2,875 % éch. 12/01/2032                                                                | € 32 100                            | 36 383                           | 0,21                      | 4,036 % éch. 01/12/2050                                       | 210                                 | 277                              | 0,00                      | 4,153 % éch. 25/06/2037                              | 738                                 | 742                              | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 12/03/2029                                                                | 25 700                              | 29 473                           | 0,17                      | 4,066 % éch. 01/12/2050                                       | 332                                 | 428                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/01/2037                              | 275                                 | 272                              | 0,00                      |
| Skipton Building Society                                                               |                                     |                                  |                           | 4,866 % éch. 15/12/2050                                       | 1 841                               | 2 428                            | 0,01                      | 7,250 % éch. 25/05/2036                              | 1 092                               | 528                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 18/06/2029                                                                | 21 200                              | 24 401                           | 0,14                      | 5,116 % éch. 15/12/2050                                       | 1 640                               | 2 124                            | 0,01                      | 7,264 % éch. 25/01/2037                              | 113                                 | 47                               | 0,00                      |
| Standard Chartered PLC                                                                 |                                     |                                  |                           | Paragon Mortgages PLC                                         |                                     |                                  |                           | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.    |                                     |                                  |                           |
| 2,608 % éch. 12/01/2028                                                                | \$ 12 700                           | 12 571                           | 0,07                      | 4,108 % éch. 15/11/2038                                       | \$ 10                               | 10                               | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/08/2037                              | 13 118                              | 11 945                           | 0,07                      |
| SW Finance PLC                                                                         |                                     |                                  |                           | Polaris PLC                                                   |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/06/2037                              | 1 048                               | 980                              | 0,01                      |
| 6,125 % éch. 19/11/2033                                                                | £ 16 900                            | 21 530                           | 0,12                      | 4,505 % éch. 25/08/2068                                       | £ 18 300                            | 24 270                           | 0,14                      | 4,043 % éch. 25/07/2037                              | 521                                 | 479                              | 0,00                      |
| TP ICAP Finance PLC                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,554 % éch. 27/10/2069                                       | 3 483                               | 4 623                            | 0,03                      | 4,163 % éch. 25/09/2047                              | 1 734                               | 1 639                            | 0,01                      |
| 2,625 % éch. 18/11/2028                                                                | 9 800                               | 12 267                           | 0,07                      | Resloc UK PLC                                                 |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/09/2037                              | 248                                 | 270                              | 0,00                      |
| TSB Bank PLC                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,797 % éch. 15/12/2043                                       | \$ 83                               | 82                               | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/06/2047                              | 7 649                               | 7 359                            | 0,04                      |
| 2,704 % éch. 18/02/2030                                                                | € 23 000                            | 26 027                           | 0,15                      | 4,026 % éch. 15/12/2043                                       | £ 33                                | 43                               | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/12/2036                              | 3 911                               | 3 719                            | 0,02                      |
| 3,319 % éch. 05/03/2029                                                                | 22 400                              | 25 836                           | 0,15                      | 4,086 % éch. 15/12/2043                                       | 1 576                               | 2 018                            | 0,01                      | 4,283 % éch. 25/09/2046                              | 2 958                               | 2 830                            | 0,02                      |
| Vmed O2 UK Financing PLC                                                               |                                     |                                  |                           | RMAC Securities PLC                                           |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/05/2047                              | 6 372                               | 4 694                            | 0,03                      |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                                                                | 56 500                              | 56 935                           | 0,32                      | 2,647 % éch. 12/06/2044                                       | € 509                               | 571                              | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/08/2035                              | 694                                 | 685                              | 0,00                      |
| 6,750 % éch. 15/01/2033                                                                | \$ 4 400                            | 3 730                            | 0,02                      | 4,016 % éch. 12/06/2044                                       | £ 214                               | 281                              | 0,00                      | 4,443 % éch. 25/12/2036                              | 96                                  | 82                               | 0,00                      |
| Yorkshire Building Society                                                             |                                     |                                  |                           | 4,036 % éch. 12/06/2044                                       | 144                                 | 188                              | 0,00                      | 4,603 % éch. 25/10/2047                              | 1 565                               | 1 530                            | 0,01                      |
| 2,750 % éch. 28/01/2030                                                                | € 48 200                            | 54 637                           | 0,31                      | Stratton Mortgage Funding PLC                                 |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 25/01/2036                              | 2 979                               | 2 940                            | 0,02                      |
|                                                                                        |                                     | 658 881                          | 3,74                      | 4,721 % éch. 25/06/2049                                       | 16 992                              | 22 562                           | 0,13                      | 4,813 % éch. 25/11/2034                              | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                        |                                     |                                  |                           | Trinity Square PLC                                            |                                     |                                  |                           | 5,270 % éch. 25/02/2035                              | 252                                 | 245                              | 0,00                      |
| FPS Finance Co. LLC                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,647 % éch. 15/07/2059                                       | 6 956                               | 9 239                            | 0,05                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |                                     |                                  |                           |
| 6,590 % éch. 26/05/2028                                                                | \$ 3 800                            | 3 800                            | 0,02                      | Uropa Securities PLC                                          |                                     |                                  |                           | 4,049 % éch. 25/01/2032                              | 7                                   | 7                                | 0,00                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 4,066 % éch. 10/10/2040                                       | 12                                  | 16                               | 0,00                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC    |                                     |                                  |                           |
| Alba PLC                                                                               |                                     |                                  |                           | Warwick Finance Residential Mortgages PLC                     |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/11/2036                              | 28                                  | 13                               | 0,00                      |
| 2,561 % éch. 15/12/2038                                                                | € 61                                | 69                               | 0,00                      | 0,000 % éch.                                                  |                                     |                                  |                           | CSAB Mortgage-Backed Trust                           |                                     |                                  |                           |
| 4,036 % éch. 15/12/2038                                                                | £ 2 791                             | 3 645                            | 0,02                      | 21/12/2049 (b)                                                | 1                                   | 6 002                            | 0,03                      | 6,672 % éch. 25/06/2036                              | 166                                 | 40                               | 0,00                      |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                      |                                     |                                  |                           | 4,698 % éch. 21/12/2049                                       | 11 373                              | 15 174                           | 0,09                      | Delta Funding Home Equity Loan Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 4,596 % éch. 18/12/2066                                                                | 846                                 | 1 124                            | 0,01                      | 5,396 % éch. 21/12/2049                                       | 7 280                               | 9 723                            | 0,06                      | 4,380 % éch. 15/08/2030                              | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| Atlas Funding PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,896 % éch. 21/12/2049                                       | 3 640                               | 4 832                            | 0,03                      | Ellington Loan Acquisition Trust                     |                                     |                                  |                           |
| 4,524 % éch. 20/07/2067                                                                | 16 630                              | 22 070                           | 0,13                      | 6,396 % éch. 21/12/2049                                       | 2 080                               | 2 756                            | 0,02                      | 4,863 % éch. 25/05/2037                              | 151                                 | 148                              | 0,00                      |
| Bletchley Park Funding PLC                                                             |                                     |                                  |                           | 6,896 % éch. 21/12/2049                                       | 2 080                               | 2 733                            | 0,02                      | EMC Mortgage Loan Trust                              |                                     |                                  |                           |
| 4,504 % éch. 27/01/2070                                                                | 9 789                               | 12 988                           | 0,07                      | Winchester PLC                                                |                                     |                                  |                           | 4,503 % éch. 25/05/2040                              | 6                                   | 6                                | 0,00                      |
| Braccan Mortgage Funding PLC                                                           |                                     |                                  |                           | 4,637 % éch. 21/10/2056                                       | 12 200                              | 16 208                           | 0,09                      | Encore Credit Receivables Trust                      |                                     |                                  |                           |
| 4,587 % éch. 15/02/2067                                                                | 23 668                              | 31 435                           | 0,18                      |                                                               |                                     | 479 487                          | 2,72                      | 4,663 % éch. 25/01/2036                              | 3 570                               | 3 498                            | 0,02                      |
| 4,607 % éch. 17/01/2068                                                                | 7 300                               | 9 706                            | 0,06                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                         |                                     |                                  |                           | Fieldstone Mortgage Investment Trust                 |                                     |                                  |                           |
| Canada Square Funding PLC                                                              |                                     |                                  |                           | Bon du Trésor britannique                                     |                                     |                                  |                           | 3,939 % éch. 25/11/2036                              | 1 788                               | 1 185                            | 0,01                      |
| 5,409 % éch. 17/06/2058                                                                | 18                                  | 23                               | 0,00                      | 0,625 % éch. 22/10/2050                                       | 46 810                              | 21 967                           | 0,12                      | First Franklin Mortgage Loan Trust                   |                                     |                                  |                           |
| Elstree PLC                                                                            |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 31/07/2051                                       | 31 025                              | 17 491                           | 0,10                      | 3,983 % éch. 25/12/2037                              | 1 443                               | 1 394                            | 0,01                      |
| 4,475 % éch. 21/10/2065                                                                | 24 641                              | 32 668                           | 0,19                      | 1,500 % éch. 31/07/2053                                       | 11 300                              | 6 582                            | 0,04                      | Fremont Home Loan Trust                              |                                     |                                  |                           |
| Eurohome UK Mortgages PLC                                                              |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 07/03/2030                                       | 334 910                             | 446 545                          | 2,54                      | 4,033 % éch. 25/10/2036                              | 1 616                               | 1 464                            | 0,01                      |
| 4,016 % éch. 15/06/2044                                                                | 4                                   | 5                                | 0,00                      |                                                               |                                     | 492 585                          | 2,80                      | 4,043 % éch. 25/01/2037                              | 2 033                               | 1 043                            | 0,01                      |
| Eurosail PLC                                                                           |                                     |                                  |                           | Total Royaume-Uni                                             |                                     | 1 636 479                        | 9,29                      | 4,828 % éch. 25/06/2035                              | 2 070                               | 2 051                            | 0,01                      |
| 2,641 % éch. 13/03/2045                                                                | € 120                               | 136                              | 0,00                      | ÉTATS-UNIS                                                    |                                     |                                  |                           | GSAA Home Equity Trust                               |                                     |                                  |                           |
| 4,566 % éch. 13/09/2045                                                                | £ 350                               | 460                              | 0,00                      | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                    |                                     |                                  |                           | 4,223 % éch. 25/04/2047                              | 264                                 | 113                              | 0,00                      |
| 4,816 % éch. 13/06/2045                                                                | 10                                  | 13                               | 0,00                      | Accredited Mortgage Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/06/2036                              | 2 520                               | 601                              | 0,00                      |
| Great Hall Mortgages PLC                                                               |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/09/2036                                       | \$ 165                              | 165                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/03/2037                              | 255                                 | 100                              | 0,00                      |
| 4,106 % éch. 18/03/2039                                                                | 2 250                               | 2 976                            | 0,02                      | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/05/2047                              | 88                                  | 55                               | 0,00                      |
| Harbour PLC                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/10/2036                                       | 4                                   | 1                                | 0,00                      | GSAMP Trust                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                | 16 519                              | 21 994                           | 0,12                      | 4,023 % éch. 25/12/2036                                       | 5 227                               | 2 781                            | 0,02                      | 4,023 % éch. 25/12/2046                              | 7 057                               | 3 710                            | 0,02                      |
| Harvest Funding PLC                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/07/2036                                       | 2 053                               | 670                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/06/2036                              | 38                                  | 37                               | 0,00                      |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                | 33 000                              | 43 806                           | 0,25                      | 4,558 % éch. 25/01/2035                                       | 530                                 | 517                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/12/2036                              | 5 129                               | 2 729                            | 0,02                      |
| Hawksmoor Mortgage Funding PLC                                                         |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/12/2034                                       | 685                                 | 629                              | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/12/2046                              | 6 183                               | 3 053                            | 0,02                      |
| 4,587 % éch. 25/02/2057                                                                | 21 400                              | 28 438                           | 0,16                      | 4,663 % éch. 25/08/2035                                       | 2 571                               | 2 535                            | 0,02                      | 4,263 % éch. 25/05/2046                              | 260                                 | 251                              | 0,00                      |
| Hops Hill PLC                                                                          |                                     |                                  |                           | Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through |                                     |                                  |                           | 4,438 % éch. 25/11/2035                              | 932                                 | 913                              | 0,01                      |
| 4,464 % éch. 21/06/2056                                                                | 27 725                              | 36 706                           | 0,21                      | Certificates                                                  |                                     |                                  |                           | Home Equity Asset Trust                              |                                     |                                  |                           |
| 4,614 % éch. 21/04/2056                                                                | 16 537                              | 21 966                           | 0,12                      | 4,513 % éch. 25/01/2036                                       | 218                                 | 216                              | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/08/2036                              | 119                                 | 118                              | 0,00                      |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC                                                     |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 25/07/2035                                       | 674                                 | 660                              | 0,00                      | 4,683 % éch. 25/02/2033                              | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,546 % éch. 15/03/2061                                                                | 10 879                              | 14 450                           | 0,08                      | 4,813 % éch. 25/11/2034                                       | 205                                 | 203                              | 0,00                      | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust         |                                     |                                  |                           |
| London Bridge Mortgages PLC                                                            |                                     |                                  |                           | Amortizing Residential Collateral Trust                       |                                     |                                  |                           | 3,923 % éch. 25/11/2036                              | 4 258                               | 3 975                            | 0,02                      |
| 4,514 % éch. 20/03/2067                                                                | 6 817                               | 9 040                            | 0,05                      | 4,463 % éch. 25/10/2031                                       | 13                                  | 13                               | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/04/2037                              | 2 329                               | 2 063                            | 0,01                      |
| Ludgate Funding PLC                                                                    |                                     |                                  |                           | Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust      |                                     |                                  |                           | HSI Asset Securitization Corp. Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 2,282 % éch. 01/01/2061                                                                | € 277                               | 312                              | 0,00                      | 4,703 % éch. 25/06/2029                                       | 33                                  | 35                               | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/02/2036                              | 476                                 | 473                              | 0,00                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                               |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                               |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 25/08/2036                              | 2 395                               | 1 818                            | 0,01                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                               |                                     |                                  |                           | 4,033 % éch. 25/08/2036                              | 7 129                               | 6 752                            | 0,04                      |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,243 % éch. 25/04/2036                                            | \$ 3 013                            | \$ 3 160                         | 0,02                      | SG Mortgage Securities Trust                           |                                     |                                  |                           | 5,536 % éch. 28/01/2036                                         | \$ 16 800                           | \$ 17 069                        | 0,10                      |
| Lehman ABS Mortgage Loan Trust                                     |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/07/2036                                | \$ 3 014                            | \$ 615                           | 0,00                      | JPMorgan Chase & Co.                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,853 % éch. 25/06/2037                                            | 77                                  | 50                               | 0,00                      | SLM Student Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | 3,588 % éch. 23/01/2036                                         | € 13 800                            | 15 610                           | 0,09                      |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                     |                                     |                                  |                           | 2,565 % éch. 25/10/2039                                | € 100                               | 107                              | 0,00                      | 4,603 % éch. 22/10/2030                                         | \$ 16 400                           | 16 330                           | 0,09                      |
| 4,063 % éch. 25/05/2036                                            | 3 325                               | 1 732                            | 0,01                      | 2,951 % éch. 15/12/2033                                | 525                                 | 569                              | 0,00                      | 5,336 % éch. 23/01/2035                                         | 6 500                               | 6 599                            | 0,04                      |
| 4,323 % éch. 25/10/2034                                            | 428                                 | 420                              | 0,00                      | Soundview Home Loan Trust                              |                                     |                                  |                           | 5,502 % éch. 24/01/2036                                         | 26 700                              | 27 298                           | 0,16                      |
| 5,038 % éch. 25/02/2035                                            | 3 928                               | 3 876                            | 0,02                      | 3,933 % éch. 25/07/2037                                | \$ 1 386                            | 1 215                            | 0,01                      | Kraton Corp.                                                    |                                     |                                  |                           |
| Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community    |                                     |                                  |                           | 3,933 % éch. 25/08/2037                                | 204                                 | 179                              | 0,00                      | 5,000 % éch. 15/07/2027                                         | 23 400                              | 23 511                           | 0,13                      |
| Development Authority                                              |                                     |                                  |                           | 3,943 % éch. 25/07/2037                                | 116                                 | 105                              | 0,00                      | Las Vegas Sands Corp.                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,048 % éch. 01/12/2034                                            | 6 600                               | 6 682                            | 0,04                      | 3,963 % éch. 25/06/2037                                | 5 302                               | 3 772                            | 0,02                      | 5,900 % éch. 01/06/2027                                         | 13 200                              | 13 325                           | 0,08                      |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                                |                                     |                                  |                           | 3,973 % éch. 25/06/2037                                | 10 225                              | 7 100                            | 0,04                      | 6,000 % éch. 15/08/2029                                         | 4 300                               | 4 418                            | 0,03                      |
| 3,963 % éch. 25/08/2036                                            | 15 283                              | 5 186                            | 0,03                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                                | 361                                 | 340                              | 0,00                      | Lehman Brothers Holdings, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                             |                                     |                                  |                           | 4,168 % éch. 25/12/2036                                | 3 743                               | 3 680                            | 0,02                      | 1,000 % éch. 31/12/2016 ^                                       | 8 800                               | 3                                | 0,00                      |
| 3,923 % éch. 25/09/2037                                            | 12                                  | 2                                | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/10/2036                                | 5 692                               | 5 501                            | 0,03                      | 1,000 % éch. 26/09/2020 ^                                       | 9 800                               | 3                                | 0,00                      |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                             |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/11/2036                                | 3 881                               | 3 731                            | 0,02                      | 1,000 % éch. 24/01/2049 ^                                       | 12 700                              | 4                                | 0,00                      |
| 3,823 % éch. 25/05/2037                                            | 176                                 | 162                              | 0,00                      | 4,513 % éch. 25/03/2036                                | 448                                 | 445                              | 0,00                      | 7,875 % éch. 08/05/2018 ^                                       | £ 14 000                            | 61                               | 0,00                      |
| 3,893 % éch. 25/01/2037                                            | 2 350                               | 1 073                            | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/10/2037                                | 4 184                               | 3 333                            | 0,02                      | Morgan Stanley                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,903 % éch. 25/10/2036                                            | 2 747                               | 1 190                            | 0,01                      | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust     |                                     |                                  |                           | 3,955 % éch. 21/03/2035                                         | € 12 150                            | 14 085                           | 0,08                      |
| 3,993 % éch. 25/10/2036                                            | 9 080                               | 4 707                            | 0,03                      | 4,363 % éch. 25/12/2036                                | 117                                 | 114                              | 0,00                      | 4,238 % éch. 09/01/2030                                         | \$ 4 500                            | 4 442                            | 0,03                      |
| 4,013 % éch. 25/07/2036                                            | 371                                 | 335                              | 0,00                      | Structured Asset Investment Loan Trust                 |                                     |                                  |                           | 4,433 % éch. 09/01/2030                                         | 13 200                              | 13 185                           | 0,08                      |
| 4,083 % éch. 25/09/2036                                            | 3 911                               | 1 628                            | 0,01                      | 4,383 % éch. 25/01/2036                                | 2 187                               | 2 063                            | 0,01                      | 4,493 % éch. 16/01/2032                                         | 16 000                              | 15 693                           | 0,09                      |
| 4,263 % éch. 25/04/2036                                            | 3 283                               | 3 171                            | 0,02                      | 5,038 % éch. 25/11/2034                                | 1 953                               | 2 086                            | 0,01                      | 4,654 % éch. 13/04/2028                                         | 14 200                              | 14 245                           | 0,08                      |
| 4,438 % éch. 25/09/2035                                            | 302                                 | 289                              | 0,00                      | Terwin Mortgage Trust                                  |                                     |                                  |                           | 4,654 % éch. 18/10/2030                                         | 10 300                              | 10 246                           | 0,06                      |
| 7,563 % éch. 25/02/2047                                            | 927                                 | 761                              | 0,00                      | 0,044 % éch. 25/08/2037                                | 200                                 | 98                               | 0,00                      | 4,889 % éch. 20/07/2033                                         | 7 500                               | 7 445                            | 0,04                      |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                              |                                     |                                  |                           | 4,703 % éch. 25/11/2033                                | 4                                   | 3                                | 0,00                      | 5,042 % éch. 19/07/2030                                         | 10 400                              | 10 474                           | 0,06                      |
| 3,933 % éch. 25/04/2037                                            | 3 136                               | 1 596                            | 0,01                      | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.         |                                     |                                  |                           | 5,192 % éch. 17/04/2031                                         | 17 200                              | 17 384                           | 0,10                      |
| 3,993 % éch. 25/04/2037                                            | 9 587                               | 4 880                            | 0,03                      | 5,169 % éch. 01/04/2041                                | 11 000                              | 11 099                           | 0,06                      | 5,230 % éch. 15/01/2031                                         | 17 200                              | 17 397                           | 0,10                      |
| Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust                      |                                     |                                  |                           | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust              |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 21/04/2034                                         | 15 000                              | 15 099                           | 0,09                      |
| 3,813 % éch. 25/11/2036                                            | 2                                   | 1                                | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/01/2037                                | 2 167                               | 1 903                            | 0,01                      | 5,466 % éch. 18/01/2035                                         | 6 500                               | 6 601                            | 0,04                      |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust      |                                     |                                  |                           | 5,587 % éch. 18/01/2036                                         | 29 900                              | 30 544                           | 0,17                      |
| 4,223 % éch. 25/02/2037                                            | 165                                 | 31                               | 0,00                      | 3,883 % éch. 25/10/2036                                | 44                                  | 15                               | 0,00                      | Morgan Stanley Bank N.A.                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/04/2037                                            | 274                                 | 73                               | 0,00                      | Wellis Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                     |                                  |                           | 4,533 % éch. 12/01/2029                                         | 4 200                               | 4 214                            | 0,02                      |
| 5,750 % éch. 25/04/2037                                            | 91                                  | 43                               | 0,00                      | 4,108 % éch. 25/01/2037                                | 3 023                               | 3 022                            | 0,02                      | 5,504 % éch. 26/05/2028                                         | 24 900                              | 25 112                           | 0,14                      |
| 6,000 % éch. 25/02/2037                                            | 117                                 | 66                               | 0,00                      |                                                        |                                     | 233 850                          | 1,33                      | Pacific Gas & Electric Co.                                      |                                     |                                  |                           |
| New Century Home Equity Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                          |                                     |                                  |                           | 2,100 % éch. 01/08/2027                                         | 500                                 | 487                              | 0,00                      |
| 3,306 % éch. 20/06/2031                                            | 139                                 | 125                              | 0,00                      | Athene Global Funding                                  |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 01/12/2027                                         | 800                                 | 785                              | 0,01                      |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust               |                                     |                                  |                           | 3,204 % éch. 23/02/2027                                | € 28 100                            | 32 191                           | 0,18                      | 3,750 % éch. 01/07/2028                                         | 1 500                               | 1 474                            | 0,01                      |
| 4,393 % éch. 25/02/2036                                            | 2 917                               | 2 655                            | 0,02                      | 3,410 % éch. 25/02/2030                                | 13 700                              | 15 532                           | 0,09                      | 4,000 % éch. 01/12/2046                                         | 1 600                               | 1 196                            | 0,01                      |
| Nomura Resecuritization Trust                                      |                                     |                                  |                           | 4,383 % éch. 16/07/2026                                | \$ 19 500                           | 19 503                           | 0,11                      | 4,250 % éch. 15/03/2046                                         | 800                                 | 620                              | 0,00                      |
| 3,560 % éch. 26/12/2037                                            | 774                                 | 677                              | 0,00                      | 5,516 % éch. 25/03/2027                                | 21 100                              | 21 223                           | 0,12                      | 4,300 % éch. 15/03/2045                                         | 1 500                               | 1 185                            | 0,01                      |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                                    |                                     |                                  |                           | Bank of America Corp.                                  |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/07/2040                                         | 800                                 | 689                              | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/01/2037                                            | 1 255                               | 404                              | 0,00                      | 3,261 % éch. 28/01/2031                                | € 45 000                            | 51 416                           | 0,29                      | 4,600 % éch. 15/06/2043                                         | 1 000                               | 834                              | 0,01                      |
| 4,303 % éch. 25/05/2036                                            | 3 475                               | 3 413                            | 0,02                      | 4,640 % éch. 24/01/2031                                | \$ 16 900                           | 17 022                           | 0,10                      | 4,750 % éch. 15/02/2044                                         | 200                                 | 170                              | 0,00                      |
| Option One Mortgage Loan Trust                                     |                                     |                                  |                           | 5,202 % éch. 25/04/2029                                | 27 100                              | 27 357                           | 0,16                      | 4,950 % éch. 01/07/2050                                         | 600                                 | 501                              | 0,00                      |
| 3,903 % éch. 25/03/2037                                            | 910                                 | 824                              | 0,01                      | 5,288 % éch. 25/04/2034                                | 14 100                              | 14 292                           | 0,08                      | PacifiCorp                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,943 % éch. 25/04/2037                                            | 12 591                              | 6 147                            | 0,04                      | 5,468 % éch. 23/01/2035 (j)                            | 43 500                              | 44 368                           | 0,25                      | 5,100 % éch. 15/02/2029                                         | 2 200                               | 2 221                            | 0,01                      |
| 3,983 % éch. 25/04/2037                                            | 3 092                               | 2 223                            | 0,01                      | Beignet Investor LLC                                   |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/02/2031                                         | 24 800                              | 25 182                           | 0,14                      |
| 4,043 % éch. 25/01/2037                                            | 596                                 | 389                              | 0,00                      | 6,581 % éch. 30/05/2049                                | 171 500                             | 175 041                          | 0,99                      | Philip Morris International, Inc.                               |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/03/2037                                            | 1 200                               | 795                              | 0,01                      | 3,300 % éch. 15/06/2034                                | 4 319                               | 4 065                            | 0,02                      | 4,875 % éch. 13/02/2029                                         | 13 600                              | 13 705                           | 0,08                      |
| 4,203 % éch. 25/05/2037                                            | 3 954                               | 2 388                            | 0,01                      | Citibank N.A.                                          |                                     |                                  |                           | RBC International                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,443 % éch. 25/11/2034                                            | 37                                  | 37                               | 0,00                      | 4,838 % éch. 06/08/2029                                | 28 900                              | 29 134                           | 0,17                      | 4,660 % éch. 16/12/2028 (j)                                     | 20 000                              | 19 671                           | 0,11                      |
| 4,633 % éch. 25/05/2035                                            | 2 842                               | 2 525                            | 0,01                      | CommonSpirit Health                                    |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC                                  |                                     |                                  |                           |
| Ownit Mortgage Loan Trust                                          |                                     |                                  |                           | 4,975 % éch. 01/09/2035                                | 15 000                              | 14 559                           | 0,08                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                                         | 89 000                              | 88 755                           | 0,50                      |
| 3,999 % éch. 25/05/2037                                            | 1 375                               | 1 168                            | 0,01                      | 5,662 % éch. 01/09/2055                                | 11 400                              | 11 089                           | 0,06                      | Southern California Edison Co.                                  |                                     |                                  |                           |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | Doctors Co. An Interinsurance Exchange                 |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 15/03/2033                                         | 2 500                               | 2 452                            | 0,01                      |
| 4,498 % éch. 25/09/2035                                            | 92                                  | 91                               | 0,00                      | 4,500 % éch. 18/01/2032                                | 3 900                               | 3 628                            | 0,02                      | 5,450 % éch. 01/03/2035                                         | 5 000                               | 5 011                            | 0,03                      |
| People's Choice Home Loan Securities Trust                         |                                     |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC                              |                                     |                                  |                           | Southern Co.                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,113 % éch. 25/01/2035                                            | 10                                  | 10                               | 0,00                      | 2,900 % éch. 16/02/2028                                | 700                                 | 676                              | 0,00                      | 1,875 % éch. 15/09/2081                                         | € 8 861                             | 9 957                            | 0,06                      |
| Renaissance Home Equity Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | 3,815 % éch. 02/11/2027                                | 1 400                               | 1 380                            | 0,01                      | Wells Fargo & Co.                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,463 % éch. 25/08/2032                                            | 1                                   | 1                                | 0,00                      | GA Global Funding Trust                                |                                     |                                  |                           | 3,350 % éch. 02/03/2033                                         | \$ 25 000                           | 22 987                           | 0,13                      |
| 5,340 % éch. 25/01/2037                                            | 15 587                              | 4 583                            | 0,03                      | 2,250 % éch. 06/01/2027                                | 9 400                               | 9 289                            | 0,05                      | 3,900 % éch. 22/07/2032                                         | € 34 700                            | 40 450                           | 0,23                      |
| 5,879 % éch. 25/06/2037                                            | 19 229                              | 4 589                            | 0,03                      | 5,400 % éch. 13/01/2030                                | 6 800                               | 6 827                            | 0,04                      | 4,518 % éch. 15/09/2029                                         | \$ 24 500                           | 24 595                           | 0,14                      |
| 5,893 % éch. 25/06/2037                                            | 9 958                               | 2 383                            | 0,01                      | GLP Capital LP                                         |                                     |                                  |                           | 4,892 % éch. 15/09/2036                                         | 17 000                              | 16 591                           | 0,09                      |
| Residential Asset Mortgage Products Trust                          |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/01/2029                                | 2 500                               | 2 513                            | 0,02                      | 4,960 % éch. 23/01/2037                                         | 32 000                              | 31 253                           | 0,18                      |
| 4,203 % éch. 25/12/2036                                            | 15                                  | 15                               | 0,00                      | Goldman Sachs Group, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 23/04/2031                                         | 3 700                               | 3 739                            | 0,02                      |
| 4,443 % éch. 25/12/2035                                            | 2 882                               | 2 614                            | 0,02                      | 3,500 % éch. 23/01/2033                                | € 36 900                            | 42 075                           | 0,24                      | 5,211 % éch. 03/12/2035                                         | 33 600                              | 33 553                           | 0,19                      |
| Residential Asset Securities Corp. Trust                           |                                     |                                  |                           | 3,984 % éch. 18/12/2036                                | 9 377                               | 10 746                           | 0,06                      | 5,389 % éch. 24/04/2034                                         | 45 300                              | 46 005                           | 0,26                      |
| 4,468 % éch. 25/11/2035                                            | 352                                 | 347                              | 0,00                      | 4,516 % éch. 21/01/2032                                | \$ 3 900                            | 3 827                            | 0,02                      |                                                                 |                                     | 1 427 463                        | 8,11                      |
| Saxon Asset Securities Trust                                       |                                     |                                  |                           | 4,591 % éch. 21/01/2032                                | 18 300                              | 18 332                           | 0,10                      | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,963 % éch. 25/05/2047                                            | 6 449                               | 5 567                            | 0,03                      | 4,692 % éch. 23/10/2030                                | 13 000                              | 12 941                           | 0,07                      | Project Dorchester                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,073 % éch. 25/09/2037                                            | 1 144                               | 1 114                            | 0,01                      | 4,710 % éch. 28/01/2031                                | 24 200                              | 24 345                           | 0,14                      | 4,610 % éch. 04/01/2027 (i)                                     | € 7 200                             | 8 232                            | 0,05                      |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                     |                                     |                                  |                           | 5,049 % éch. 23/07/2030                                | 10 000                              | 10 060                           | 0,06                      | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX                               |                                     |                                  |                           |
| 3,863 % éch. 25/12/2036                                            | 5                                   | 2                                | 0,00                      | 5,065 % éch. 21/01/2037                                | 25 500                              | 24 906                           | 0,14                      | Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, |                                     |                                  |                           |
| 3,883 % éch. 25/12/2036                                            | 77                                  | 16                               | 0,00                      | 5,207 % éch. 28/01/2031                                | 14 500                              | 14 659                           | 0,08                      | (BABs), Series 2010                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,023 % éch. 25/05/2037                                            | 116                                 | 91                               | 0,00                      | 5,218 % éch. 23/04/2031                                | 39 600                              | 40 002                           | 0,23                      | 6,270 % éch. 15/02/2050                                         | \$ 85                               | 87                               | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/10/2035                                            | 523                                 | 472                              | 0,00                      |                                                        |                                     |                                  |                           | Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, |                                     |                                  |                           |
| 4,588 % éch. 25/10/2035                                            | 1 489                               | 1 450                            | 0,01                      |                                                        |                                     |                                  |                           | Series 2010                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           | 7,734 % éch. 15/02/2033                                         | 100                                 | 115                              | 0,00                      |

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 7,834 % éch. 15/02/2041                                                                | \$ 1 700                            | \$ 2 010                         | 0,01                      | 4,847 % éch. 25/03/2037                                                | \$ 34                               | \$ 34                            | 0,00                      | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust        |                                     |                                  |                           |
| Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp.                      |                                     |                                  |                           | 6,310 % éch. 25/02/2037                                                | 35                                  | 36                               | 0,00                      | 6,079 % éch. 25/04/2037                                     | \$ 62                               | \$ 16                            | 0,00                      |
| Revenue Bonds, Series 2021                                                             |                                     |                                  |                           | Citicorp Mortgage Securities Trust                                     |                                     |                                  |                           | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                           |
| 3,850 % éch. 01/06/2050                                                                | 1 130                               | 1 038                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                                | 41                                  | 36                               | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/08/2036                                     | 1 217                               | 1 147                            | 0,01                      |
| Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue                  |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                    | 8 707                               | 3 429                            | 0,02                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                                     | 1 324                               | 1 282                            | 0,01                      |
| Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021                                                |                                     |                                  |                           | 3,979 % éch. 25/08/2036                                                | 152                                 | 142                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/09/2047                                     | 2 131                               | 1 879                            | 0,01                      |
| 2,346 % éch. 01/06/2030                                                                | 200                                 | 185                              | 0,00                      | 4,669 % éch. 25/08/2035                                                | 36                                  | 35                               | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/08/2047                                     | 2 991                               | 2 614                            | 0,02                      |
| Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue                  |                                     |                                  |                           | 5,329 % éch. 25/08/2035                                                | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/08/2037                                     | 2 136                               | 1 796                            | 0,01                      |
| Notes, Series 2021                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/09/2035                                                | 35                                  | 36                               | 0,00                      | Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                           |
| 2,687 % éch. 01/06/2030                                                                | 6 000                               | 5 520                            | 0,03                      | 5,860 % éch. 25/09/2035                                                | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/10/2036                                     | 5                                   | 4                                | 0,00                      |
| 2,787 % éch. 01/06/2031                                                                | 4 400                               | 3 972                            | 0,02                      | 6,190 % éch. 25/05/2035                                                | 5                                   | 5                                | 0,00                      | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust       |                                     |                                  |                           |
| 3,037 % éch. 01/06/2032                                                                | 8 045                               | 7 193                            | 0,04                      | 6,480 % éch. 25/10/2035                                                |                                     |                                  |                           | 3,944 % éch. 19/10/2036                                     | 976                                 | 911                              | 0,01                      |
| Obligations Los Angeles County, California Public Works Financing                      |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates | 346                                 | 332                              | 0,00                      | 4,594 % éch. 19/09/2044                                     | 22                                  | 21                               | 0,00                      |
| Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010                                           |                                     |                                  |                           | 4,405 % éch. 25/09/2035                                                |                                     |                                  |                           | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust         |                                     |                                  |                           |
| 7,618 % éch. 01/08/2040                                                                | 2 800                               | 3 282                            | 0,02                      | CitiMortgage Alternative Loan Trust                                    | 1 184                               | 1 008                            | 0,01                      | 4,639 % éch. 25/04/2035                                     | 42                                  | 41                               | 0,00                      |
| Billets Minnesota Housing Finance Agency Revenue Notes, Series 2024                    |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/02/2037                                                | 224                                 | 199                              | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/11/2036                                     | 155                                 | 38                               | 0,00                      |
| 5,301 % éch. 01/01/2029                                                                | 4 900                               | 4 956                            | 0,03                      | 6,000 % éch. 25/01/2037                                                |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 25/08/2037                                     | 158                                 | 48                               | 0,00                      |
| 5,532 % éch. 01/01/2034                                                                | 1 700                               | 1 745                            | 0,01                      | Countrywide Alternative Loan Trust                                     | 3 782                               | 3 093                            | 0,02                      | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust                   |                                     |                                  |                           |
| Obligations Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds,                     |                                     |                                  |                           | 3,934 % éch. 20/02/2047                                                | 1 818                               | 1 646                            | 0,01                      | 5,737 % éch. 25/08/2035                                     | 41                                  | 27                               | 0,00                      |
| (BABs), Series 2010                                                                    |                                     |                                  |                           | 3,949 % éch. 20/12/2046                                                | 645                                 | 626                              | 0,00                      | GreenPoint Mortgage Funding Trust                           |                                     |                                  |                           |
| 6,655 % éch. 01/04/2057                                                                | 274                                 | 295                              | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/06/2036                                                | 97                                  | 91                               | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/01/2037                                     | 467                                 | 409                              | 0,00                      |
|                                                                                        |                                     | 30 398                           | 0,17                      | 4,083 % éch. 25/02/2047                                                | 2 384                               | 2 213                            | 0,01                      | 4,183 % éch. 25/04/2036                                     | 228                                 | 192                              | 0,00                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/05/2047                                                | 525                                 | 163                              | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/06/2045                                     | 23                                  | 20                               | 0,00                      |
| Adjustable Rate Mortgage Trust                                                         |                                     |                                  |                           | 4,113 % éch. 25/05/2037                                                | 51                                  | 46                               | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/04/2036                                     | 184                                 | 171                              | 0,00                      |
| 4,570 % éch. 25/09/2035                                                                | 26                                  | 23                               | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/05/2036                                                | 1 209                               | 1 153                            | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/11/2045                                     | 52                                  | 51                               | 0,00                      |
| 4,913 % éch. 25/03/2035                                                                | 378                                 | 337                              | 0,00                      | 4,174 % éch. 20/03/2046                                                | 165                                 | 145                              | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/09/2046                                     | 1 019                               | 863                              | 0,01                      |
| American Home Mortgage Assets Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 4,174 % éch. 20/07/2046                                                | 16                                  | 16                               | 0,00                      | 4,443 % éch. 25/10/2046                                     | 1 280                               | 1 043                            | 0,01                      |
| 3,953 % éch. 25/05/2046                                                                | 181                                 | 163                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/07/2046                                                | 39                                  | 37                               | 0,00                      | GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 3,973 % éch. 25/10/2046                                                                | 57                                  | 28                               | 0,00                      | 4,214 % éch. 20/05/2046                                                | 1 925                               | 1 759                            | 0,01                      | 6,427 % éch. 25/10/2033                                     | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/09/2046                                                                | 527                                 | 521                              | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/11/2036                                                | 3 771                               | 3 558                            | 0,02                      | GS Mortgage Securities Corp. Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 4,664 % éch. 25/11/2046                                                                | 7 331                               | 1 668                            | 0,01                      | 4,314 % éch. 20/09/2046                                                | 1 173                               | 1 074                            | 0,01                      | 4,823 % éch. 15/07/2031                                     | 5 000                               | 4 598                            | 0,03                      |
| American Home Mortgage Investment Trust                                                |                                     |                                  |                           | 4,323 % éch. 25/02/2037                                                | 632                                 | 529                              | 0,00                      | 7,500 % éch. 25/10/2036                                     | 51                                  | 5                                | 0,00                      |
| 5,770 % éch. 25/09/2035                                                                | 3 008                               | 1 092                            | 0,01                      | 4,394 % éch. 20/12/2035                                                | 1 194                               | 1 146                            | 0,01                      | GSR Mortgage Loan Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| Banc of America Funding Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 4,398 % éch. 20/11/2035                                                | 251                                 | 245                              | 0,00                      | 3,993 % éch. 25/05/2037                                     | 8 781                               | 4 005                            | 0,02                      |
| 4,074 % éch. 20/02/2047                                                                | 392                                 | 373                              | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/11/2035                                                | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 4,075 % éch. 25/06/2034                                     | 12                                  | 11                               | 0,00                      |
| 4,353 % éch. 20/10/2046                                                                | 76                                  | 61                               | 0,00                      | 4,418 % éch. 20/11/2035                                                | 21                                  | 20                               | 0,00                      | 4,479 % éch. 25/01/2036                                     | 25                                  | 24                               | 0,00                      |
| 4,727 % éch. 20/01/2047                                                                | 69                                  | 60                               | 0,00                      | 4,443 % éch. 25/10/2046                                                | 547                                 | 487                              | 0,00                      | 4,596 % éch. 25/11/2035                                     | 9                                   | 8                                | 0,00                      |
| 5,608 % éch. 20/02/2036                                                                | 155                                 | 149                              | 0,00                      | 4,513 % éch. 25/07/2036                                                | 253                                 | 98                               | 0,00                      | 4,837 % éch. 25/09/2035                                     | 21                                  | 20                               | 0,00                      |
| 5,750 % éch. 25/11/2035                                                                | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 4,603 % éch. 25/10/2035                                                | 7                                   | 6                                | 0,00                      | 5,270 % éch. 25/03/2033                                     | 11                                  | 11                               | 0,00                      |
| Banc of America Mortgage Trust                                                         |                                     |                                  |                           | 5,244 % éch. 25/11/2035                                                | 183                                 | 170                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/01/2037                                     | 22                                  | 66                               | 0,00                      |
| 6,524 % éch. 25/09/2033                                                                | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 5,250 % éch. 25/06/2035                                                | 121                                 | 88                               | 0,00                      | 5,550 % éch. 25/04/2032                                     | 46                                  | 45                               | 0,00                      |
| BCAP LLC Trust                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,303 % éch. 25/11/2035                                                | 205                                 | 192                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2032                                     | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/01/2037                                                                | 18                                  | 16                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/09/2035                                                | 646                                 | 444                              | 0,00                      | HarborView Mortgage Loan Trust                              |                                     |                                  |                           |
| 4,203 % éch. 25/05/2047                                                                | 118                                 | 109                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                                | 1 203                               | 726                              | 0,01                      | 4,134 % éch. 19/09/2037                                     | 360                                 | 319                              | 0,00                      |
| 4,475 % éch. 26/01/2047                                                                | 151                                 | 150                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/03/2037                                                | 171                                 | 83                               | 0,00                      | 4,154 % éch. 19/09/2046                                     | 421                                 | 400                              | 0,00                      |
| 5,250 % éch. 26/04/2037                                                                | 486                                 | 257                              | 0,00                      | 5,784 % éch. 25/11/2035                                                | 142                                 | 135                              | 0,00                      | 4,164 % éch. 19/12/2036                                     | 7 668                               | 6 950                            | 0,04                      |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/03/2036                                                | 1 770                               | 743                              | 0,01                      | 4,234 % éch. 19/03/2036                                     | 92                                  | 87                               | 0,00                      |
| 3,803 % éch. 25/08/2033                                                                | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                                                | 175                                 | 63                               | 0,00                      | 4,254 % éch. 19/01/2036                                     | 280                                 | 178                              | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 25/05/2034                                                                | 36                                  | 33                               | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/08/2037                                                | 104                                 | 75                               | 0,00                      | 4,330 % éch. 19/07/2035                                     | 38                                  | 29                               | 0,00                      |
| 4,015 % éch. 25/05/2047                                                                | 73                                  | 66                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2032                                                | 436                                 | 190                              | 0,00                      | 4,454 % éch. 19/01/2035                                     | 69                                  | 66                               | 0,00                      |
| 5,461 % éch. 25/10/2033                                                                | 13                                  | 13                               | 0,00                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                      | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 4,594 % éch. 19/12/2036                                     | 218                                 | 205                              | 0,00                      |
| 5,498 % éch. 25/02/2034                                                                | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 3,549 % éch. 25/04/2035                                                | 109                                 | 69                               | 0,00                      | 5,133 % éch. 19/08/2036                                     | 16                                  | 15                               | 0,00                      |
| 5,950 % éch. 25/02/2036                                                                | 34                                  | 31                               | 0,00                      | 3,991 % éch. 25/09/2033                                                | 8                                   | 7                                | 0,00                      | 5,254 % éch. 19/10/2035                                     | 183                                 | 131                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2033                                                                | 19                                  | 18                               | 0,00                      | 4,031 % éch. 20/09/2036                                                | 38                                  | 34                               | 0,00                      | 5,744 % éch. 19/10/2035                                     | 347                                 | 159                              | 0,00                      |
| 6,243 % éch. 25/05/2034                                                                | 34                                  | 33                               | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/05/2035                                                | 270                                 | 239                              | 0,00                      | HSI Asset Loan Obligation Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 6,453 % éch. 25/02/2036                                                                | 23                                  | 21                               | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/04/2035                                                | 125                                 | 121                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2037                                     | 17                                  | 16                               | 0,00                      |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                                               |                                     |                                  |                           | 4,366 % éch. 19/01/2034                                                | 30                                  | 28                               | 0,00                      | Impac CMB Trust                                             |                                     |                                  |                           |
| 3,533 % éch. 25/03/2036                                                                | 133                                 | 71                               | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/03/2035                                                | 817                                 | 761                              | 0,01                      | 4,403 % éch. 25/03/2035                                     | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 4,050 % éch. 25/08/2036                                                                | 1 132                               | 498                              | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/02/2035                                                | 160                                 | 153                              | 0,00                      | Impac Secured Assets Trust                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/02/2034                                                                | 51                                  | 49                               | 0,00                      | 4,434 % éch. 20/04/2036                                                | 673                                 | 637                              | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/01/2037                                     | 2 812                               | 2 492                            | 0,02                      |
| 4,112 % éch. 25/11/2036                                                                | 387                                 | 162                              | 0,00                      | 4,443 % éch. 25/02/2035                                                | 67                                  | 62                               | 0,00                      | IndyMac Mortgage Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,394 % éch. 25/11/2036                                                                | 2 320                               | 1 151                            | 0,01                      | 4,463 % éch. 25/02/2036                                                | 7                                   | 3                                | 0,00                      | 3,177 % éch. 25/01/2036                                     | 18                                  | 16                               | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/08/2035                                                                | 5 673                               | 5 615                            | 0,03                      | 4,523 % éch. 25/09/2034                                                | 12                                  | 12                               | 0,00                      | 3,372 % éch. 25/06/2036                                     | 131                                 | 110                              | 0,00                      |
| 4,486 % éch. 25/11/2035                                                                | 392                                 | 291                              | 0,00                      | 4,669 % éch. 25/11/2034                                                | 82                                  | 78                               | 0,00                      | 3,603 % éch. 25/10/2035                                     | 82                                  | 65                               | 0,00                      |
| 4,487 % éch. 25/08/2036                                                                | 8                                   | 5                                | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                                | 60                                  | 25                               | 0,00                      | 3,609 % éch. 25/08/2035                                     | 71                                  | 51                               | 0,00                      |
| 4,642 % éch. 25/09/2035                                                                | 1 247                               | 641                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/07/2037                                                | 300                                 | 135                              | 0,00                      | 3,618 % éch. 25/03/2036                                     | 1 460                               | 984                              | 0,01                      |
| 4,819 % éch. 25/01/2036                                                                | 692                                 | 661                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                                | 278                                 | 125                              | 0,00                      | 3,655 % éch. 25/03/2036                                     | 454                                 | 331                              | 0,00                      |
| 5,044 % éch. 25/05/2035                                                                | 19                                  | 19                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                                | 1 028                               | 419                              | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/02/2037                                     | 1 271                               | 1 188                            | 0,01                      |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 6,224 % éch. 20/02/2036                                                | 17                                  | 15                               | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/06/2046                                     | 693                                 | 641                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/12/2046                                                                | 289                                 | 260                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/12/2037                                                | 651                                 | 234                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/06/2037                                     | 84                                  | 80                               | 0,00                      |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                                           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/11/2047                                                | 499                                 | 219                              | 0,00                      | 4,355 % éch. 25/12/2034                                     | 37                                  | 35                               | 0,00                      |
| 3,918 % éch. 26/12/2046                                                                | 1 131                               | 880                              | 0,01                      | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust                         |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| Benchmark Mortgage Trust                                                               |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/03/2035                                                | 287                                 | 279                              | 0,00                      | 4,838 % éch. 25/08/2034                                     | 43                                  | 43                               | 0,00                      |
| 4,077 % éch. 15/07/2051                                                                | 12 918                              | 12 888                           | 0,07                      | 6,000 % éch. 25/03/2035                                                | 15                                  | 15                               | 0,00                      | JPMorgan Alternative Loan Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 4,203 % éch. 10/10/2051                                                                | 1 785                               | 1 782                            | 0,01                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                   | 24                                  | 24                               | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/10/2036                                     | 2 023                               | 1 886                            | 0,01                      |
| Chase Mortgage Finance Trust                                                           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/04/2033                                                | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 4,269 % éch. 27/06/2037                                     | 108                                 | 61                               | 0,00                      |
| 4,350 % éch. 25/03/2037                                                                | 350                                 | 326                              | 0,00                      | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                            |                                     |                                  |                           | 5,256 % éch. 25/12/2035                                     | 514                                 | 344                              | 0,00                      |
| 4,763 % éch. 25/07/2037                                                                | 29                                  | 23                               | 0,00                      | 3,850 % éch. 25/09/2057                                                | 6 324                               | 6 048                            | 0,04                      | 5,500 % éch. 25/11/2036                                     | 11                                  | 8                                | 0,00                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,674 % éch. 25/06/2050                                                | 3 548                               | 3 194                            | 0,02                      |                                                             |                                     |                                  |                           |



## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| JPMorgan Mortgage Trust                                      |                                     |                                  |                           | 4,705 % éch. 25/09/2034                                    | \$ 0                                | \$ 0                             | 0,00                      | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           |
| 4,942 % éch. 25/02/2036                                      | \$ 265                              | \$ 174                           | 0,00                      | 4,770 % éch. 25/12/2035                                    | 236                                 | 155                              | 0,00                      | 4,762 % éch. 25/06/2033                                        | \$ 2                                | \$ 1                             | 0,00                      |
| 5,219 % éch. 25/06/2036                                      | 155                                 | 107                              | 0,00                      | 4,882 % éch. 25/09/2034                                    | 104                                 | 102                              | 0,00                      | Wells Fargo Alternative Loan Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 5,293 % éch. 25/02/2036                                      | 87                                  | 55                               | 0,00                      | 5,589 % éch. 25/04/2034                                    | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 5,803 % éch. 28/12/2037                                        | 131                                 | 121                              | 0,00                      |
| 5,326 % éch. 25/11/2033                                      | 14                                  | 13                               | 0,00                      | 5,923 % éch. 25/02/2034                                    | 26                                  | 25                               | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/07/2037                                        | 266                                 | 236                              | 0,00                      |
| 5,397 % éch. 25/07/2035                                      | 23                                  | 22                               | 0,00                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     | 164 186                          | 0,93                      |
| 5,809 % éch. 25/07/2035                                      | 41                                  | 41                               | 0,00                      | 3,457 % éch. 25/05/2047                                    | 2 030                               | 1 630                            | 0,01                      | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                              |                                     |                                  |                           |
| 6,244 % éch. 25/12/2034                                      | 102                                 | 99                               | 0,00                      | 3,883 % éch. 25/08/2036                                    | 1 217                               | 1 086                            | 0,01                      | Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                           |
| Lehman XS Trust                                              |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/01/2037                                    | 852                                 | 781                              | 0,01                      | 3,000 % éch. 01/03/2060                                        | 5 864                               | 5 067                            | 0,03                      |
| 4,123 % éch. 25/12/2036                                      | 1 494                               | 1 556                            | 0,01                      | 4,123 % éch. 25/01/2037                                    | 1 453                               | 1 329                            | 0,01                      | 3,500 % éch. 01/01/2059                                        | 17 542                              | 15 734                           | 0,09                      |
| Luminent Mortgage Trust                                      |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/09/2047                                    | 1 206                               | 1 127                            | 0,01                      | 3,787 % éch. 25/12/2036                                        | 113                                 | 111                              | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/12/2036                                      | 107                                 | 106                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/06/2036                                    | 22                                  | 22                               | 0,00                      | 3,847 % éch. 25/03/2034                                        | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/10/2046                                      | 257                                 | 239                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/10/2036                                    | 1 839                               | 1 661                            | 0,01                      | 3,877 % éch. 25/08/2034                                        | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                        |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/05/2036                                    | 396                                 | 253                              | 0,00                      | 3,877 % éch. 25/08/2034                                        | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 5,370 % éch. 21/11/2034                                      | 47                                  | 47                               | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/09/2047                                    | 1 403                               | 1 311                            | 0,01                      | 4,077 % éch. 25/09/2042                                        | 24                                  | 24                               | 0,00                      |
| MASTR Alternative Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/05/2036                                    | 1 730                               | 1 456                            | 0,01                      | 4,092 % éch. 25/03/2044                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/03/2036                                      | 670                                 | 54                               | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/05/2046                                    | 2 415                               | 766                              | 0,01                      | 4,142 % éch. 25/06/2029                                        |                                     |                                  |                           |
| MASTR Asset Securitization Trust                             |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/09/2047                                    | 18                                  | 16                               | 0,00                      | - 25/06/2036                                                   | 125                                 | 124                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                      | 135                                 | 71                               | 0,00                      | 4,254 % éch. 19/07/2035                                    | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 4,578 % éch. 25/11/2053                                        |                                     |                                  |                           |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust |                                     |                                  |                           | 4,283 % éch. 25/05/2046                                    | 26                                  | 16                               | 0,00                      | - 25/01/2055                                                   | 6 308                               | 6 357                            | 0,04                      |
| 4,180 % éch. 15/12/2030                                      | 13                                  | 13                               | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/02/2036                                    | 215                                 | 184                              | 0,00                      | 4,728 % éch. 25/07/2055                                        | 13 334                              | 13 452                           | 0,08                      |
| 4,394 % éch. 20/10/2029                                      | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 4,334 % éch. 19/07/2034                                    | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 4,778 % éch. 25/03/2055                                        | 15 756                              | 15 893                           | 0,09                      |
| 4,440 % éch. 15/11/2031                                      | 17                                  | 17                               | 0,00                      | 4,414 % éch. 19/09/2032                                    | 5                                   | 4                                | 0,00                      | 4,966 % éch. 01/06/2043                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust                   |                                     |                                  |                           | 4,454 % éch. 19/03/2034                                    | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 4,967 % éch. 01/11/2042                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/01/2037                                      | 8 015                               | 2 343                            | 0,01                      | 5,144 % éch. 25/12/2035                                    | 45                                  | 39                               | 0,00                      | - 01/10/2044                                                   | 28                                  | 29                               | 0,00                      |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                       |                                     |                                  |                           | 5,244 % éch. 25/08/2047                                    | 904                                 | 785                              | 0,01                      | 5,028 % éch. 25/02/2055                                        | 1 923                               | 1 944                            | 0,01                      |
| 4,423 % éch. 25/06/2028                                      | 4                                   | 4                                | 0,00                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust      |                                     |                                  |                           | 5,128 % éch. 25/12/2054                                        | 29 642                              | 30 046                           | 0,17                      |
| 4,837 % éch. 25/12/2034                                      | 69                                  | 66                               | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/01/2036                                    | 57                                  | 49                               | 0,00                      | 5,167 % éch. 01/09/2040                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 5,834 % éch. 25/02/2033                                      | 20                                  | 19                               | 0,00                      | 4,053 % éch. 25/10/2036                                    | 405                                 | 348                              | 0,00                      | 5,545 % éch. 01/04/2033                                        | 19                                  | 19                               | 0,00                      |
| 5,996 % éch. 25/06/2037                                      | 9                                   | 9                                | 0,00                      | TBW Mortgage-Backed Trust                                  |                                     |                                  |                           | 5,641 % éch. 01/04/2033                                        | 17                                  | 18                               | 0,00                      |
| Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust               |                                     |                                  |                           | 6,130 % éch. 25/01/2037                                    | 25                                  | 5                                | 0,00                      | 5,700 % éch. 01/01/2033                                        | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| 3,843 % éch. 25/04/2037                                      | 480                                 | 420                              | 0,00                      | Thornburg Mortgage Securities Trust                        |                                     |                                  |                           | 5,717 % éch. 01/12/2034                                        | 15                                  | 15                               | 0,00                      |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                           |                                     |                                  |                           | 4,016 % éch. 25/09/2037                                    | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 5,748 % éch. 01/06/2035                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 3,128 % éch. 25/11/2037                                      | 411                                 | 282                              | 0,00                      | 5,013 % éch. 25/06/2037                                    | 290                                 | 276                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2043                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,023 % éch. 25/04/2035                                      | 92                                  | 92                               | 0,00                      | 5,989 % éch. 25/06/2037                                    | 1 063                               | 926                              | 0,01                      | - 25/07/2044                                                   | 415                                 | 422                              | 0,00                      |
| 4,389 % éch. 25/11/2035                                      | 17                                  | 13                               | 0,00                      | 6,039 % éch. 25/06/2037                                    | 902                                 | 748                              | 0,01                      | 6,039 % éch. 25/05/2035                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |                                     |                                  |                           | 6,039 % éch. 25/06/2047                                    | 376                                 | 349                              | 0,00                      | 6,055 % éch. 01/10/2034                                        | 11                                  | 11                               | 0,00                      |
| 4,223 % éch. 25/06/2047                                      | 3 113                               | 2 770                            | 0,02                      | 6,089 % éch. 25/03/2037                                    | 459                                 | 326                              | 0,00                      | 6,133 % éch. 01/12/2030                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| New Century Alternative Mortgage Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | Towd Point Mortgage Trust                                  |                                     |                                  |                           | 6,225 % éch. 01/11/2034                                        | 128                                 | 133                              | 0,00                      |
| 6,173 % éch. 25/07/2036                                      | 4 594                               | 863                              | 0,01                      | 3,750 % éch. 25/05/2058                                    | 4 328                               | 4 252                            | 0,03                      | 6,305 % éch. 01/08/2033                                        | 14                                  | 14                               | 0,00                      |
| New Residential Mortgage Loan Trust                          |                                     |                                  |                           | Verus Securitization Trust                                 |                                     |                                  |                           | 6,420 % éch. 01/08/2035                                        | 59                                  | 61                               | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 25/12/2057                                      | 1 261                               | 1 222                            | 0,01                      | 2,829 % éch. 25/10/2066                                    | 4 616                               | 4 214                            | 0,02                      | 6,500 % éch. 01/11/2036                                        | 65                                  | 67                               | 0,00                      |
| Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust         |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust              |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 25/07/2042                                        | 53                                  | 56                               | 0,00                      |
| 4,321 % éch. 25/10/2035                                      | 15                                  | 13                               | 0,00                      | 3,078 % éch. 25/05/2037                                    | 695                                 | 589                              | 0,00                      | Freddie Mac                                                    |                                     |                                  |                           |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                              |                                     |                                  |                           | 3,748 % éch. 25/12/2046                                    | 15                                  | 14                               | 0,00                      | 3,000 % éch. 01/11/2026                                        |                                     |                                  |                           |
| 0,382 % éch. 25/09/2046                                      | 1 220                               | 449                              | 0,00                      | 3,759 % éch. 25/03/2036                                    | 809                                 | 726                              | 0,00                      | - 01/04/2045                                                   | 100                                 | 90                               | 0,00                      |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust                       |                                     |                                  |                           | 3,781 % éch. 25/05/2037                                    | 989                                 | 895                              | 0,01                      | 3,500 % éch. 01/08/2026                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,870 % éch. 25/11/2037                                      | 1 402                               | 1 177                            | 0,01                      | 3,978 % éch. 27/02/2034                                    | 31                                  | 31                               | 0,00                      | - 01/10/2047                                                   | 60                                  | 56                               | 0,00                      |
| 3,913 % éch. 25/02/2047                                      | 396                                 | 118                              | 0,00                      | 4,054 % éch. 25/09/2036                                    | 187                                 | 161                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 01/09/2041                                        | 3                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/06/2037                                      | 739                                 | 727                              | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/04/2045                                    | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 4,022 % éch. 25/09/2031                                        | 12                                  | 12                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/03/2047                                      | 1 273                               | 1 215                            | 0,01                      | 4,235 % éch. 25/12/2036                                    | 343                                 | 319                              | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/08/2031                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/06/2046                                      | 4 580                               | 912                              | 0,01                      | 4,262 % éch. 25/03/2036                                    | 38                                  | 35                               | 0,00                      | 4,157 % éch. 15/12/2031                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/04/2046                                      | 3 480                               | 842                              | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/12/2045                                    | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 4,187 % éch. 15/10/2040                                        | 1 041                               | 1 035                            | 0,01                      |
| 4,208 % éch. 25/08/2035                                      | 37                                  | 11                               | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/07/2045                                    | 170                                 | 165                              | 0,00                      | 4,207 % éch. 15/06/2041                                        | 1 562                               | 1 555                            | 0,01                      |
| 4,263 % éch. 25/08/2037                                      | 273                                 | 268                              | 0,00                      | 4,381 % éch. 25/12/2035                                    | 140                                 | 132                              | 0,00                      | 4,307 % éch. 15/12/2037                                        | 40                                  | 40                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                      | 271                                 | 225                              | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/01/2045                                    | 67                                  | 66                               | 0,00                      | 4,549 % éch. 15/12/2050                                        | 6 532                               | 6 521                            | 0,04                      |
| Residential Asset Securitization Trust                       |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/01/2045                                    | 29                                  | 28                               | 0,00                      | 4,568 % éch. 25/11/2054                                        | 7 979                               | 8 044                            | 0,05                      |
| 4,163 % éch. 25/01/2046                                      | 11                                  | 3                                | 0,00                      | 4,435 % éch. 25/09/2036                                    | 2 087                               | 1 855                            | 0,01                      | 4,578 % éch. 25/03/2055                                        | 14 661                              | 14 806                           | 0,08                      |
| 5,750 % éch. 25/02/2036                                      | 1 527                               | 956                              | 0,01                      | 4,503 % éch. 25/11/2034                                    | 94                                  | 93                               | 0,00                      | 4,608 % éch. 25/08/2055                                        | 5 728                               | 5 752                            | 0,03                      |
| 5,750 % éch. 25/04/2037                                      | 1 087                               | 456                              | 0,00                      | 4,583 % éch. 25/11/2045                                    | 196                                 | 187                              | 0,00                      | 4,628 % éch. 25/08/2055                                        | 2 556                               | 2 582                            | 0,02                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                                      | 764                                 | 262                              | 0,00                      | 4,583 % éch. 25/12/2045                                    | 2 285                               | 2 117                            | 0,01                      | 4,728 % éch. 25/07/2055                                        | 17 383                              | 17 537                           | 0,10                      |
| 6,500 % éch. 25/08/2036                                      | 1 089                               | 277                              | 0,00                      | 4,624 % éch. 25/10/2046                                    | 1 756                               | 1 590                            | 0,01                      | 4,944 % éch. 25/10/2044                                        |                                     |                                  |                           |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust          |                                     |                                  |                           | 4,724 % éch. 25/06/2046                                    | 473                                 | 422                              | 0,00                      | - 25/02/2045                                                   | 611                                 | 570                              | 0,00                      |
| 5,392 % éch. 25/09/2035                                      | 200                                 | 124                              | 0,00                      | 4,744 % éch. 25/02/2046                                    | 1 203                               | 1 120                            | 0,01                      | 5,000 % éch. 15/08/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 25/03/2032                                      | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,744 % éch. 25/08/2046                                    | 54                                  | 51                               | 0,00                      | - 01/12/2039                                                   | 253                                 | 256                              | 0,00                      |
| Sequoia Mortgage Trust                                       |                                     |                                  |                           | 4,944 % éch. 25/11/2042                                    | 15                                  | 15                               | 0,00                      | 5,028 % éch. 25/03/2055                                        | 4 251                               | 4 298                            | 0,02                      |
| 3,876 % éch. 20/01/2047                                      | 166                                 | 113                              | 0,00                      | 4,994 % éch. 25/01/2047                                    | 277                                 | 252                              | 0,00                      | 5,144 % éch. 25/07/2044                                        | 14                                  | 13                               | 0,00                      |
| 4,015 % éch. 20/07/2037                                      | 482                                 | 367                              | 0,00                      | 5,044 % éch. 25/06/2033                                    | 20                                  | 20                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 01/06/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,454 % éch. 19/10/2026                                      | 12                                  | 12                               | 0,00                      | 5,133 % éch. 25/08/2034                                    | 38                                  | 37                               | 0,00                      | - 01/10/2039                                                   | 31                                  | 32                               | 0,00                      |
| 4,454 % éch. 20/07/2033                                      | 64                                  | 65                               | 0,00                      | 5,144 % éch. 25/08/2042                                    | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 15/04/2036                                        | 739                                 | 764                              | 0,00                      |
| 4,514 % éch. 20/10/2027                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,244 % éch. 25/10/2046                                    | 7                                   | 7                                | 0,00                      | 6,076 % éch. 01/09/2037                                        | 54                                  | 56                               | 0,00                      |
| 6,255 % éch. 20/04/2035                                      | 7                                   | 8                                | 0,00                      | 5,270 % éch. 25/09/2033                                    | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 6,280 % éch. 01/10/2033                                        | 12                                  | 12                               | 0,00                      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                           | 5,365 % éch. 25/03/2033                                    | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 6,388 % éch. 01/10/2034                                        | 13                                  | 13                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/10/2035                                      | 236                                 | 229                              | 0,00                      | 5,595 % éch. 25/03/2034                                    | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 6,481 % éch. 01/08/2035                                        | 6                                   | 6                                | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/05/2037                                      | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 5,675 % éch. 25/09/2033                                    | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 6,522 % éch. 01/09/2035                                        | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 4,341 % éch. 25/11/2035                                      | 24                                  | 22                               | 0,00                      | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 01/10/2037                                        | 4                                   | 5                                | 0,00                      |
| 4,343 % éch. 25/08/2035                                      | 61                                  | 53                               | 0,00                      | 4,213 % éch. 25/04/2035                                    | 90                                  | 77                               | 0,00                      | Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,486 % éch. 25/07/2035                                      | 491                                 | 435                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/07/2036                                    | 54                                  | 40                               | 0,00                      | 3,000 % éch. 20/07/2046                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                              |                                     |                                  |                           | 4,684 % éch. 25/07/2046                                    | 388                                 | 241                              | 0,00                      | - 20/11/2055                                                   | 365 290                             | 324 856                          | 1,85                      |
|                                                              |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 20/07/2052                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                              |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           | - 20/03/2056                                                   | 595 357                             | 536 196                          | 3,05                      |
|                                                              |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/04/2039                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                              |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           | - 15/06/2039                                                   | 18                                  | 18                               | 0,00                      |

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,511 % éch. 20/01/2066                                        | \$ 354                              | \$ 355                           | 0,00                      | 4,750 % éch.                                               | \$ 10 800                           | \$ 10 481                        | 0,06                      | <b>BONS DU TRÉSOR NIGÉRIEN</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,591 % éch. 20/08/2066                                        | 959                                 | 964                              | 0,01                      | 15/08/2055                                                 |                                     |                                  |                           | 21,097 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 20/01/2030 - 20/04/2038                           | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 4,750 % éch.                                               | 3 200                               | 3 109                            | 0,02                      | 07/07/2026 (b)(c) NGN                                                                    | 1 533 700                           | \$ 1 114                         | 0,01                      |
| 5,125 % éch. 20/11/2026 - 20/12/2026                           | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 15/02/2056 (j)                                             | 3 200                               | 3 109                            | 0,02                      | 21,137 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 20/08/2026 - 20/09/2026                           | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,875 % éch.                                               | 5 353                               | 5 314                            | 0,03                      | 06/10/2026 (b)(c)                                                                        | 883 876                             | 609                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 20/08/2035 - 15/02/2039                           | 102                                 | 103                              | 0,00                      | 15/08/2045 (j)                                             |                                     |                                  |                           | 14/07/2026 (b)(c)                                                                        | 2 209 691                           | 1 596                            | 0,01                      |
| 5,625 % éch. 20/04/2027 - 20/05/2030                           | 5                                   | 5                                | 0,00                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) |                                     |                                  |                           | 21,322 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 20/02/2055                                        | 270                                 | 280                              | 0,00                      | 0,125 % éch.                                               | 39 501                              | 36 275                           | 0,21                      | 28/07/2026 (b)(c)                                                                        | 1 060 651                           | 760                              | 0,00                      |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | 15/01/2031                                                 | 10 209                              | 9 245                            | 0,05                      | 21,450 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 118 300                             | 100 979                          | 0,57                      | 15/01/2032                                                 | 48 238                              | 47 608                           | 0,27                      | 07/07/2026 (b)(c)                                                                        | 1 917 200                           | 1 393                            | 0,01                      |
| 3,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 129 800                             | 115 214                          | 0,65                      | 0,375 % éch.                                               | 177                                 | 174                              | 0,00                      | 21,480 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 99 500                              | 89 337                           | 0,51                      | 15/01/2027                                                 | 96 673                              | 94 229                           | 0,54                      | 28/07/2026 (b)(c)                                                                        | 1 325 800                           | 950                              | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 660 800                             | 684 559                          | 3,89                      | 0,375 % éch.                                               | 6 073                               | 5 626                            | 0,03                      | 21,587 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Administration des petites entreprises                         |                                     |                                  |                           | 15/07/2027                                                 | 10 213                              | 9 988                            | 0,06                      | 04/08/2026 (b)(c)                                                                        | 197 700                             | 141                              | 0,00                      |
| 5,490 % éch. 01/05/2028                                        | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 0,500 % éch.                                               | 102 714                             | 97 185                           | 0,55                      | 21,625 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,600 % éch. 01/09/2028                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 15/01/2028                                                 | 21 924                              | 21 037                           | 0,12                      | 11/08/2026 (b)(c)                                                                        | 3 497 400                           | 2 485                            | 0,01                      |
| 5,680 % éch. 01/06/2028                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 0,625 % éch.                                               | 28 128                              | 27 942                           | 0,16                      | 21,638 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,220 % éch. 01/12/2028                                        | 13                                  | 13                               | 0,00                      | 15/07/2032                                                 | 35 435                              | 35 824                           | 0,20                      | 11/08/2026 (b)(c)                                                                        | 2 300 600                           | 1 635                            | 0,01                      |
| Tennessee Valley Authority                                     |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch.                                               | 62 492                              | 63 302                           | 0,36                      | 21,659 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 15/05/2035                                        | 14 000                              | 14 319                           | 0,08                      | 15/07/2028                                                 | 40 099                              | 42 122                           | 0,24                      | 25/08/2026 (b)(c)                                                                        | 1 342 200                           | 946                              | 0,01                      |
| 5,880 % éch. 01/04/2036                                        | 500                                 | 551                              | 0,00                      | 1,125 % éch.                                               |                                     |                                  |                           | 18/08/2026 (b)(c)                                                                        | 766 900                             | 543                              | 0,00                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | 15/01/2033                                                 | 2 400                               | 2 291                            | 0,01                      | 21,676 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/05/2030 - 01/06/2031                           | 1 201                               | 1 155                            | 0,01                      | 1,375 % éch.                                               | 100                                 | 95                               | 0,00                      | 11/08/2026 (b)(c)                                                                        | 1 186 200                           | 843                              | 0,01                      |
| 3,000 % éch. 01/01/2027                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 15/01/2028                                                 | 25 100                              | 23 952                           | 0,14                      | 21,690 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/11/2034 - 01/02/2050                           | 9 699                               | 9 045                            | 0,05                      | 2,375 % éch.                                               | 1 100                               | 1 089                            | 0,01                      | 07/07/2026 (b)(c)                                                                        | 1 748 700                           | 1 271                            | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 01/06/2038 - 01/08/2053                           | 11 297                              | 10 713                           | 0,06                      | 3,875 % éch.                                               | 3 100                               | 3 079                            | 0,02                      | 21,699 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 01/05/2027 - 01/09/2053                           | 7 868                               | 7 617                            | 0,04                      | 15/04/2029                                                 | 27 500                              | 26 872                           | 0,15                      | 25/08/2026 (b)(c)                                                                        | 1 049 200                           | 740                              | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 01/01/2056                                        | 580                                 | 570                              | 0,00                      | Billets du Trésor américain                                | 39 340                              | 38 387                           | 0,22                      | 21,702 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 01/01/2035 - 01/01/2055                           | 171 411                             | 172 666                          | 0,98                      | 0,375 % éch.                                               |                                     |                                  |                           | 18/08/2026 (b)(c)                                                                        | 2 938 900                           | 2 080                            | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 01/12/2053 - 01/09/2054                           | 179 775                             | 184 221                          | 1,05                      | 30/09/2027                                                 | 100                                 | 99                               | 0,00                      | 21,704 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/06/2036 - 01/01/2054                           | 7 247                               | 7 539                            | 0,04                      | 0,750 % éch.                                               | 200                                 | 198                              | 0,00                      | 01/09/2026 (b)(c)                                                                        | 1 049 200                           | 737                              | 0,00                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch.                                               | 10 093                              | 9 966                            | 0,06                      |                                                                                          |                                     | 17 843                           | 0,10                      |
| 2,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 158 350                             | 132 285                          | 0,75                      | 3,750 % éch.                                               |                                     | 2 072 260                        | 11,77                     | Total des Instruments à court terme                                                      |                                     | 215 274                          | 1,22                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/09/2056                           | 322 950                             | 301 688                          | 1,71                      | 4,000 % éch.                                               |                                     | 12 088 852                       | 68,65                     | <b>Total des Valeurs mobilières</b>                                                      | <b>\$ 23 711 752</b>                | <b>134,65</b>                    |                           |
| 4,500 % éch. 01/07/2056 - 01/09/2056                           | 595 761                             | 570 212                          | 3,24                      | 15/02/2034                                                 |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 4 405 260                           | 4 324 290                        | 24,56                     | 4,125 % éch.                                               |                                     |                                  |                           | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 214 700                             | 215 126                          | 1,22                      | 15/02/2036 (j)                                             |                                     |                                  |                           | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/07/2056                                        | 73 073                              | 74 710                           | 0,42                      | 4,250 % éch.                                               |                                     |                                  |                           | PIMCO Funds: Global Investors Series                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/07/2056                                        | 115 195                             | 119 172                          | 0,68                      | 15/05/2035                                                 |                                     |                                  |                           | plc - Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)                                | 5 766 349                           | 90 243                           | 0,51                      |
|                                                                | 8 152 463                           | 46,29                            |                           | 4,250 % éch.                                               |                                     |                                  |                           | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (f) | 1 355 380                           | 20 687                           | 0,12                      |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                         |                                     |                                  |                           | 15/08/2035                                                 |                                     |                                  |                           | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Bond Ex-US Fund (f)               | 10 956 929                          | 130 168                          | 0,74                      |
| Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           | 10/11/2026 (b)(c)                                          | 132 125                             | 2 479                            | 0,02                      | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Bond Opportunities Fund (f)      | 327 056                             | 3 306                            | 0,02                      |
| 1,375 % éch. 15/11/2040                                        | 61 050                              | 39 488                           | 0,22                      | <b>BONS DU TRÉSOR HONGROIS</b>                             |                                     |                                  |                           | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds UK Corporate Bond Fund (f)              | 4 923 621                           | 68 290                           | 0,39                      |
| 1,875 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           | 6,082 % éch.                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/02/2041 (j)                                                 | 205 300                             | 142 511                          | 0,81                      | 02/07/2026 (b)(c) HUF                                      | 27 552 000                          | 88 503                           | 0,50                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 1,875 % éch. 15/02/2051                                        | 100                                 | 56                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 15/08/2051                                        | 7 100                               | 4 044                            | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 15/08/2049                                        | 72 000                              | 44 800                           | 0,25                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,875 % éch. 15/05/2052                                        | 26 900                              | 18 613                           | 0,11                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/02/2048                                        | 35 300                              | 25 999                           | 0,15                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/02/2049                                        | 46 400                              | 33 843                           | 0,19                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 15/05/2042                                        | 200                                 | 165                              | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/11/2048 (j)                                                 | 137 500                             | 107 588                          | 0,61                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/08/2044 (j)                                                 | 259 800                             | 235 038                          | 1,34                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/02/2044                                        | 21 800                              | 20 768                           | 0,12                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/11/2054 (j)                                                 | 641 200                             | 597 005                          | 3,39                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/02/2046 (j)                                                 | 6 300                               | 6 049                            | 0,03                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 15/02/2055 (j)                                                 | 183 700                             | 174 608                          | 0,99                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                          |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                 | ACTIONS      | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------|---------------------------|
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (f)         | 391 385 | \$ 4 020                         | 0,02                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Global Government Bond UCITS ETF (f) | 220 000      | \$ 5 757                         | 0,03                      |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 246 495 | 2 458                            | 0,02                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)              | 3 455 880    | 385 635                          | 2,19                      |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f)          | 345 274 | 5 407                            | 0,03                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)         | 4 369 740    | 439 071                          | 2,49                      |
|                                                                                 |         | 324 579                          | 1,85                      |                                                                             |              | 851 067                          | 4,83                      |
| <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                                                 |         |                                  |                           | <b>Total des Fonds d'investissement</b>                                     |              |                                  |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro Government Bond UCITS ETF (f)       | 710 000 | 20 604                           | 0,12                      |                                                                             | \$ 1 175 646 | 6,68                             |                           |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                       | Long  | 12/2026              | 9 628                 | \$ (2 734)                              | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Long  | 09/2026              | 174                   | 65                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Short | 09/2026              | 2 704                 | (2 909)                                 | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre           | Short | 09/2026              | 1 395                 | (755)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026              | 2 269                 | 3 436                                   | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Short | 09/2026              | 4 877                 | (2 435)                                 | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026              | 10 798                | 17 876                                  | 0,10                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Short | 09/2026              | 5 524                 | (7 540)                                 | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Short | 09/2026              | 65                    | (173)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Short | 09/2026              | 6 992                 | (3 866)                                 | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Short | 09/2026              | 10 392                | (1 121)                                 | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Short | 09/2026              | 1 739                 | (3 282)                                 | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 4 611                 | (34)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 10 011                | 9 244                                   | 0,05                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 17 107                | 20 004                                  | 0,11                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Short | 09/2026              | 558                   | (1 596)                                 | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026              | 6 048                 | 17 153                                  | 0,10                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ 41 333                               | 0,23                   |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>                 |       |                      |                       | <b>\$ 41 333</b>                        | <b>0,23</b>            |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Deutsche Bank AG    | 1,000 %                 | 20/12/2032         | € 500                               | \$ 5                                    | 0,00                   |
| Stellantis NV       | 5,000                   | 20/12/2030         | 400                                 | (7)                                     | 0,00                   |
|                     |                         |                    |                                     | \$ (2)                                  | 0,00                   |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 10 ans            | (1,000) %              | 20/12/2035         | \$ 68 455                           | \$ (103)                                | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans            | (1,000)                | 20/06/2036         | 310 600                             | (755)                                   | 0,00                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | (1,000)                | 20/06/2031         | € 999 200                           | (2 887)                                 | (0,02)                 |
|                                            |                        |                    |                                     | \$ (3 745)                              | (0,02)                 |



SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 1 117 188                     | \$ 944                            | 0,01                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 2 515 780                        | 2 572                             | 0,01                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 3 516                          | 0,02                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,000 %   | 17/06/2027      | £ 357 180         | \$ 2 052                          | 0,01                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2028      | 268 000           | (1 539)                           | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2028      | 2 045 570         | 6 081                             | 0,04                |
| À payer <sup>(4)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031      | 365 040           | 3 916                             | 0,02                |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 17/03/2028      | 9 800             | 63                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036      | 655 455           | (8 548)                           | (0,05)              |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 16 010            | (514)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056      | 31 700            | (960)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 5,750     | 18/03/2031      | INR 2 056 280     | 314                               | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 17/03/2031      | ¥ 14 710 000      | (285)                             | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050     | 15/12/2031      | 17 222 400        | (727)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 19/06/2039      | 13 160 000        | 2 184                             | 0,01                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,600     | 18/12/2029      | 16 240 000        | (57)                              | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750     | 19/03/2027      | 37 770 000        | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750     | 19/03/2030      | 30 810 000        | (129)                             | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 19/03/2032      | 67 820 000        | (2 554)                           | (0,01)              |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/09/2034      | 72 160 000        | (5 830)                           | (0,03)              |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 19/03/2035      | 34 570 000        | (3 609)                           | (0,02)              |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 19/06/2044      | 7 464 800         | (1 772)                           | (0,01)              |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 18/06/2035      | 2 500 000         | (299)                             | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 17/09/2035      | 74 980 600        | (7 274)                           | (0,04)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2028      | 366 773 000       | (2 710)                           | (0,01)              |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 17/12/2035      | 5 920 000         | (664)                             | 0,00                |
| À payer                           | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/03/2036      | 9 650 000         | (2 395)                           | (0,01)              |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/09/2054      | 1 186 200         | 289                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 19/03/2055      | 1 130 000         | 307                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      | 100 074 000       | 3 227                             | 0,02                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,500     | 18/03/2056      | 1 350 000         | 670                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      | SGD 953 526       | 3 540                             | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2031      | 507 000           | (1 593)                           | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 16/09/2031      | THB 6 413 700     | (785)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 16/09/2031      | 770 400           | (73)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2027      | \$ 185 971        | 103                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,965     | 30/11/2026      | 472 600           | 1 807                             | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2027      | 725 640           | 1 904                             | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      | 387 560           | 1 547                             | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2027      | 215 540           | 523                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031      | 399 567           | (1 191)                           | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 16/09/2031      | 6 000             | (11)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2035      | 258 970           | 2 454                             | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2055      | 12 730            | 55                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,300     | 31/05/2027      | 100 800           | 248                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 15/03/2028      | 550 880           | 3 560                             | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 154 080           | 1 753                             | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2028      | 37 590            | (249)                             | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2031      | 895 930           | 10 606                            | 0,06                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/06/2033      | 19 300            | 218                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055      | 21 200            | 130                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,548     | 31/08/2030      | 82 300            | (938)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 3 700             | 45                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,557     | 31/08/2030      | 142 100           | (1 619)                           | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,564     | 31/01/2033      | 3 400             | 39                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,574     | 31/08/2030      | 90 400            | (1 030)                           | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,582     | 31/08/2030      | 94 300            | (1 075)                           | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,583     | 31/08/2030      | 104 600           | (1 192)                           | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,587     | 31/08/2030      | 69 700            | (794)                             | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,599     | 31/08/2030      | 120 000           | (1 368)                           | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,605     | 28/08/2034      | 20 300            | 261                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,629     | 31/08/2030      | 165 100           | (1 882)                           | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,637     | 31/08/2030      | 63 800            | (727)                             | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,643     | 31/08/2030      | 57 500            | (656)                             | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,646     | 31/08/2030      | 157 300           | (1 794)                           | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,649     | 31/08/2030      | 1 700             | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,672     | 31/01/2033      | 54 000            | 621                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,678     | 31/01/2033      | 93 500            | 1 075                             | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/01/2033      | 61 200            | 704                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,693     | 31/01/2033      | 68 000            | 782                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,698     | 31/01/2033      | 46 200            | 531                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 31/01/2033      | 59 700            | 687                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 20/02/2049      | 1 900             | 9                                 | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,714 %   | 31/01/2033      | \$ 73 600         | \$ 847                            | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 07/08/2034      | 35 410            | 493                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 102 931           | 1 040                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 31/01/2033      | 44 100            | 507                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 03/03/2036      | 68 000            | 659                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2026      | 13 500            | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      | 1 276 800         | (6 371)                           | (0,04)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 1 800             | (20)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035      | 264 000           | 2 870                             | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 743 180           | 7 229                             | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 1 012 385         | (179)                             | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 22 200            | (49)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 164 200           | (580)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,752     | 31/01/2033      | 136 200           | 1 567                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,755     | 31/01/2033      | 104 600           | 1 204                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,755     | 15/02/2036      | 9 400             | 91                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,773     | 04/03/2055      | 29 000            | 107                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      | 63 800            | 616                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,804     | 15/02/2055      | 15 200            | 55                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,850     | 05/08/2034      | 28 900            | 338                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,851     | 28/02/2029      | 135 500           | 1 219                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,861     | 15/02/2055      | 11 800            | 41                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,862     | 28/02/2029      | 133 200           | 1 195                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 15/08/2026      | 163 400           | 50                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,922     | 15/11/2054      | 17 600            | 55                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 24/03/2035      | 29 000            | 295                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 25/06/2055      | 30 900            | 128                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,940     | 15/11/2054      | 12 100            | 36                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,955     | 15/11/2054      | 21 800            | 64                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,959     | 15/11/2054      | 31 500            | 92                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 27/06/2055      | 38 471            | 173                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,964     | 15/11/2054      | 19 600            | 57                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      | 21 600            | 219                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,988     | 15/11/2053      | 25 900            | 106                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,990     | 15/11/2054      | 12 000            | 34                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,993     | 15/11/2054      | 18 300            | 51                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      | 3 400             | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 59 100            | (175)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 121 990           | 406                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 219 020           | 2 077                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2056      | 13 660            | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 28 020            | 87                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 16/09/2056      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,005     | 29/09/2055      | 11 439            | 33                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 2 350             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,015     | 15/11/2053      | 2 800             | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,052     | 15/02/2056      | 2 800             | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,065     | 26/06/2055      | 19 479            | 85                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,066     | 15/02/2046      | 2 000             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,076     | 15/02/2046      | 3 200             | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,082     | 15/11/2053      | 2 700             | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,111     | 15/11/2054      | 29 100            | 65                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,115     | 15/11/2054      | 16 940            | 38                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,117     | 15/11/2054      | 4 110             | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,130     | 15/11/2054      | 39 350            | 85                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,222     | 15/11/2052      | 13 000            | 49                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,224     | 15/11/2052      | 13 000            | 49                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,225     | 15/11/2052      | 25 200            | 95                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,227     | 15/11/2052      | 38 600            | 145                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,228     | 15/11/2052      | 11 300            | 43                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,232     | 15/11/2052      | 12 300            | 46                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,233     | 15/11/2052      | 22 000            | 83                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,238     | 15/11/2052      | 15 700            | 59                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,244     | 15/11/2052      | 17 500            | 66                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,245     | 15/11/2052      | 34 900            | 131                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,248     | 15/11/2052      | 26 000            | 98                                | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,713     | 02/10/2029      | CAD 81 100        | 208                               | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,900     | 18/12/2029      | 76 500            | 249                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,740     | 01/06/2034      | 6 300             | (46)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | 336 500           | (946)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/09/2029      | 151 800           | 401                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/06/2033      | 14 000            | (81)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,880     | 01/09/2033      | 48 600            | (345)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      | 135 300           | (702)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2033      | 20 000            | (110)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2034      | 6 000             | (41)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,180     | 01/06/2033      | 140 200           | (721)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 15/03/2033      | 88 700            | (544)                             | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 21/06/2053      | 2 300             | 42                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,300     | 01/06/2033      | 65 400            | (321)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,400     | 01/06/2033      | 17 700            | (83)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 01/09/2033      | 78 900            | (550)                             | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,700 %   | 01/09/2033      | CAD 31 200        | \$ (216)                          | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750     | 20/12/2033      | 10 100            | (42)                              | 0,00                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,000     | 18/03/2028      | CHF 537 000       | 1 335                             | 0,01                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 18/03/2031      | 92 800            | 588                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 16/09/2031      | 171 780           | 2 769                             | 0,02                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,283     | 14/02/2027      | 47 000            | 63                                | 0,00                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,294     | 10/02/2027      | 42 300            | 59                                | 0,00                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,343     | 16/05/2027      | 31 300            | 21                                | 0,00                |
| À payer                                            | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 17/06/2031      | CNY 806 400       | 579                               | 0,00                |
| À payer                                            | KORIBOR KRW à 3 mois              | 2,750     | 18/03/2036      | KRW 201 971 940   | (14 052)                          | (0,08)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/12/2028      | NZD 738 200       | 2 045                             | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/09/2029      | 224 300           | 1 000                             | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR NZD à 3 mois                  | 4,000     | 16/12/2031      | 67 700            | 398                               | 0,00                |
| À payer                                            | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,474     | 03/02/2030      | SEK 393 000       | 612                               | 0,00                |
| À payer                                            | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,500     | 18/03/2031      | 2 834 250         | 4 152                             | 0,02                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,750     | 16/09/2031      | 1 174 450         | 1 296                             | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,300     | 08/06/2036      | ZAR 523 600       | 861                               | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,500     | 18/03/2031      | AUD 1 646 830     | 15 351                            | 0,09                |
| À recevoir                                         | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,750     | 18/03/2031      | 491 500           | (4 600)                           | (0,03)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 19/03/2035      | 98 600            | 1 391                             | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 17/09/2035      | 140 480           | 2 038                             | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | 160 360           | 2 374                             | 0,01                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 16/09/2031      | 121 000           | (695)                             | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 19/03/2035      | 76 900            | 1 085                             | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/06/2035      | 42 900            | 594                               | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 17/09/2035      | 169 400           | 2 459                             | 0,01                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2036      | 517 300           | (2 129)                           | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2056      | 9 600             | (120)                             | 0,00                |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois               | 1,913     | 30/01/2029      | CZK 158 300       | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,335     | 01/07/2036      | 421 700           | (8)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,375     | 01/07/2036      | 474 800           | 23                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,523     | 01/12/2035      | 943 500           | 499                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,451     | 27/05/2050      | € 19 900          | 563                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,795     | 11/10/2029      | 53 450            | 232                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,923     | 11/10/2029      | 1 900             | 10                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,929     | 11/10/2029      | 159 180           | 809                               | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,170     | 15/12/2028      | 752 400           | 1 183                             | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | 1 942 055         | 4 391                             | 0,03                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,350     | 15/12/2028      | 762 500           | (1 155)                           | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 513 350           | 4 366                             | 0,03                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 819 290           | 14 787                            | 0,08                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 18/09/2039      | 46 900            | (1 850)                           | (0,01)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 18/03/2041      | 9 100             | (229)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,825     | 19/09/2055      | 525 700           | (45)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 147 830           | 3 522                             | 0,02                |
| À payer                                            | NIBOR NOK à 6 mois                | 3,750     | 18/03/2031      | NOK 1 204 780     | 547                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | NIBOR NOK à 6 mois                | 4,500     | 16/09/2031      | 88 580            | 40                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,625     | 01/07/2036      | PLN 85 300        | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,665     | 01/07/2036      | 76 000            | (24)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,723     | 01/12/2035      | 168 300           | (747)                             | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 55 921                         | 0,32                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 55 690                         | 0,32                |

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

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

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

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

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 36 181                           | \$ 367   | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 8 055                            | 55       | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre SGD hors cote  | SGD 1,315       | 05/11/2026        | 44 327                           | 317      | 112          | 0,00                |
| BPS          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 13/08/2026        | 16 289                           | 59       | 3            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | 24,040          | 13/08/2026        | 92                               | 0        | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 89 478                           | 371      | 147          | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 89 478                           | 194      | 312          | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 69 289                           | 637      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 69 289                           | 554      | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 2 554 | \$ 574       | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 54 860                           | \$ (723)   | \$ (150)     | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 16 859                           | (216)      | (59)         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 36 181                           | (129)      | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 8 055                            | (18)       | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre SGD hors cote | SGD 1,237       | 05/11/2026        | 44 327                           | (316)      | (62)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 89 478                           | (464)      | (897)        | (0,01)              |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 69 289                           | (215)      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 69 289                           | (179)      | 0            | 0,00                |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 1 978                            | (25)       | (6)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 65 540                           | (1 040)    | (564)        | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (3 325) | \$ (1 738)   | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %           | 20/12/2029      | \$ 39 200                        | \$ (1 308)             | \$ 218                            | \$ (1 090)   | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)             | 20/12/2030      | 52 300                           | (1 922)                | 185                               | (1 737)      | (0,01)              |
|              |                                                      |                     |                 |                                  | \$ (3 230)             | \$ 403                            | \$ (2 827)   | (0,01)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index 35-100 % à 5 ans     | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 2 840                          | \$ 659                 | \$ (55)                           | \$ 604       | 0,00                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index 35-100 % à 5 ans     | 5,000                | 20/12/2030      | 28 830                           | 6 361                  | (226)                             | 6 135        | 0,03                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index 35-100 % à 5 ans     | 5,000                | 20/12/2030      | 5 350                            | 1 213                  | (74)                              | 1 139        | 0,01                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index 35-100 % à 5 ans     | 5,000                | 20/12/2030      | 23 690                           | 4 962                  | 79                                | 5 041        | 0,03                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 |                      |                 |                                  |                        |                                   |              |                     |
|              | Index 35-100 % à 5 ans     | 5,000                | 20/12/2030      | 70 220                           | 15 263                 | (321)                             | 14 942       | 0,09                |
|              |                            |                      |                 |                                  | \$ 28 458              | \$ (597)                          | \$ 27 861    | 0,16                |

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

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

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

## SWAPS SUR DEVICES CROISEES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                           | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,357 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027      | \$ 654 817                           | ¥ 98 222 600                          | \$ 5 089               | \$ 547                           | \$ 5 636     | 0,03                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 40 335                               | 6 372 900                             | 186                    | 273                              | 459          | 0,00                |
| FAR          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,442 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 151 185                              | 22 200 000                            | 242                    | 1 004                            | 1 246        | 0,01                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 388 665                              | 61 409 000                            | 1 698                  | 2 638                            | 4 336        | 0,03                |
| GLM          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,301 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR GBP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 15/10/2045      | 29 172                               | £ 21 934                              | (10)                   | 61                               | 51           | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,315 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027      | 635 574                              | ¥ 98 514 000                          | (1 459)                | 308                              | (1 151)      | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,323 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR GBP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 22/10/2045      | 110 736                              | £ 82 503                              | (104)                  | 352                              | 248          | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,425 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 31 429                               | ¥ 4 620 000                           | 42                     | 186                              | 228          | 0,00                |
|              |                                                                                                                      |                                                                                                         |                 |                                      |                                       | \$ 5 684               | \$ 5 369                         | \$ 11 053    | 0,06                |

## SWAPS DE TAUX D'INTERET

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500 %   | 17/03/2032      | CNY 196 100       | \$ (249)               | \$ 273                           | \$ 24        | 0,00                |
| BPS          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 1 150 350         | (1 454)                | 1 592                            | 138          | 0,00                |
| JPM          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 1 103 300         | (694)                  | 827                              | 133          | 0,00                |
| SCX          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 942 300           | (592)                  | 705                              | 113          | 0,00                |
|              |                                  |                         |           |                 |                   | \$ (2 989)             | \$ 3 397                         | \$ 408       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                 | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | À recevoir         | Indice SIBCSORA Index | S/O                          | 1,215 %       | SGD 1 640         | 26/08/2026      | \$ 0                   | \$ 25                            | \$ 25        | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer |               | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |      |
|--------------|----------------------|--------------------|---------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|------|
| AZD          | 07/2026              | AUD                | 156 545       | \$                   | 111 942               | \$ 3 488                 | \$ 0                                          | 0,02                   |      |
|              | 07/2026              | CNH                | 16 044        |                      | 2 376                 | 12                       | 12                                            | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | NZD                | 111 151       |                      | 65 644                | 2 416                    | 0                                             | 0,01                   |      |
|              | 07/2026              | SGD                | 5 431         |                      | 4 259                 | 60                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 7 880         | CAD                  | 11 202                | 15                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 56 055        | NZD                  | 99 128                | 385                      | (51)                                          | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | CAD                | 11 186        | \$                   | 7 880                 | 0                        | (15)                                          | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | NZD                | 97 440        |                      | 55 106                | 0                        | (385)                                         | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | BRL                | 2 034         |                      | 390                   | 0                        | (3)                                           | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | CAD                | 14 369        |                      | 10 325                | 197                      | 0                                             | 0,00                   |      |
| BOA          | 07/2026              | DKK                | 121           | €                    | 16                    | 0                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | £                  | 50            | \$                   | 67                    | 1                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | ILS                | 36            |                      | 12                    | 0                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | ¥                  | 776 586       |                      | 4 882                 | 104                      | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | KRW                | 15 641 473    |                      | 10 271                | 168                      | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | NOK                | 43 965        |                      | 4 445                 | 2                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | PEN                | 39 826        |                      | 11 765                | 89                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | SGD                | 3 210         |                      | 2 516                 | 34                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 2 644         | AUD                  | 3 691                 | 0                        | (87)                                          | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 12 327        | BRL                  | 64 072                | 52                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 30 989        | CNH                  | 209 548               | 0                        | (119)                                         | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 20 559        | CNY                  | 140 831               | 157                      | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 9 479         | COP                  | 32 663 700            | 0                        | (48)                                          | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 17 153        | ¥                    | 2 728 800             | 0                        | (363)                                         | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 9 065         | NOK                  | 84 184                | 0                        | (557)                                         | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 11 765        | PEN                  | 39 816                | 0                        | (90)                                          | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 1 164         | PLN                  | 4 394                 | 5                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 13 514        | SGD                  | 17 328                | 1                        | (118)                                         | 0,00                   |      |
|              | 07/2026              |                    | 9 139         | TWD                  | 290 134               | 0                        | (37)                                          | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | BRL                | 16 961        | \$                   | 3 239                 | 0                        | (12)                                          | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | HKD                | 79 801        |                      | 10 199                | 5                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | ILS                | 28 549        |                      | 9 599                 | 7                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | PEN                | 51 462        |                      | 14 656                | 0                        | (412)                                         | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | SGD                | 1 461         |                      | 1 131                 | 0                        | (1)                                           | 0,00                   |      |
|              | 08/2026              | \$                 | 213 252       | BRL                  | 1 090 018             | 0                        | (4 298)                                       | (0,02)                 |      |
|              | 08/2026              | ZAR                | 35 143        | \$                   | 2 018                 | 0                        | (118)                                         | 0,00                   |      |
|              | 09/2026              | COP                | 261 160 460   |                      | 67 746                | 0                        | (6 692)                                       | (0,04)                 |      |
|              | 09/2026              | INR                | 512 971       |                      | 5 397                 | 14                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 09/2026              | KZT                | 134 328       |                      | 267                   | 0                        | (7)                                           | 0,00                   |      |
|              | 09/2026              | MXN                | 33 013        |                      | 1 862                 | 0                        | (15)                                          | 0,00                   |      |
|              | 09/2026              | PEN                | 76 773        |                      | 22 497                | 101                      | (50)                                          | 0,00                   |      |
|              | 10/2026              | COP                | 33 435 269    |                      | 9 479                 | 41                       | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 10/2026              | HUF                | 1 118 179     | €                    | 3 035                 | 0                        | (93)                                          | 0,00                   |      |
|              | 10/2026              | ZAR                | 3 194         | \$                   | 196                   | 3                        | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | 12/2026              | PEN                | 11 728        |                      | 3 397                 | 0                        | (20)                                          | 0,00                   |      |
|              | 01/2027              | ZAR                | 307 528       |                      | 18 704                | 250                      | 0                                             | 0,00                   |      |
|              | BPS                  | 07/2026            | BRL           | 36 189               |                       | 6 965                    | 0                                             | (27)                   | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            | CHF           | 11 674               |                       | 14 840                   | 368                                           | 0                      | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            | CNH           | 2 215 461            |                       | 327 392                  | 1 013                                         | 0                      | 0,01 |
|              |                      | 07/2026            | CNY           | 161 361              |                       | 23 681                   | 0                                             | (64)                   | 0,00 |
| 07/2026      |                      | €                  | 0             | SEK                  | 5                     | 0                        | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 82 010        | \$                   | 93 074                | 0                        | (688)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | £                  | 513 232       |                      | 687 587               | 6 428                    | (28)                                          | 0,04                   |      |
| 07/2026      |                      | IDR                | 1 650 178 924 |                      | 92 058                | 64                       | (66)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | ILS                | 46 620        |                      | 15 819                | 164                      | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | INR                | 2 995 787     |                      | 31 140                | 0                        | (508)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | ¥                  | 4 155 494     |                      | 26 082                | 513                      | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | KRW                | 7 203 347     |                      | 4 723                 | 71                       | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | NOK                | 33 415        |                      | 3 398                 | 21                       | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | SEK                | 5 245         |                      | 547                   | 5                        | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | THB                | 427 927       |                      | 13 046                | 175                      | (21)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | TRY                | 56 946        |                      | 1 191                 | 0                        | (15)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      | \$                 | 6 240         | AUD                  | 9 026                 | 28                       | (15)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 17 634        | BRL                  | 90 012                | 7                        | (254)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 632           | CLP                  | 579 364               | 0                        | (3)                                           | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 32 083        | CNY                  | 218 641               | 46                       | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 8 844         | CZK                  | 184 054               | 0                        | (173)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 9 553         | €                    | 8 368                 | 20                       | (6)                                           | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 13 740        | £                    | 10 397                | 80                       | (20)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 70 642        | HUF                  | 21 578 811            | 0                        | (1 374)                                       | (0,01)                 |      |
| 07/2026      |                      |                    | 105 085       | INR                  | 9 989 439             | 451                      | (162)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 4 927         | ¥                    | 797 000               | 0                        | (24)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 21 701        | KRW                  | 33 287 965            | 0                        | (196)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 3 086         | KWD                  | 943                   | 0                        | (43)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 2 830         | NOK                  | 26 875                | 0                        | (114)                                         | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 1 338         | NZD                  | 2 296                 | 0                        | (32)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 381           | PLN                  | 1 432                 | 0                        | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 509           | SEK                  | 4 830                 | 0                        | (10)                                          | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 2 482         | SGD                  | 3 208                 | 0                        | (2)                                           | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 741           | TRY                  | 35 169                | 6                        | 0                                             | 0,00                   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 2 997         | TWD                  | 94 590                | 0                        | (30)                                          | 0,00                   |      |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | ZAR             | 337 516 \$        | 20 573 \$          | 13                    | \$ 13                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 518               | 99                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK             | 92 892 €          | 3 812              | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 5 653 \$          | 1 896              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 5 €               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 6 146 498 \$      | 193 408            | 886                   | 886                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 15 818 BRL        | 80 564             | 0                     | (374)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | BRL             | 8 774 \$          | 1 664              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP             | 579 364           | 632                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 187 885 868       | 10 347             | 0                     | (67)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 20 605            | 6 013              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 396 124           | 12 210             | 211                   | 211                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 55 807 IDR        | 987 823 380        | 63                    | (1 114)                                 | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 3 522 INR         | 334 600            | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2 317 THB         | 75 930             | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 6 702 IDR         | 122 015 666        | 17                    | 17                                      | 0,00                |
|              | 01/2027           |                 | 1 012 TWD         | 31 783             | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 02/2027           |                 | 136 000           | 4 232 320          | 0                     | (3 943)                                 | (0,02)              |
|              | 06/2027           |                 | 1 536 KWD         | 466                | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD             | 10 514 \$         | 36 145             | 1 856                 | 1 856                                   | 0,01                |
|              | 07/2029           |                 | 1 012             | 3 480              | 179                   | 179                                     | 0,00                |
|              | 05/2030           |                 | 7 566             | 26 055             | 1 335                 | 1 335                                   | 0,01                |
|              | 06/2031           |                 | 3 095             | 10 412             | 281                   | 281                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | COP             | 13 018 800        | 3 429              | 0                     | (324)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 57 224            | 19 334             | 119                   | 119                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 343 353           | 2 124              | 11                    | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 576 355           | 141 908            | 815                   | 815                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 160 440           | 94 881             | 3 615                 | 3 615                                   | 0,02                |
|              | 07/2026           | SGD             | 26 115            | 20 333             | 143                   | 143                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 738 897           | 15 457             | 0                     | (194)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 32 173 CNH        | 217 740            | 0                     | (95)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 782 COP         | 13 018 800         | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 077 £           | 3 085              | 17                    | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 872 SGD         | 3 712              | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 145 526 TRY       | 6 939 959          | 1 835                 | 1 835                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 1 970 862 \$      | 119 806            | 1 082                 | (1 333)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 8 841 776         | 2 342              | 0                     | (203)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 124 ¥           | 342 453            | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 13 018 800 \$     | 3 734              | 24                    | 24                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | ZAR             | 98 780            | 5 612              | 0                     | (333)                                   | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | €               | 4 520 712         | 5 270 857          | 102 326               | 102 326                                 | 0,58                |
|              | 07/2026           | ¥               | 13 920 366        | 87 552             | 1 901                 | 1 901                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 92 790            | 164 229            | 632                   | 632                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12 482 NZD        | 42 590             | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 164 229 \$        | 92 895             | 0                     | (632)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 140 985 208       | 36 376             | 0                     | (3 808)                                 | (0,02)              |
|              | 09/2026           | PEN             | 358 056           | 105 412            | 1 180                 | (458)                                   | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 72 027            | 21 127             | 108                   | 91                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | COP             | 211 517 886       | 55 673             | 0                     | (5 420)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           | DKK             | 81 136            | 12 662             | 252                   | 252                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 37 397            | 43 604             | 848                   | 848                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 86 545            | 283                | 5                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 51 982            | 17 894             | 439                   | 439                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 2 049 190         | 21 719             | 70                    | 70                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 54 845            | 5 898              | 356                   | 356                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 225 271           | 64 267             | 48                    | (1 838)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | SEK             | 16 690            | 1 800              | 75                    | 75                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 317 194           | 10 007             | 56                    | 56                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 27 326 CNH        | 184 805            | 0                     | (101)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 929 CNY         | 33 760             | 33                    | 33                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 43 897 COP        | 152 762 701        | 319                   | (94)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 978 £           | 5 190              | 0                     | (89)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 846 HUF         | 2 685 735          | 2                     | (224)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17 693 IDR        | 317 438 655        | 27                    | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 21 147 INR        | 2 049 190          | 501                   | 501                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 126 KRW         | 3 213 993          | 0                     | (50)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 28 537 PEN        | 97 148             | 42                    | (93)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 109 PLN        | 36 938             | 0                     | (282)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 114 726 SEK       | 1 060 550          | 0                     | (5 145)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 071 TWD         | 33 880             | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 72 072 \$         | 24 914             | 701                   | 701                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 5 090 201         | 54 314             | 763                   | 763                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN             | 63 347            | 18 569             | 28                    | 28                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 4 834 207         | 152 321            | 896                   | 896                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 4 731 ILS         | 14 049             | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 861 KZT           | 454 366            | 79                    | 79                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 28 058 PEN        | 95 732             | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 87 607 991 \$     | 23 685             | 40                    | (1 325)                                 | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 693 605 991       | 38 421             | 0                     | (26)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 219 552           | 2 286              | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 280 498           | 556                | 0                     | (16)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 41 147            | 11 986             | 0                     | (49)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 3 247 481         | 100 456            | 2 131                 | (43)                                    | 0,01                |



# Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |        |      |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|--------|------|
| DUB          | 09/2026              | \$                 | 12 587               | COP                   | 49 742 592               | \$ 1 591                                      | 0,01                   |        |      |
|              | 09/2026              |                    | 11 514               | IDR                   | 205 348 452              | 0                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 09/2026              |                    | 6 288                | MXN                   | 112 474                  | (132)                                         | 0,00                   |        |      |
|              | 10/2026              | COP                | 83 958 723           | \$                    | 112 474                  | 0                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 10/2026              | PEN                | 184 966              |                       | 23 745                   | (43)                                          | 0,00                   |        |      |
|              | 11/2026              | COP                | 72 811 272           |                       | 54 246                   | (26)                                          | 0,00                   |        |      |
|              | 11/2026              | PEN                | 57 280               |                       | 20 152                   | (294)                                         | 0,00                   |        |      |
|              | 12/2026              |                    | 51 331               |                       | 16 929                   | 0                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 12/2026              | \$                 | 11 180               | COP                   | 14 748                   | (207)                                         | 0,00                   |        |      |
|              | 12/2026              |                    | 20 728               | IDR                   | 44 239 177               | 0                                             | 0,01                   |        |      |
|              | 12/2026              |                    | 4 124                | PEN                   | 376 843 705              | 22                                            | 0,00                   |        |      |
|              | 01/2027              | PEN                | 37 196               | \$                    | 14 414                   | 0                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              | CNY                | 46 298               |                       | 10 903                   | 77                                            | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              | IDR                | 42 549 756           |                       | 6 793                    | 0                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              | INR                | 3 230 609            |                       | 2 379                    | (30)                                          | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              | SGD                | 5 918                |                       | 34 210                   | 5                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 995 911              | CNH                   | 4 638                    | 0                                             | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              |                    | 6 793                | CNY                   | 6 773 613                | 63                                            | (112)                  | 0,01   |      |
|              | 07/2026              |                    | 9 552                | CZK                   | 46 288                   | 0                                             | 8                      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 22 830               | INR                   | 198 891                  | (182)                                         | 8                      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 2 655                | KZT                   | 2 202 108                | 0                                             | (182)                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 4 139                | NOK                   | 1 427 773                | 398                                           | 0                      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 10 098               | PLN                   | 38 454                   | 0                                             | (253)                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 66                   | RON                   | 37 470                   | 0                                             | (130)                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 1 897                | SGD                   | 300                      | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | ZAR                | 1 022 953            | \$                    | 2 455                    | 0                                             | 0                      | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | CNH                | 6 549 189            |                       | 61 883                   | (1 095)                                       | (431)                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | INR                | 2 970 082            |                       | 964 884                  | (1 990)                                       | (1 990)                | (0,01) |      |
|              | 08/2026              | PEN                | 21 974               |                       | 31 577                   | 0                                             | 330                    | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | SGD                | 2 449                |                       | 6 508                    | 0                                             | 77                     | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | IDR                | 409 284 277          |                       | 1 897                    | 0                                             | 0                      | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | PEN                | 9 135                |                       | 22 715                   | 28                                            | 28                     | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | \$                 | 7 067                | IDR                   | 2 605                    | (67)                                          | (67)                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026              |                    | 34 210               | INR                   | 128 337 207              | 46                                            | 0                      | 0,00   |      |
| FAR          | 12/2026              | ZAR                | 132 392              | \$                    | 3 252 503                | (116)                                         | 0,00                   |        |      |
|              | 07/2026              | CLP                | 579 364              |                       | 7 515                    | (453)                                         | (453)                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | CNH                | 2 204 061            |                       | 628                      | 0                                             | 0                      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | INR                | 270 228              |                       | 325 780                  | 0                                             | 1 080                  | 0,01   |      |
|              | 07/2026              | ¥                  | 322 878              |                       | 2 864                    | 9                                             | 9                      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | PEN                | 184 583              |                       | 2 032                    | 45                                            | 45                     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | SEK                | 629 008              |                       | 54 585                   | 0                                             | 476                    | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | SGD                | 335 171              |                       | 64 823                   | (170)                                         | (170)                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 356                  | CHF                   | 262 713                  | (1)                                           | 3 584                  | 0,02   |      |
|              | 07/2026              |                    | 505                  | CNH                   | 280                      | (9)                                           | (9)                    | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 5 376 334            | €                     | 3 434                    | 0                                             | 1                      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 94 285               | £                     | 4 714 023                | 13 210                                        | 13 210                 | 0,07   |      |
|              | 07/2026              |                    | 565                  | HUF                   | 71 272                   | 0                                             | 311                    | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 2 832                | INR                   | 174 503                  | (5)                                           | (5)                    | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 368 393              | ¥                     | 270 228                  | 0                                             | 23                     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 46 432               | PLN                   | 59 605 949               | (1 643)                                       | (1 643)                | (0,01) |      |
|              | 07/2026              |                    | 510                  | SGD                   | 170 445                  | (1 089)                                       | (1 089)                | (0,01) |      |
|              | 07/2026              | ZAR                | 1 104 240            | \$                    | 661                      | 0                                             | 1                      | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | CNH                | 3 427                |                       | 66 912                   | (354)                                         | (354)                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | COP                | 43 511 332           |                       | 505                      | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | €                  | 4 714 023            |                       | 11 526                   | (997)                                         | (997)                  | (0,01) |      |
|              | 08/2026              | £                  | 71 103               |                       | 5 383 584                | (13 180)                                      | (13 180)               | (0,08) |      |
|              | 08/2026              | ILS                | 29 691               |                       | 94 060                   | (310)                                         | (310)                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | ¥                  | 59 449 971           |                       | 10 371                   | 0                                             | 397                    | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | SGD                | 660                  |                       | 368 393                  | 0                                             | 1 652                  | 0,01   |      |
|              | 08/2026              | \$                 | 64 823               | SEK                   | 510                      | (1)                                           | (1)                    | 0,00   |      |
|              | 08/2026              |                    | 356                  | SGD                   | 627 892                  | 0                                             | 171                    | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | COP                | 49 894 010           | \$                    | 461                      | 0                                             | 1                      | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | PEN                | 37 525               |                       | 13 726                   | (495)                                         | (495)                  | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | \$                 | 628                  | CLP                   | 11 016                   | (21)                                          | 47                     | 0,00   |      |
|              | 09/2026              |                    | 1 384                | INR                   | 579 364                  | 0                                             | 0                      | 0,00   |      |
|              | 09/2026              |                    | 5 103                | MXN                   | 132 591                  | 8                                             | 8                      | 0,00   |      |
|              | GLM                  | 12/2026            | PEN                  | 25 339                | \$                       | 90 114                                        | 0                      | 21     | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            | BRL                  | 313 413               |                          | 7 342                                         | (42)                   | (42)   | 0,00 |
| 07/2026      |                      | COP                | 51 831 376           |                       | 60 525                   | (73)                                          | (27)                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | KRW                | 6 776 211            |                       | 13 625                   | (1 340)                                       | (1 340)                | (0,01) |      |
| 07/2026      |                      | MYR                | 293                  |                       | 4 388                    | 0                                             | 13                     | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | RON                | 8 532                |                       | 72                       | 0                                             | 0                      | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | TRY                | 9 824                |                       | 1 885                    | 24                                            | 24                     | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | \$                 | 38 525               | BRL                   | 209                      | 0                                             | 0                      | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 757 753              | CAD                   | 207 003                  | 0                                             | 1 468                  | 0,01   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 44 158               | CNH                   | 1 078 282                | 0                                             | 2 270                  | 0,01   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 21 413               | COP                   | 298 480                  | (186)                                         | (186)                  | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 16 900               | IDR                   | 75 368 985               | (5)                                           | 355                    | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 4 388                | KRW                   | 303 016 498              | 0                                             | 47                     | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | ZAR                | 143 686              | \$                    | 6 775 246                | (12)                                          | (12)                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                      | CAD                | 1 076 750            |                       | 8 702                    | (51)                                          | (51)                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                      | INR                | 683 292              |                       | 757 753                  | (2 271)                                       | (2 271)                | (0,01) |      |
| 08/2026      |                      | PEN                | 95 721               |                       | 7 253                    | 0                                             | 64                     | 0,00   |      |
|              |                      |                    |                      |                       | 28 393                   | 0                                             | 356                    | 0,00   |      |

|              | Mois         | Devise      | Devise      | Plus-value | (Moins-value) | Plus-value/                    | En % de     |         |        |
|--------------|--------------|-------------|-------------|------------|---------------|--------------------------------|-------------|---------|--------|
| Contrepartie | de règlement | à livrer    | à recevoir  | latente    | latente       | (moins-value)<br>latente nette | l'actif net |         |        |
| IND<br>JPM   | 08/2026      | \$          | 25 722      | BRL        | 131 445       | \$ 0                           | \$ (524)    | 0,00    |        |
|              | 08/2026      |             | 2 793       | INR        | 267 901       | 25                             | 0           | 25      | 0,00   |
|              | 09/2026      | COP         | 2 463 721   | \$         | 706           | 4                              | 0           | 4       | 0,00   |
|              | 09/2026      | IDR         | 304 790 995 |            | 16 900        | 5                              | 0           | 5       | 0,00   |
|              | 09/2026      | MXN         | 57 557      |            | 3 279         | 5                              | 0           | 5       | 0,00   |
|              | 09/2026      | THB         | 2 241 769   |            | 69 471        | 1 566                          | 0           | 1 566   | 0,01   |
|              | 09/2026      | \$          | 42 973      | BRL        | 222 001       | 0                              | (718)       | (718)   | 0,00   |
|              | 09/2026      |             | 32 992      | IDR        | 592 405 415   | 67                             | (221)       | (154)   | 0,00   |
|              | 09/2026      |             | 10 868      | INR        | 1 044 841     | 98                             | 0           | 98      | 0,00   |
|              | 09/2026      |             | 6 881       | MXN        | 119 920       | 0                              | (62)        | (62)    | 0,00   |
|              | 10/2026      |             | 50 182      | BRL        | 265 834       | 71                             | 0           | 71      | 0,00   |
|              | 11/2026      | COP         | 75 034 293  | \$         | 20 697        | 0                              | (374)       | (374)   | 0,00   |
|              | 07/2026      | DKK         | 155 716     |            | 24 309        | 492                            | 0           | 492     | 0,00   |
|              | 07/2026      | AUD         | 678 078     |            | 483 401       | 13 628                         | 0           | 13 628  | 0,08   |
|              | 07/2026      | €           | 667         | SEK        | 7 385         | 1                              | 0           | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026      | HUF         | 261 258     | \$         | 854           | 15                             | 0           | 15      | 0,00   |
|              | 07/2026      | ILS         | 146 512     |            | 49 068        | 0                              | (113)       | (113)   | 0,00   |
|              | 07/2026      | INR         | 338 063     |            | 3 583         | 12                             | 0           | 12      | 0,00   |
|              | 07/2026      | KRW         | 2 093 887   |            | 1 353         | 1                              | 0           | 1       | 0,00   |
|              | 07/2026      | NOK         | 62 528      |            | 6 317         | 0                              | (2)         | (2)     | 0,00   |
|              | 07/2026      | NZD         | 15 859      |            | 9 235         | 239                            | (25)        | 214     | 0,00   |
|              | 07/2026      | SGD         | 1 209       |            | 948           | 14                             | 0           | 14      | 0,00   |
|              | 07/2026      | \$          | 31          | CHF        | 24            | 0                              | (1)         | (1)     | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 24 011      | CNH        | 163 055       | 49                             | (39)        | 10      | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 3 580       | £          | 2 668         | 0                              | (39)        | (39)    | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 2 588       | IDR        | 46 534 425    | 8                              | 0           | 8       | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 9 498       | ILS        | 28 168        | 0                              | (43)        | (43)    | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 3 580       | INR        | 338 063       | 0                              | (9)         | (9)     | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 2 269       | KRW        | 3 479 152     | 0                              | (22)        | (22)    | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 46 232      | PLN        | 168 592       | 6                              | (1 386)     | (1 380) | (0,01) |
|              | 07/2026      |             | 9 380       | THB        | 313 530       | 61                             | 0           | 61      | 0,00   |
|              | 07/2026      |             | 429         | ZAR        | 6 978         | 0                              | (4)         | (4)     | 0,00   |
|              | 08/2026      | CZK         | 260 299     | €          | 10 668        | 0                              | (51)        | (51)    | 0,00   |
|              | 08/2026      | HKD         | 296 457     | \$         | 37 896        | 26                             | 0           | 26      | 0,00   |
|              | 08/2026      | ILS         | 117 710     |            | 40 427        | 883                            | 0           | 883     | 0,01   |
|              | 08/2026      | INR         | 1 539 997   |            | 16 439        | 237                            | 0           | 237     | 0,00   |
|              | 08/2026      | SEK         | 7 382       | €          | 667           | 0                              | (1)         | (1)     | 0,00   |
|              | 08/2026      | TWD         | 1 254 979   | \$         | 39 677        | 370                            | 0           | 370     | 0,00   |
|              | 08/2026      | \$          | 6 317       | NOK        | 62 555        | 2                              | 0           | 2       | 0,00   |
|              | 09/2026      | IDR         | 48 352 163  | \$         | 2 676         | 1                              | (5)         | (4)     | 0,00   |
|              | 09/2026      | INR         | 3 374 464   |            | 35 383        | 7                              | (38)        | (31)    | 0,00   |
|              | 09/2026      | MXN         | 81 931      |            | 4 646         | 4                              | (17)        | (13)    | 0,00   |
|              | 09/2026      | THB         | 1 685 222   |            | 51 774        | 823                            | (96)        | 727     | 0,00   |
|              | 09/2026      | \$          | 50 492      | BRL        | 261 097       | 0                              | (796)       | (796)   | 0,00   |
|              | 09/2026      |             | 5 419       | INR        | 516 814       | 0                              | (1)         | (1)     | 0,00   |
|              | 09/2026      |             | 19 402      | MXN        | 338 791       | 0                              | (136)       | (136)   | 0,00   |
|              | 09/2026      |             | 27 566      | THB        | 898 392       | 0                              | (353)       | (353)   | 0,00   |
|              | 11/2026      | ZAR         | 676 572     | \$         | 38 601        | 0                              | (2 222)     | (2 222) | (0,01) |
| 12/2026      | MXN          | 186 732     |             | 10 590     | 47            | 0                              | 47          | 0,00    |        |
| 12/2026      | \$           | 222 787     | MXN         | 3 934 902  | 0             | (618)                          | (618)       | 0,00    |        |
| 07/2026      | AUD          | 2 817       | \$          | 2 016      | 65            | 0                              | 65          | 0,00    |        |
| 07/2026      | CHF          | 33 260      |             | 41 654     | 533           | (111)                          | 422         | 0,00    |        |
| 07/2026      | €            | 8           | SEK         | 94         | 0             | 0                              | 0           | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 98 460      | \$          | 113 820    | 1 251         | 0                              | 1 251       | 0,01    |        |
| 07/2026      | INR          | 3 243 373   |             | 34 345     | 112           | 0                              | 112         | 0,00    |        |
| 07/2026      | ¥            | 12 970 955  |             | 81 634     | 1 825         | 0                              | 1 825       | 0,01    |        |
| 07/2026      | KRW          | 269 227 973 |             | 177 604    | 3 709         | 0                              | 3 709       | 0,02    |        |
| 07/2026      | NOK          | 23 675      |             | 2 394      | 7             | (5)                            | 2           | 0,00    |        |
| 07/2026      | SEK          | 406 186     |             | 41 796     | 62            | (236)                          | (174)       | 0,00    |        |
| 07/2026      | SGD          | 5 125       |             | 4 000      | 37            | 0                              | 37          | 0,00    |        |
| 07/2026      | \$           | 13 647      | AUD         | 19 687     | 51            | (59)                           | (8)         | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 4 014       | CHF         | 3 173      | 0             | (80)                           | (80)        | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 48 084      | DKK         | 315 184    | 124           | 0                              | 124         | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 33 833      | €           | 29 220     | 0             | (426)                          | (426)       | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 3 486       | £           | 2 615      | 5             | (20)                           | (15)        | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 52 952      | INR         | 5 104 225  | 887           | 0                              | 887         | 0,01    |        |
| 07/2026      |              | 1 461       | ¥           | 232 900    | 0             | (28)                           | (28)        | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 7 461       | NOK         | 69 331     | 0             | (455)                          | (455)       | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 10 945      | NZD         | 19 088     | 44            | (131)                          | (87)        | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 2 914       | SEK         | 28 125     | 15            | (23)                           | (8)         | 0,00    |        |
| 07/2026      |              | 8 631       | SGD         | 11 077     | 0             | (67)                           | (67)        | 0,00    |        |
| 08/2026      | DKK          | 314 638     | \$          | 48 084     | 0             | (123)                          | (123)       | 0,00    |        |
| 08/2026      | ILS          | 2 351       |             | 785        | 0             | (4)                            | (4)         | 0,00    |        |
| 08/2026      | SEK          | 94          | €           | 8          | 0             | 0                              | 0           | 0,00    |        |
| 08/2026      | TWD          | 940 325     | \$          | 29 739     | 274           | 0                              | 274         | 0,00    |        |
| 08/2026      | \$           | 4 366       | €           | 3 823      | 11            | 0                              | 11          | 0,00    |        |
| 08/2026      |              | 1 196       | NOK         | 11 895     | 5             | 0                              | 5           | 0,00    |        |
| 08/2026      |              | 39 890      | SEK         | 387 656    | 236           | 0                              | 236         | 0,00    |        |
| 09/2026      | THB          | 270 953     | \$          | 8 115      | 0             | (93)                           | (93)        | 0,00    |        |
| 09/2026      | \$           | 47 953      | INR         | 4 569 783  | 85            | (125)                          | (40)        | 0,00    |        |
| 09/2026      |              | 9 687       | MXN         | 170 744    | 23            | 0                              | 23          | 0,00    |        |
| 07/2026      | DKK          | 5 964       | \$          | 931        | 19            | 0                              | 19          | 0,00    |        |
| 07/2026      | €            | 10 695      |             | 12 187     | 0             | (40)                           | (40)        | 0,00    |        |
| MYI          |              |             |             |            |               |                                |             |         |        |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| NSL          | 07/2026           | £               | 91                | \$ 120             | \$ 0                  | \$ (1)                                  | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 837             | 1 063              | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 7 489             | € 695              | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 770             | \$ 504             | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 3 206             | 2 471              | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 6 395             | € 5 600            | 9                     | (1)                                     | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 7 017             | £ 5 238            | 3                     | (68)                                    | (65)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 646             | ¥ 582 200          | 0                     | (64)                                    | (64)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 322             | SEK 12 530         | 2                     | (29)                                    | (27)                | 0,00   |
|              | 01/2027           |                 | 288 537           | TWD 9 059 363      | 0                     | (5 804)                                 | (5 804)             | (0,03) |
|              | 07/2026           |                 | 15 730            | IDR 280 478 403    | 0                     | (43)                                    | (43)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 53 550            | INR 5 151 645      | 825                   | 0                                       | 825                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 282 051 384       | \$ 15 730          | 95                    | 0                                       | 95                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 7 045             | IDR 125 369 726    | 0                     | (96)                                    | (96)                | 0,00   |
|              | RBC               | 07/2026         | SGD               | 2 082              | \$ 1 609              | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| RYL          | 07/2026           | \$              | 1 540             | £ 1 165            | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           | €               | 5                 | DKK 39             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 349 054           | \$ 467 481         | 4 199                 | 0                                       | 4 199               | 0,02   |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 633             | 1 262              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 3 595             | CAD 4 984          | 0                     | (82)                                    | (82)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 21 497            | CNH 145 521        | 0                     | (59)                                    | (59)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 26 036            | CNY 177 979        | 141                   | 0                                       | 141                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 015             | IDR 107 934 402    | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 70 475            | INR 6 755 135      | 825                   | 0                                       | 825                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 14 569            | ¥ 2 318 933        | 0                     | (301)                                   | (301)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 569             | NZD 4 545          | 16                    | 0                                       | 16                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 5 987             | PEN 20 493         | 23                    | 0                                       | 23                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | DKK             | 39                | € 5                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | HKD             | 279 764           | \$ 35 770          | 32                    | 0                                       | 32                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 6 945             | INR 665 420        | 56                    | 0                                       | 56                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 321 960 305       | \$ 17 835          | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | KZT             | 43 976            | 87                 | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 20 559            | 5 987              | 0                     | (26)                                    | (26)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 892 090           | 27 556             | 555                   | (21)                                    | 534                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 17 963            | IDR 322 451 658    | 24                    | (113)                                   | (89)                | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 6 904             | THB 225 807        | 0                     | (64)                                    | (64)                | 0,00   |
| SOG          | 11/2026           | NGN             | 2 005 700         | \$ 1 240           | 0                     | (138)                                   | (138)               | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 560 630         | 526 349            | 1 802                 | 0                                       | 1 802               | 0,01   |
|              | 07/2026           | DKK             | 163 483           | 25 455             | 450                   | 0                                       | 450                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 11 205            | 13 065             | 255                   | 0                                       | 255                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 8 375             | € 9 655            | 0                     | (77)                                    | (77)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 33 776 171        | \$ 212 606         | 4 785                 | 0                                       | 4 785               | 0,03   |
|              | 07/2026           | SGD             | 4 882             | 3 773              | 5                     | (6)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 249 914           | AUD 362 194        | 1 014                 | 0                                       | 1 014               | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 346               | CAD 478            | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 389             | CHF 2 741          | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 315 382           | £ 238 456          | 1 109                 | 0                                       | 1 109               | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 273 791           | SGD 354 389        | 313                   | (117)                                   | 196                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 362 194           | \$ 249 754         | 0                     | (1 028)                                 | (1 028)             | (0,01) |
|              | 08/2026           | CHF             | 2 732             | 3 389              | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | £               | 238 456           | 315 373            | 0                     | (1 111)                                 | (1 111)             | (0,01) |
|              | 08/2026           | SGD             | 337 483           | 261 192            | 0                     | (327)                                   | (327)               | 0,00   |
| SSB          | 08/2026           | \$              | 2 860             | SGD 3 699          | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 099 500         | \$ 797 354         | 22 376                | 0                                       | 22 376              | 0,13   |
|              | 07/2026           | CHF             | 96 076            | 121 964            | 2 889                 | (29)                                    | 2 860               | 0,02   |
|              | 07/2026           | \$              | 6 959             | CAD 9 866          | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 9 852             | \$ 6 959           | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 5 176             | € 4 534            | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 9 176             | IDR 166 654 439    | 62                    | 0                                       | 62                  | 0,00   |
| UAG          | 07/2026           | €               | 6                 | DKK 42             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 084             | \$ 1 607           | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 428               | CHF 340            | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1                 | HKD 10             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 10 280            | PLN 37 564         | 0                     | (287)                                   | (287)               | 0,00   |
|              | 08/2026           | COP             | 59 854 280        | \$ 15 851          | 0                     | (1 377)                                 | (1 377)             | (0,01) |
|              | 08/2026           | DKK             | 42                | € 6                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             | 80 685 749        | \$ 20 966          | 0                     | (2 032)                                 | (2 032)             | (0,01) |
|              | 09/2026           | THB             | 51 204            | 1 560              | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 10/2026           | HUF             | 136 024           | € 366              | 0                     | (15)                                    | (15)                | 0,00   |
| WST          | 11/2026           |                 | 5 433 697         | 15 074             | 0                     | (56)                                    | (56)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 166 526           | CHF 134 451        | 152                   | 0                                       | 152                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | CHF             | 133 970           | \$ 166 526         | 0                     | (155)                                   | (155)               | 0,00   |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 247 110            | \$ (96 268)                             | \$ 150 842          | 0,86   |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en AUD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | \$ 34 296         | \$ 23 647          | \$ 0                  | \$ (113)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 20 736            | AUD 29 116         | 0                     | (564)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 23 632            | 34 296             | 114                   | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           |                 | 126               | 175                | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 1 559             | 2 238              | 4                     | (12)                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 3 719             | 5 284              | 0                     | (58)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 368               | \$ 259             | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 207               | AUD 293            | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           |                 | 2 245             | 3 143              | 0                     | (67)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD             | 17 622            | \$ 12 237          | 28                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 21 435            | AUD 30 048         | 0                     | (618)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 12 229            | 17 622             | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 35 419            | \$ 24 418          | 4                     | (124)                                   | (0,00)              |
|              | 07/2026           | \$              | 1 468             | AUD 2 114          | 5                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 24 280            | 35 247             | 125                   | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           |                 | 439               | 617                | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD             | 13 921            | \$ 9 606           | 0                     | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 037             | AUD 7 078          | 0                     | (133)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 9 600             | 13 921             | 40                    | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           |                 | 16 405            | 23 042             | 0                     | (442)                                   | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 325             | \$ (2 227)            | \$ (1 902)                              | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD             | 8 628             | \$ 6 070           | \$ 0                  | \$ (12)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 6 070             | CAD 8 616          | 12                    | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 10 833            | 14 986             | 0                     | (270)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 41                | 58                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 10                | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | CAD             | 16                | \$ 11              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           |                 | 15 124            | 10 628             | 0                     | (32)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 10 628            | CAD 15 103         | 32                    | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 11 143            | 15 384             | 0                     | (300)                                   | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 5 097             | \$ 3 595           | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 11 109            | CAD 15 319         | 0                     | (312)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 3 595             | 5 090              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 47              | \$ (929)              | \$ (882)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation, E en CHF (couverte) de capitalisation, W en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF             | 245               | \$ 304             | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 87                | CHF 69             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           |                 | 533               | 418                | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 197 065           | 154 034            | 0                     | (6 110)                                 | (0,03)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 172               | \$ 216             | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 232 294           | CHF 181 935        | 0                     | (6 750)                                 | (0,04)              |
| SOG          | 07/2026           | CHF             | 172 032           | \$ 212 643         | 0                     | (624)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 212 643           | CHF 171 414        | 626                   | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF             | 232               | \$ 287             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 209 939           | CHF 165 028        | 0                     | (5 354)                                 | (0,03)              |
| UAG          | 07/2026           | CHF             | 99                | \$ 125             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           |                 | 171 356           | 212 235            | 0                     | (194)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 212 235           | CHF 170 742        | 198                   | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 829             | \$ (19 048)           | \$ (18 219)                             | (0,10)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en GBP (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, E en USD (exposition au risque de change) de distribution et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 465               | \$ 321             | \$ 0                  | \$ (2)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 575               | 404                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 22 212            | AUD 31 190         | 0                     | (604)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 2 354             | NZD 4 027          | 0                     | (63)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 321               | AUD 465            | 2                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 08/2026           | \$              | 404               | CAD 574            | \$ 1                  | \$ 0                                    | \$ 1 0,00           |
|              | 07/2026           | CLP             | 233 158           | \$ 253             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 424 974           | 2 671              | 57                    | 0                                       | 57 0,00             |
|              | 07/2026           | KRW             | 20 754 214        | 13 442             | 42                    | 0                                       | 42 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 261               | CLP 233 158        | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 1 085             | ¥ 172 550          | 0                     | (23)                                    | (23) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 66                | MXN 1 161          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 132               | NOK 1 223          | 0                     | (9)                                     | (9) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 34                | TWD 1 075          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | MXN             | 1 161             | \$ 66              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| BPS          | 08/2026           | \$              | 253               | CLP 233 158        | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 13 442            | KRW 20 751 391     | 0                     | (30)                                    | (30) 0,00           |
|              | 07/2026           | CAD             | 3 140             | \$ 2 275           | 62                    | 0                                       | 62 0,00             |
|              | 07/2026           | CNH             | 10 913            | 1 613              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | CNY             | 5 301             | 782                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | €               | 1 251             | 1 427              | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 07/2026           | £               | 601               | 804                | 7                     | (1)                                     | 6 0,00              |
|              | 07/2026           | HUF             | 301 145           | 970                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 126 693           | 791                | 12                    | 0                                       | 12 0,00             |
|              | 07/2026           | NZD             | 30                | 17                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| BRC          | 07/2026           | \$              | 58 455            | £ 43 624           | 0                     | (556)                                   | (556) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 4 604             | ¥ 731 981          | 0                     | (100)                                   | (100) 0,00          |
|              | 07/2026           |                 | 2 318             | THB 75 163         | 0                     | (56)                                    | (56) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 104               | £ 79               | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 970               | HUF 301 569        | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 17                | NZD 30             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CNH             | 7 354             | \$ 1 089           | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 2 125             | 13                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 5 094             | MXN 89 491         | 27                    | 0                                       | 27 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 155               | NZD 263            | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
| BSH          | 08/2026           | MXN             | 89 491            | \$ 5 080           | 0                     | (27)                                    | (27) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 13                | ¥ 2 119            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 120             | \$ 1 473           | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           | €               | 5 813             | 6 765              | 119                   | 0                                       | 119 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 24 396            | ¥ 3 878 896        | 0                     | (530)                                   | (530) 0,00          |
|              | 08/2026           |                 | 1 472             | AUD 2 120          | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|              | 07/2026           | PEN             | 3 114             | \$ 909             | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 261               | CLP 233 158        | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 674               | DKK 4 320          | 0                     | (13)                                    | (13) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 6 630             | € 5 684            | 0                     | (131)                                   | (131) 0,00          |
| CBK          | 07/2026           |                 | 6 087             | IDR 108 241 883    | 0                     | (46)                                    | (46) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 304               | PEN 1 038          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 6 053             | SEK 55 924         | 0                     | (274)                                   | (274) 0,00          |
|              | 08/2026           |                 | 907               | PEN 3 114          | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | TWD             | 1 075             | \$ 34              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 153               | AUD 214            | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 157 499           | CNY 1 068 644      | 0                     | (374)                                   | (374) 0,00          |
|              | 07/2026           |                 | 327               | NOK 3 039          | 0                     | (20)                                    | (20) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 34                | TWD 1 076          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | AUD             | 980               | \$ 680             | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
| FAR          | 07/2026           | CLP             | 261 475           | 284                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CNH             | 10 857            | 1 605              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 17 188 594        | 106 234            | 474                   | 0                                       | 474 0,00            |
|              | 07/2026           | MXN             | 95 228            | 5 417              | 0                     | (32)                                    | (32) 0,00           |
|              | 07/2026           | NZD             | 396               | 225                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | SEK             | 33 360            | 3 438              | 0                     | (9)                                     | (9) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 1 291             | AUD 1 809          | 0                     | (37)                                    | (37) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 8 629             | CNH 58 693         | 18                    | 0                                       | 18 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 451               | ¥ 71 741           | 0                     | (10)                                    | (10) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 45                | MXN 778            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| GLM          | 07/2026           |                 | 304               | PEN 1 038          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 3 269             | SGD 4 171          | 0                     | (45)                                    | (45) 0,00           |
|              | 08/2026           | CNH             | 58 564            | \$ 8 629           | 0                     | (17)                                    | (17) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 680               | AUD 980            | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 284               | CLP 261 475        | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 106 234           | ¥ 17 143 615       | 0                     | (476)                                   | (476) 0,00          |
|              | 08/2026           |                 | 5 402             | MXN 95 228         | 33                    | 0                                       | 33 0,00             |
|              | 08/2026           |                 | 226               | NZD 396            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 3 438             | SEK 33 301         | 9                     | 0                                       | 9 0,00              |
|              | 07/2026           | CAD             | 55 328            | \$ 38 881          | 0                     | (116)                                   | (116) 0,00          |
| IND          | 07/2026           | \$              | 261               | CLP 233 158        | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 38 881            | CAD 55 249         | 117                   | 0                                       | 117 0,00            |
|              | 07/2026           | CLP             | 204 842           | \$ 222             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CZK             | 47 391            | 2 230              | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 1 206             | DKK 7 724          | 0                     | (24)                                    | (24) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 987               | HUF 301 200        | 0                     | (19)                                    | (19) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 222               | CLP 204 842        | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 2 230             | CZK 47 385         | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 07/2026           | AUD             | 26 876            | \$ 18 800          | 180                   | 0                                       | 180 0,00            |
|              | 07/2026           | NOK             | 8 612             | 870                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| JPM          | 07/2026           | PLN             | 18 404            | 4 901              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 36                | AUD 50             | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 21                | NZD 35             | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 08/2026           | \$              | 18 788 AUD        | 26 876 \$          | 0                     | \$ (179)                                | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 870 NOK           | 8 615              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 4 901 PLN         | 18 405             | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 840 \$          | 2 024              | 58                    | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 4 961             | 734                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 15 634            | 2 385              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 201             | 7 196              | 106                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 108 241 883       | 6 020              | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 777             | 279                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 3 899             | 2 233              | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 20 372            | 2 093              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 75 163            | 2 252              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 0 AUD             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 929 CHF         | 6 993              | 0                     | (260)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 844 €             | 737                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 799 ILS         | 7 873              | 0                     | (157)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 21 875 ¥          | 3 475 523          | 0                     | (490)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 38 KRW            | 57 327             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 779 NOK           | 7 223              | 0                     | (49)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 067 PLN         | 18 431             | 0                     | (164)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 SEK            | 123                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 163 \$            | 186                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 321 AUD           | 467                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 385 DKK         | 15 607             | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 6 006 IDR         | 108 241 883        | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 279 NOK           | 2 778              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 235 NZD         | 3 899              | 0                     | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 093 SEK         | 20 336             | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 254 THB         | 75 163             | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 277 CZK         | 47 473             | 0                     | (41)                                    | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £               | 16 \$             | 21                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           | \$              | 21 £              | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           |                 | 1 856 CNH         | 12 529             | 0                     | (10)                                    | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £               | 41 126 \$         | 54 435             | 0                     | (150)                                   | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$              | 304 PEN           | 1 038              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 54 433 £          | 41 126             | 151                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 26 \$             | 19                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 30 736            | 4 544              | 16                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 281 989           | 320 763            | 0                     | (1 636)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £               | 1 879             | 2 482              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN             | 101 681           | 5 785              | 0                     | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 4 177             | 3 225              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 14 AUD            | 19                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 263 DKK         | 8 109              | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 335 618 €         | 287 703            | 0                     | (6 686)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           |                 | 59 242 ¥          | 9 411 695          | 0                     | (1 333)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 MXN             | 19                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 321 198 €         | 281 989            | 1 632                 | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           |                 | 2 482 £           | 1 879              | 12                    | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           |                 | 5 769 MXN         | 101 681            | 34                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 3 225 SGD         | 4 167              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 506 \$            | 357                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 6 396             | 947                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 26 771            | 6 542              | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 43 540 CAD        | 60 040             | 0                     | (1 222)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 288 €           | 1 130              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 791 MYR         | 26 805             | 0                     | (225)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 1 130 \$          | 1 290              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 357 CAD           | 506                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           |                 | 6 542 MYR         | 26 765             | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 684 KRW        | 20 692 048         | 0                     | (325)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 071 MXN         | 105 459            | 0                     | (36)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 6 986 \$          | 8 652              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 8 652 CHF         | 6 961              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 314           | \$ (16 844)           | \$ (13 530)                             | (0,08)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, G Détail en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation, T en EUR (couverte) de capitalisation, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 923 €             | 793                | 0                     | (16)                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | €               | 8 274 \$          | 9 429              | 0                     | (31)                                    | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$              | 1 155 050 €       | 991 529            | 25                    | (21 459)                                | (0,12)              |
|              | 07/2026           | €               | 3 617 \$          | 4 207              | 71                    | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 1 075 544 €       | 922 473            | 0                     | (20 879)                                | (0,12)              |
|              | 07/2026           | €               | 3 258 \$          | 3 799              | 75                    | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           |                 | 911 569           | 1 039 643          | 0                     | (2 554)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 1 041 045 €       | 911 569            | 2 547                 | 0                                       | 0,01                |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | €               | 1 064 174         | \$ 1 210 514       | \$ 1 269              | \$ (7 425)                              | \$ (6 156) (0,03)   |
|              | 07/2026           | \$              | 85 439            | € 73 472           | 0                     | (1 438)                                 | (1 438) (0,01)      |
|              | 08/2026           |                 | 1 163 079         | 1 022 506          | 7 517                 | 0                                       | 7 517 0,04          |
| SOG          | 07/2026           | €               | 990 080           | \$ 1 126 216       | 0                     | (5 742)                                 | (5 742) (0,03)      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 152 914         | € 988 320          | 0                     | (22 967)                                | (22 967) (0,13)     |
|              | 08/2026           |                 | 1 127 743         | 990 080            | 5 730                 | 0                                       | 5 730 0,03          |
| SSB          | 07/2026           |                 | 4 999             | 4 385              | 14                    | 0                                       | 14 0,00             |
|              | 08/2026           | €               | 4 385             | \$ 5 006           | 0                     | (14)                                    | (14) 0,00           |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 17 248             | \$ (82 525)                             | \$ (65 277) (0,37)  |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de capitalisation, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 186 325           | £ 138 787          | \$ 0                  | \$ (2 120)                              | \$ (2 120) (0,01)   |
| BOA          | 07/2026           |                 | 283               | 211                | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
| BPS          | 07/2026           | £               | 127 334           | \$ 167 929         | 0                     | (1 075)                                 | (1 075) (0,01)      |
|              | 07/2026           | \$              | 208 331           | £ 155 521          | 32                    | (1 948)                                 | (1 916) (0,01)      |
|              | 08/2026           | £               | 372               | \$ 492             | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | \$              | 167 924           | £ 127 334          | 1 076                 | 0                                       | 1 076 0,01          |
| BRC          | 07/2026           |                 | 157               | 119                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
| CBK          | 07/2026           | £               | 1 318             | \$ 1 768           | 19                    | 0                                       | 19 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 1 244             | £ 927              | 0                     | (13)                                    | (13) 0,00           |
| FAR          | 07/2026           | £               | 27                | \$ 36              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 11 055            | £ 8 221            | 0                     | (144)                                   | (144) 0,00          |
|              | 08/2026           |                 | 36                | 27                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| JPM          | 07/2026           |                 | 205 094           | 152 844            | 0                     | (2 232)                                 | (2 232) (0,01)      |
| MBC          | 07/2026           | £               | 491               | \$ 661             | 9                     | 0                                       | 9 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 436               | £ 327              | 1                     | (3)                                     | (2) 0,00            |
| NSL          | 07/2026           | £               | 28 316            | \$ 37 265          | 0                     | (318)                                   | (318) 0,00          |
|              | 08/2026           | \$              | 37 264            | £ 28 316           | 318                   | 0                                       | 318 0,00            |
| SCX          | 07/2026           | £               | 148 030           | \$ 195 933         | 1                     | (540)                                   | (539) (0,01)        |
|              | 07/2026           | \$              | 337               | £ 250              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 195 790           | 147 928            | 543                   | 0                                       | 543 0,00            |
| SOG          | 07/2026           | £               | 147 238           | \$ 194 501         | 0                     | (920)                                   | (920) (0,01)        |
|              | 08/2026           | \$              | 194 496           | £ 147 238          | 921                   | 0                                       | 921 0,01            |
| SSB          | 07/2026           | £               | 4 410             | \$ 5 829           | 0                     | (24)                                    | (24) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 5 829             | £ 4 410            | 24                    | 0                                       | 24 0,00             |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 2 945              | \$ (9 347)                              | \$ (6 402) (0,04)   |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en NOK (couverte) de capitalisation, Investisseurs en NOK (couverte) de capitalisation et W en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | NOK             | 2 298             | \$ 247             | \$ 15                 | \$ 15                                   | 15 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 97 766            | NOK 905 124        | 0                     | (6 298)                                 | (6 298) (0,04)      |
| BPS          | 07/2026           | NOK             | 2 001             | \$ 204             | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 59 359            | NOK 550 109        | 0                     | (3 767)                                 | (3 767) (0,02)      |
| DUB          | 07/2026           |                 | 69 638            | 647 039            | 0                     | (4 251)                                 | (4 251) (0,02)      |
| FAR          | 07/2026           |                 | 1                 | 5                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| JPM          | 07/2026           | NOK             | 690 520           | \$ 69 761          | 0                     | (20)                                    | (20) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 69 761            | NOK 690 822        | 20                    | 0                                       | 20 0,00             |
| MBC          | 07/2026           | NOK             | 887 123           | \$ 89 266          | 0                     | (383)                                   | (383) 0,00          |
|              | 07/2026           | \$              | 61 718            | NOK 572 280        | 0                     | (3 886)                                 | (3 886) (0,02)      |
|              | 08/2026           |                 | 89 266            | 887 503            | 382                   | 0                                       | 382 0,00            |
| MYI          | 07/2026           | NOK             | 5 119             | \$ 541             | 23                    | 0                                       | 23 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 52                | NOK 499            | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
| SCX          | 07/2026           |                 | 2 341             | 21 664             | 0                     | (152)                                   | (152) 0,00          |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 441                | \$ (18 759)                             | \$ (18 318) (0,10)  |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NZD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | NZD             | 796               | \$ 450             | \$ 0                  | \$ (3)                                  | (3) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 14 869            | NZD 25 455         | 0                     | (389)                                   | (389) 0,00          |
|              | 08/2026           |                 | 450               | 796                | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
| BPS          | 07/2026           | NZD             | 28 911            | \$ 16 282          | 1                     | (165)                                   | (164) 0,00          |
|              | 07/2026           | \$              | 16 985            | NZD 28 957         | 0                     | (513)                                   | (513) (0,01)        |
|              | 08/2026           |                 | 16 275            | 28 868             | 165                   | 0                                       | 165 0,00            |
| BRC          | 07/2026           |                 | 31                | 53                 | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BSH          | 07/2026           | NZD             | 1 928             | \$ 1 089           | \$ 0                  | \$ (8)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 091             | NZD 1 928          | 7                     | 7                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | NZD             | 26 903            | \$ 15 306          | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 15 323            | NZD 26 903         | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | NZD             | 120               | \$ 68              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 233             | NZD 2 101          | 0                     | (38)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NZD             | 26 026            | \$ 14 902          | 97                    | 97                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 14 910            | NZD 26 011         | 0                     | (97)                                    | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | NZD             | 655               | \$ 376             | 4                     | 4                                       | 0,00                |
| RYL          | 08/2026           |                 | 344               | 195                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           |                 | 1 202             | 702                | 19                    | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 311               | NZD 550            | 2                     | 2                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 15 363            | 26 259             | 0                     | (425)                                   | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           |                 | 1 860             | 3 164              | 0                     | (60)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 301             | \$ (1 703)            | \$ (1 402)                              | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 14 563            | SEK 134 683        | \$ 0                  | \$ (647)                                | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SEK             | 378               | \$ 40              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 226               | 24                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 16 029            | SEK 148 109        | 0                     | (725)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | SEK             | 85 312            | \$ 8 792           | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 8 792             | SEK 85 161         | 23                    | 23                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK             | 129 388           | \$ 13 291          | 1                     | (79)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 15 648            | SEK 145 341        | 0                     | (631)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 13 238            | 128 646            | 78                    | 78                                      | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | SEK             | 9 324             | \$ 962             | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 105             | \$ (2 108)            | \$ (2 003)                              | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, M Détail en SGD (couverte) de distribution II et W en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$              | 217 895           | SGD 277 842        | \$ 0                  | \$ (3 088)                              | (0,02)              |
| BOA                                                | 07/2026           | SGD             | 229 669           | \$ 177 446         | 0                     | (117)                                   | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 336 395           | SGD 429 592        | 0                     | (4 267)                                 | (0,02)              |
|                                                    | 08/2026           |                 | 177 446           | 229 140            | 116                   | 116                                     | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | SGD             | 1 021             | \$ 790             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC                                                | 07/2026           | \$              | 6 286             | SGD 8 078          | 1                     | (41)                                    | 0,00                |
| DUB                                                | 07/2026           | SGD             | 270 348           | \$ 208 989         | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 237 968           | SGD 303 545        | 0                     | (3 290)                                 | (0,02)              |
|                                                    | 08/2026           |                 | 208 989           | 269 727            | 25                    | 25                                      | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | SGD             | 279 099           | \$ 215 205         | 0                     | (574)                                   | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 400 722           | SGD 511 229        | 0                     | (5 477)                                 | (0,03)              |
|                                                    | 08/2026           |                 | 215 205           | 278 459            | 575                   | 575                                     | 0,00                |
| MBC                                                | 07/2026           |                 | 1 924             | 2 472              | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
| MYI                                                | 07/2026           |                 | 580               | 752                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | SGD             | 55 651            | \$ 42 980          | 0                     | (45)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 42 980            | SGD 55 522         | 44                    | 44                                      | 0,00                |
| RBC                                                | 07/2026           |                 | 539               | 697                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | SGD             | 540 794           | \$ 417 602         | 0                     | (500)                                   | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 1 151             | SGD 1 478          | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           |                 | 417 602           | 539 579            | 523                   | 523                                     | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | SGD             | 3 609             | \$ 2 783           | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 8 072             | SGD 10 419         | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 1 289           | \$ (17 453)           | \$ (16 164)                             | (0,09)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 42 099                               | 0,24                |

## DESCRIPTION

## AUTRES ACTIFS FINANCIERS

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                          | \$ 1 200                      | \$ 423                     | 0,00                |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A,<br>5,125 % éch. 29/10/2022 ^ | 500                           | 30                         | 0,00                |
| <b>Total des Autres actifs financiers</b>                           |                               | <b>\$ 453</b>              | <b>0,00</b>         |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>TITRES VENDUS À DÉCOUVERT</b>                               |                                     |                                  |                           |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                                     |                                  |                           |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | \$ 7 500                            | \$ (6 973)                       | (0,04)                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/07/2041                                        | 276 200                             | (251 641)                        | (1,43)                    |
| 2,000 % éch. 01/07/2056                                        | 47 050                              | (37 581)                         | (0,21)                    |
| 2,000 % éch. 01/08/2056                                        | 986 000                             | (787 255)                        | (4,47)                    |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 17 300                              | (15 078)                         | (0,09)                    |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 72 800                              | (66 006)                         | (0,38)                    |
| 5,500 % éch. 01/08/2056 (h)                                    | 21 660                              | (21 700)                         | (0,12)                    |
| 6,000 % éch. 01/07/2056 (h)                                    | 73 073                              | (74 710)                         | (0,42)                    |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 154 728                             | (157 542)                        | (0,89)                    |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 (h)                                    | 117 300                             | (121 350)                        | (0,69)                    |
| 6,500 % éch. 01/08/2056                                        | 115 195                             | (119 033)                        | (0,68)                    |
| <b>Total des Titres vendus à découvert</b>                     |                                     | <b>\$ (1 658 869)</b>            | <b>(9,42)</b>             |
| <b>Total des Investissements</b>                               |                                     | <b>\$ 23 368 104</b>             | <b>132,70</b>             |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b>                  |                                     | <b>\$ (5 758 386)</b>            | <b>(32,70)</b>            |
| <b>Actif net</b>                                               |                                     | <b>\$ 17 609 718</b>             | <b>100,00</b>             |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- μ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.
- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.
- (i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,31 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût              | Juste<br>valeur   | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|--------------------|-----------------|-------------------|-------------------|------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804 % | 20/04/2033         | 13/04/2026      | 52 100            | 52 012            | 0,29                   |
| Project Dorchester                                  | 4,610   | 04/01/2027         | 10/12/2025      | 8 382             | 8 232             | 0,05                   |
| Project Fenno                                       | 0,600   | 10/07/2028         | 16/07/2025      | 3 706             | 3 660             | 0,02                   |
| Project Fenno                                       | 4,641   | 10/07/2028         | 16/07/2025      | 7 085             | 7 068             | 0,04                   |
| Project Fenno                                       | 4,680   | 10/07/2028         | 16/07/2025      | 3 380             | 3 357             | 0,02                   |
| RBC International                                   | 4,660   | 16/12/2028         | 18/11/2025      | 20 000            | 19 671            | 0,11                   |
| Valerie Asset Ltd.                                  | 5,219   | 15/09/2050         | 02/03/2026      | 67 834            | 68 286            | 0,39                   |
| Valerie Asset Ltd.                                  | 5,267   | 15/09/2050         | 02/03/2026      | 8 806             | 8 860             | 0,05                   |
|                                                     |         |                    |                 | <b>\$ 171 293</b> | <b>\$ 171 146</b> | <b>0,97</b>            |

- (j) Des titres d'une juste valeur globale de 1 073 436 \$ (31 décembre 2025 : 1 061 583 \$) et un montant en numéraire de 176 \$ (31 décembre 2025 : 116 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 4 327 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 3 408 \$ (31 décembre 2025 : 3 181 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 427 021 \$ (31 décembre 2025 : 362 199 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 100 660 \$ (31 décembre 2025 : 88 940 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur         |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 23 372 566                                        | \$ 339 186                                        | \$ 23 711 752        |
| Fonds d'investissement                        | 1 175 646                                                                         | 0                                                    | 0                                                 | 1 175 646            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 13 715                                                                            | 125 407                                              | 0                                                 | 139 122              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 453                                                  | 0                                                 | 453                  |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (1 658 869)                                          | 0                                                 | (1 658 869)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 189 361</b>                                                               | <b>\$ 21 839 557</b>                                 | <b>\$ 339 186</b>                                 | <b>\$ 23 368 104</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur         |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 23 461 424                                        | \$ 282 597                                        | \$ 23 744 021        |
| Fonds d'investissement                        | 1 187 758                                                                         | 0                                                    | 0                                                 | 1 187 758            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 31 250                                                                            | (147 720)                                            | 426                                               | (116 044)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 354                                                  | 30                                                | 384                  |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (1 280 515)                                          | 0                                                 | (1 280 515)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 219 008</b>                                                               | <b>\$ 22 033 543</b>                                 | <b>\$ 283 053</b>                                 | <b>\$ 23 535 604</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BRC                                           | 1,950 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 888)        | \$ (2 160)                               | (0,01)              |
|                                               | 2,050          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 349)          | (4 977)                                  | (0,03)              |
|                                               | 3,550          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 026)          | (2 066)                                  | (0,01)              |
| CIB                                           | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026         | (113 485)        | (113 800)                                | (0,65)              |
| DEU                                           | 3,650          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (3 200)          | (3 201)                                  | (0,02)              |
|                                               | 3,730          | 26/06/2026        | 06/07/2026         | (7 513)          | (7 517)                                  | (0,04)              |
|                                               | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (16 139)         | (16 140)                                 | (0,09)              |
| FAR                                           | 3,710          | 17/06/2026        | 13/07/2026         | (66 537)         | (66 633)                                 | (0,38)              |
| JPS                                           | 3,670          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (39 192)         | (39 200)                                 | (0,22)              |
|                                               | 3,720          | 22/06/2026        | 06/07/2026         | (11 854)         | (11 865)                                 | (0,07)              |
|                                               | 3,740          | 23/06/2026        | 07/07/2026         | (170 089)        | (170 231)                                | (0,97)              |
| MYI                                           | 3,470          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (4 961)          | (4 961)                                  | (0,03)              |
| NOM                                           | 3,720          | 11/06/2026        | 09/07/2026         | (58 114)         | (58 234)                                 | (0,33)              |
| SCX                                           | 3,700          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 867)          | (3 888)                                  | (0,02)              |
|                                               | 3,700          | 13/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 944)          | (3 964)                                  | (0,02)              |
|                                               | 3,750          | 30/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 115)          | (3 135)                                  | (0,02)              |
| SGY                                           | 3,720          | 22/06/2026        | 20/07/2026         | (104 193)        | (104 290)                                | (0,59)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (459 168)        | (459 216)                                | (2,61)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (1 075 478)</b>                    | <b>(6,11)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

|              | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
| Contrepartie | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (902)                                                   | \$ 1 140                | \$ 238                            | \$ 4 760                                                   | \$ (5 960)              | \$ (1 200)                        |
| BOA          | (22 632)                                                   | 23 280                  | 648                               | 1 377                                                      | (1 840)                 | (463)                             |
| BPS          | (13 693)                                                   | 14 090                  | 397                               | 4 105                                                      | (4 090)                 | 15                                |
| BRC          | 5 039                                                      | (5 900)                 | (861)                             | (4 997)                                                    | 5 380                   | 383                               |
| BSH          | 80 019                                                     | (84 220)                | (4 201)                           | (9 097)                                                    | 9 740                   | 643                               |
| CBK          | (1 894)                                                    | 4 090                   | 2 196                             | 6 515                                                      | (4 610)                 | 1 905                             |
| CIB          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| DUB          | (8 312)                                                    | 9 120                   | 808                               | (4 105)                                                    | 4 160                   | 55                                |
| FAR          | 1 979                                                      | (630)                   | 1 349                             | (8 690)                                                    | 9 860                   | 1 170                             |
| GLM          | (417)                                                      | (1 870)                 | (2 287)                           | 5 193                                                      | (6 570)                 | (1 377)                           |
| GST          | 5 041                                                      | (5 010)                 | 31                                | 613                                                        | (460)                   | 153                               |
| IND          | 449                                                        | (540)                   | (91)                              | 514                                                        | (930)                   | (416)                             |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| JPM          | \$ 17 110                                                  | \$ (19 670)             | \$ (2 560)                        | \$ 5 693                                                   | \$ (6 660)              | \$ (967)                          |
| MBG          | (4 934)                                                    | 6 470                   | 1 536                             | (29 838)                                                   | 32 130                  | 2 292                             |
| MYC          | (2 827)                                                    | 2 890                   | 63                                | (3 123)                                                    | 3 390                   | 267                               |
| MYI          | (5 947)                                                    | 6 200                   | 253                               | (779)                                                      | 730                     | (49)                              |
| NSL          | 780                                                        | (780)                   | 0                                 | (391)                                                      | 460                     | 69                                |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 13                                                         | 0                       | 13                                |
| RYL          | (16)                                                       | 0                       | (16)                              | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |
| SCX          | 5 044                                                      | (6 170)                 | (1 126)                           | (20 163)                                                   | 21 690                  | 1 527                             |
| SOG          | (24 783)                                                   | 25 490                  | 707                               | 29 550                                                     | (30 050)                | (500)                             |
| SSB          | 18 200                                                     | (18 880)                | (680)                             | 3 754                                                      | (3 790)                 | (36)                              |
| UAG          | (4 764)                                                    | 4 650                   | (114)                             | (1 619)                                                    | 1 400                   | (219)                             |
| WST          | (441)                                                      | 300                     | (141)                             | 914                                                        | (930)                   | (16)                              |

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

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 33,27            | 31,96                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 27,87            | 26,38                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,13             | 0,83                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,09             | 2,96                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,18             | 0,11                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,40             | 0,34                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,83             | 0,43                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,00             | 0,00                 |
| Autres actifs                                                    | 33,23            | 36,99                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 4,69             | 4,16                 |
| Belgique                          | 0,18             | 0,18                 |
| Bésil                             | 0,16             | S/O                  |
| Bulgarie                          | 0,23             | 0,30                 |
| Canada                            | 5,56             | 5,60                 |
| Îles Caïmans                      | 2,89             | 2,03                 |
| Chili                             | 0,08             | 0,08                 |
| Chine                             | 4,79             | 4,46                 |
| Colombie                          | 1,31             | 1,15                 |
| Costa Rica                        | 0,23             | 0,18                 |
| République tchèque                | 0,27             | 0,00                 |
| Danemark                          | 0,40             | 0,63                 |
| Égypte                            | 0,20             | 0,20                 |
| France                            | 5,54             | 6,71                 |
| Allemagne                         | 0,23             | 0,24                 |
| Hongrie                           | 0,40             | 0,41                 |
| Indonésie                         | 0,09             | 0,10                 |
| Irlande                           | 3,35             | 2,88                 |
| Israël                            | 1,26             | 1,06                 |
| Italie                            | 1,82             | 2,61                 |
| Japon                             | 3,77             | 4,70                 |
| Kazakhstan                        | 0,05             | 0,05                 |
| Koweït                            | 0,69             | 0,59                 |
| Luxembourg                        | 0,73             | 0,77                 |
| Malaisie                          | 0,94             | 0,95                 |
| Mexique                           | 0,14             | 0,14                 |
| Multinationales                   | 0,01             | 0,05                 |
| Pays-Bas                          | 0,51             | 0,56                 |
| Nouvelle-Zélande                  | 0,09             | 0,09                 |
| Nigeria                           | 0,05             | 0,08                 |
| Norvège                           | 0,39             | 0,40                 |
| Pérou                             | 2,18             | 1,86                 |
| Pologne                           | 0,12             | 0,19                 |
| Portugal                          | 0,01             | 0,01                 |
| Qatar                             | 0,35             | 0,07                 |
| Roumanie                          | 0,58             | 1,07                 |
| Arabie saoudite                   | 0,55             | 0,91                 |
| Singapour                         | 0,38             | 0,40                 |
| Slovaquie                         | 0,12             | 0,08                 |
| Afrique du Sud                    | 2,16             | 1,86                 |
| Corée du Sud                      | 1,51             | 1,41                 |
| Espagne                           | 3,09             | 3,41                 |
| Supranationales                   | 1,22             | 0,54                 |
| Suisse                            | 0,76             | 0,86                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Thaïlande                                                                                                | 0,66             | 0,63                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,75             | 0,13                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 9,29             | 9,34                 |
| États-Unis                                                                                               | 68,65            | 69,85                |
| Instruments à court terme                                                                                | 1,22             | 1,23                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 6,68             | 6,76                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,23             | 0,15                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,02)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,02             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,32             | (0,70)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,02                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,16             | 0,08                 |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | 0,06             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,86             | (0,72)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,82)           | 0,53                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,00             | 0,00                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (9,42)           | (7,29)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (32,70)          | (34,03)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES              |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS |                                     |                                  |                           | Equinix Europe Financing Corp. LLC      |                                     |                                  |                           | National Bank of Canada             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 19/05/2029                 |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 20/01/2031             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 7 000 \$                              |                                     |                                  |                           | € 8 700 \$                          |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8 008                                   |                                     |                                  |                           | 9 867                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,21                                    |                                     |                                  |                           | 0,25                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Banque européenne d'investissement      |                                     |                                  |                           | Nationwide Building Society         |                                     |                                  |                           |
| FPS Finance Co. LLC             |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 15/07/2027                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 24/03/2032             |                                     |                                  |                           |
| 6,590 % éch. 26/05/2028         |                                     |                                  |                           | AUD 5 000                               |                                     |                                  |                           | 3 328                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,09                                    |                                     |                                  |                           | 0,16                                |                                     |                                  |                           |
| Project Dorchester              |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 15/03/2034                 |                                     |                                  |                           | € 3 700                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4 140                                   |                                     |                                  |                           | 300                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (i)     |                                     |                                  |                           | € 4 800                                 |                                     |                                  |                           | 5 350                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,14                                    |                                     |                                  |                           | 0,11                                |                                     |                                  |                           |
| République du Panama            |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 03/02/2028                 |                                     |                                  |                           | AUD 1 000                           |                                     |                                  |                           |
| 4,979 % éch. 01/04/2027         |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 679                                 |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,02                                    |                                     |                                  |                           | 0,02                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | GA Global Funding Trust                 |                                     |                                  |                           | 12/05/2027 (e)(g)                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 08/01/2029                 |                                     |                                  |                           | £ 1 000                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | \$ 3 900                                |                                     |                                  |                           | 1 323                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3 941                                   |                                     |                                  |                           | 0,10                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,10                                    |                                     |                                  |                           | 0,10                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.               |                                     |                                  |                           | Nordea Kredit Realkreditatieselskab |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,650 % éch. 21/10/2032                 |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 21 300                                  |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 18 962                                  |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,49                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,984 % éch. 18/12/2036                 |                                     |                                  |                           | € 3 800                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4 355                                   |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,11                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,016 % éch. 23/10/2035 (j)             |                                     |                                  |                           | \$ 13 000                           |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 12 774                                  |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,33                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,536 % éch. 28/01/2036                 |                                     |                                  |                           | 5 690                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,15                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH      |                                     |                                  |                           | Banque nordique d'investissement    |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 05/06/2030                 |                                     |                                  |                           | € 4 400                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 4 400                                 |                                     |                                  |                           | 4 636                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 119                                   |                                     |                                  |                           | 0,12                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,13                                    |                                     |                                  |                           | 0,12                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                       |                                     |                                  |                           | Norinchukin Bank                    |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,856 % éch. 23/05/2033                 |                                     |                                  |                           | 5,359 % éch.                        |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 13 300                                  |                                     |                                  |                           | 09/09/2035 (j)                      |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 16 202                                  |                                     |                                  |                           | \$ 8 300                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,42                                    |                                     |                                  |                           | 8 248                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,21                                    |                                     |                                  |                           | 0,21                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | IHG Finance LLC                         |                                     |                                  |                           | Nykredit Realkredit A/S             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 27/09/2031                 |                                     |                                  |                           | 0,375 % éch. 17/01/2028             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 14 600                                  |                                     |                                  |                           | € 1 400                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 16 710                                  |                                     |                                  |                           | 1 539                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,43                                    |                                     |                                  |                           | 0,04                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 28/11/2029                 |                                     |                                  |                           | € 4 100                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6 400                                   |                                     |                                  |                           | 1 400                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7 550                                   |                                     |                                  |                           | 0,19                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,19                                    |                                     |                                  |                           | 0,19                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | ING Bank NV                             |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 08/04/2031                 |                                     |                                  |                           | DKK 0                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8 800                                   |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 10 154                                  |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,26                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | ING Belgium S.A.                        |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/02/2031                 |                                     |                                  |                           | 27                                  |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6 600                                   |                                     |                                  |                           | 3                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7 570                                   |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,19                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                            |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2050             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,335 % éch. 19/03/2030                 |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | \$ 6 200                                |                                     |                                  |                           | 0                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8 900                                   |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 9 070                                   |                                     |                                  |                           | 0,23                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,23                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Banque interaméricaine de développement |                                     |                                  |                           | Pacific Life Global Funding         |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 14/04/2027                 |                                     |                                  |                           | AUD 600                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 409                                     |                                     |                                  |                           | \$ 3 800                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,01                                    |                                     |                                  |                           | 3 867                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,01                                    |                                     |                                  |                           | 0,10                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Intesa Sanpaolo SpA                     |                                     |                                  |                           | Paychex, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 16/10/2030                 |                                     |                                  |                           | € 5 100 % éch. 15/04/2030           |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 4 100                                 |                                     |                                  |                           | 5 900                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4 775                                   |                                     |                                  |                           | 5 952                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,12                                    |                                     |                                  |                           | 0,15                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | JAB Holdings BV                         |                                     |                                  |                           | PPI Public Property Invest AB       |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 12/06/2033                 |                                     |                                  |                           | € 4,125 % éch. 21/04/2033           |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6 600                                   |                                     |                                  |                           | € 5 700                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8 084                                   |                                     |                                  |                           | 6 432                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,21                                    |                                     |                                  |                           | 0,17                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                    |                                     |                                  |                           | RBC International                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,588 % éch. 23/01/2036                 |                                     |                                  |                           | 4,660 % éch.                        |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 000                                   |                                     |                                  |                           | 16/12/2028 (i)                      |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8 050                                   |                                     |                                  |                           | \$ 5 000                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 9 308                                   |                                     |                                  |                           | 4 918                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,24                                    |                                     |                                  |                           | 0,13                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,565 % éch. 14/06/2030                 |                                     |                                  |                           | € 5 100                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | \$ 5 100                                |                                     |                                  |                           | 5 082                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 300                                   |                                     |                                  |                           | 0,13                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,350 % éch. 01/06/2034                 |                                     |                                  |                           | 3 900                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 300                                   |                                     |                                  |                           | 0,14                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,502 % éch. 24/01/2036                 |                                     |                                  |                           | 8 800                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8 800                                   |                                     |                                  |                           | 8 997                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,581 % éch. 22/04/2030                 |                                     |                                  |                           | 6 900                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6 900                                   |                                     |                                  |                           | 7 052                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,18                                    |                                     |                                  |                           | 0,18                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Jyske Realkredit A/S                    |                                     |                                  |                           | Royal Bank of Canada                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 01/10/2050                 |                                     |                                  |                           | 0,010 % éch. 05/10/2028             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | DKK 0                                   |                                     |                                  |                           | € 5 600                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0                                       |                                     |                                  |                           | € 6 016                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0                                       |                                     |                                  |                           | 0,15                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/07/2050                 |                                     |                                  |                           | 4,305 % éch. 03/11/2031             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0                                       |                                     |                                  |                           | \$ 1 300                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0                                       |                                     |                                  |                           | 1 275                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2050                 |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 17 164                                  |                                     |                                  |                           | 0,06                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2 149                                   |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0                                       |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,00                                    |                                     |                                  |                           | 0,00                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC                |                                     |                                  |                           | Sagax AB                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 14/05/2032                 |                                     |                                  |                           | € 3,375 % éch. 26/01/2031           |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 4 200                                 |                                     |                                  |                           | € 8 600                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4 905                                   |                                     |                                  |                           | 9 693                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,13                                    |                                     |                                  |                           | 0,25                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,425 % éch. 04/11/2031                 |                                     |                                  |                           | Santander UK Group Holdings PLC     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | \$ 300                                  |                                     |                                  |                           | 3,823 % éch. 03/11/2028             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 295                                     |                                     |                                  |                           | \$ 300                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 402                                     |                                     |                                  |                           | € 8 600                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,01                                    |                                     |                                  |                           | 297                                 |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,729 % éch. 04/11/2031                 |                                     |                                  |                           | € 11 993                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4 600                                   |                                     |                                  |                           | 0,31                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,679 % éch. 05/01/2035                 |                                     |                                  |                           | Santander UK PLC                    |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7 300                                   |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 12/01/2032             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7 495                                   |                                     |                                  |                           | € 3 200                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,19                                    |                                     |                                  |                           | 3 627                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 27/06/2029 (e)(g)          |                                     |                                  |                           | 0,09                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 800                                   |                                     |                                  |                           | 14 400                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1 108                                   |                                     |                                  |                           | 0,42                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 27/09/2027 (e)(g)          |                                     |                                  |                           | SR-Boligkredit A/S                  |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 300                                     |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 27/02/2033             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 412                                     |                                     |                                  |                           | 9 500                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,01                                    |                                     |                                  |                           | 10 696                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Low Income Investment Fund              |                                     |                                  |                           | 0,28                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,386 % éch. 01/07/2026                 |                                     |                                  |                           | Sumitomo Mitsui Banking Corp.       |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | \$ 750                                  |                                     |                                  |                           | 0,409 % éch. 07/11/2029             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 750                                     |                                     |                                  |                           | 1 300                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1 869                                   |                                     |                                  |                           | 1 366                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,05                                    |                                     |                                  |                           | 0,04                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | MDGH GMTN RSC Ltd.                      |                                     |                                  |                           | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 28/04/2033                 |                                     |                                  |                           | 0,010 % éch. 15/10/2027             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1 400                                   |                                     |                                  |                           | 2 500                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1 437                                   |                                     |                                  |                           | 2 753                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,04                                    |                                     |                                  |                           | 0,07                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.    |                                     |                                  |                           | Toronto-Dominion Bank               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,527 % éch. 12/09/2031                 |                                     |                                  |                           | 3,191 % éch. 16/02/2029             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 900                                   |                                     |                                  |                           | 13 500                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 200                                   |                                     |                                  |                           | 15 571                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7 800                                   |                                     |                                  |                           | € 6 200                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,426 % éch. 17/04/2035                 |                                     |                                  |                           | 12/06/2028                          |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,615 % éch. 24/04/2036                 |                                     |                                  |                           | € 2 000                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7 800                                   |                                     |                                  |                           | 2 000                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,21                                    |                                     |                                  |                           | 9 029                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Mizuho Financial Group, Inc.            |                                     |                                  |                           | € 8 100                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,210 % éch. 16/05/2032                 |                                     |                                  |                           | € 2 000                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 21 800                                |                                     |                                  |                           | \$ 2 000                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 24 667                                  |                                     |                                  |                           | 3 100                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,63                                    |                                     |                                  |                           | 3 027                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley                          |                                     |                                  |                           | 0,08                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,149 % éch. 07/11/2031                 |                                     |                                  |                           | 6,246 % éch. 22/09/2029             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3 600                                   |                                     |                                  |                           | 500                                 |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 12 400                                  |                                     |                                  |                           | 516                                 |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3 500                                   |                                     |                                  |                           | 0,01                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,383 % éch. 23/01/2032                 |                                     |                                  |                           | UniCredit SpA                       |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,749 % éch. 07/11/2036                 |                                     |                                  |                           | 3,127 % éch. 03/06/2032             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6 200                                   |                                     |                                  |                           | 4 700                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,790 % éch. 21/03/2030                 |                                     |                                  |                           | 4 314                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 17 969                                  |                                     |                                  |                           | 0,11                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,656 % éch. 18/04/2030                 |                                     |                                  |                           | Westpac Banking Corp.               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | \$ 5 100                                |                                     |                                  |                           | 3,038 % éch. 01/03/2030             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5 210                                   |                                     |                                  |                           | € 9 000                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,13                                    |                                     |                                  |                           | 10 344                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | National Australia Bank Ltd.            |                                     |                                  |                           | 3,131 % éch. 15/04/2031             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,146 % éch. 05/02/2031                 |                                     |                                  |                           | 16 600                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | € 11 000                                |                                     |                                  |                           | 19 101                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 12 663                                  |                                     |                                  |                           | 0,49                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 0,33                                    |                                     |                                  |                           | 0,15                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | Yorkshire Building Society          |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 28/01/2030             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 5 300                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 6 008                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 0,15                                |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 776 315                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 19,99                               |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Amgen, Inc.                            |                                     |                                  |                           | Hanwha Energy USA Holdings Corp.                               |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 02/03/2028                | \$ 5 700                            | \$ 5 755                         | 0,15                      | 4,375 % éch. 02/07/2028                                        | \$ 24 500                           | \$ 24 427                        | 0,63                      | Obligations du Trésor américain                                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 02/03/2030                | 4 900                               | 4 993                            | 0,13                      | National Grid PLC                                              |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 15/02/2041 (j)(k)                                                                | \$ 42 500                           | \$ 29 502                        | 0,76                      |
| Amprion GmbH                           |                                     |                                  |                           | 4,275 % éch. 16/01/2035                                        | € 8 730                             | 10 336                           | 0,27                      | 2,250 % éch. 15/08/2049 (k)                                                                   | 5 875                               | 3 656                            | 0,09                      |
| 4,125 % éch. 07/09/2034                | € 3 000                             | 3 530                            | 0,09                      | 5,809 % éch. 12/06/2033                                        | \$ 3 800                            | 3 958                            | 0,10                      | 2,375 % éch. 15/11/2049 (j)                                                                   | 14 075                              | 8 969                            | 0,23                      |
| Astrazeneca Finance LLC                |                                     |                                  |                           | New York State Electric & Gas Corp.                            |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 15/05/2052 (k)                                                                   | 3 700                               | 2 560                            | 0,07                      |
| 4,900 % éch. 26/02/2031                | \$ 6 300                            | 6 388                            | 0,16                      | 5,650 % éch. 15/08/2028                                        | 4 000                               | 4 075                            | 0,11                      | 3,000 % éch. 15/02/2048 (k)                                                                   | 8 500                               | 6 261                            | 0,16                      |
| Beignet Investor LLC                   |                                     |                                  |                           | Oncor Electric Delivery Co. LLC                                |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/08/2048 (j)(k)                                                                | 13 150                              | 9 638                            | 0,25                      |
| 6,581 % éch. 30/05/2049                | 40 000                              | 40 826                           | 1,05                      | 5,700 % éch. 24/06/2033                                        | AUD 9 600                           | 6 687                            | 0,17                      | 3,000 % éch. 15/02/2049 (k)                                                                   | 6 325                               | 4 613                            | 0,12                      |
| Burberry Group PLC                     |                                     |                                  |                           | Pacific Gas & Electric Co.                                     |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/11/2048 (j)(k)                                                                | 20 900                              | 16 354                           | 0,42                      |
| 5,750 % éch. 20/06/2030                | £ 8 800                             | 11 794                           | 0,30                      | 5,800 % éch. 15/05/2034                                        | \$ 4 700                            | 4 806                            | 0,12                      | 4,125 % éch. 15/08/2044 (j)(k)                                                                | 82 600                              | 74 727                           | 1,92                      |
| Central Nippon Expressway Co. Ltd.     |                                     |                                  |                           | Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.                                   |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/11/2054 (j)                                                                   | 140 000                             | 130 350                          | 3,36                      |
| 4,124 % éch. 25/02/2031                | \$ 10 800                           | 10 662                           | 0,27                      | 6,500 % éch. 02/02/2031                                        | 1 600                               | 1 584                            | 0,04                      | 4,625 % éch. 15/02/2046 (j)(k)                                                                | 1 300                               | 1 248                            | 0,03                      |
| Continental Wind LLC                   |                                     |                                  |                           | Severn Trent Utilities Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/02/2055 (j)(k)                                                                | 51 900                              | 49 331                           | 1,27                      |
| 6,000 % éch. 28/02/2033                | 1 220                               | 1 232                            | 0,03                      | 3,875 % éch. 04/08/2035                                        | € 3 300                             | 3 760                            | 0,10                      | 4,750 % éch. 15/02/2056 (j)                                                                   | 700                                 | 680                              | 0,02                      |
| Elevance Health, Inc.                  |                                     |                                  |                           | Southern California Edison Co.                                 |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/08/2045 (j)                                                                   | 1 196                               | 1 187                            | 0,03                      |
| 5,375 % éch. 15/06/2034                | 5 200                               | 5 282                            | 0,14                      | 5,450 % éch. 01/03/2035                                        | \$ 7 700                            | 7 718                            | 0,20                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)                                    |                                     |                                  |                           |
| Eli Lilly & Co.                        |                                     |                                  |                           | Stedin Holding NV                                              |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/07/2031 (j)                                                                   | 23 477                              | 21 560                           | 0,55                      |
| 4,600 % éch. 14/08/2034                | 10 200                              | 10 089                           | 0,26                      | 3,625 % éch. 20/06/2031                                        | € 6 200                             | 7 218                            | 0,19                      | 0,500 % éch. 15/01/2028 (j)                                                                   | 11 473                              | 11 183                           | 0,29                      |
| Gatwick Funding Ltd.                   |                                     |                                  |                           | SW Finance PLC                                                 |                                     |                                  |                           | 0,625 % éch. 15/07/2032                                                                       | 1 719                               | 1 592                            | 0,04                      |
| 3,625 % éch. 16/10/2035                | € 5 200                             | 5 902                            | 0,15                      | 6,875 % éch. 07/08/2032                                        | £ 7 900                             | 10 563                           | 0,27                      | 1,125 % éch. 15/01/2033 (j)(k)                                                                | 38 113                              | 36 061                           | 0,93                      |
| 3,875 % éch. 24/06/2035                | 8 800                               | 9 998                            | 0,26                      | 7,750 % éch. 31/10/2031                                        | 2 800                               | 3 859                            | 0,10                      | 2,500 % éch. 15/01/2029                                                                       | 4 574                               | 4 634                            | 0,12                      |
| Haleon UK Capital PLC                  |                                     |                                  |                           | United Utilities Water Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/04/2029                                                                       | 810                                 | 851                              | 0,02                      |
| 4,625 % éch. 18/09/2033                | £ 4 100                             | 5 323                            | 0,14                      | 3,500 % éch. 27/02/2033                                        | € 14 900                            | 16 861                           | 0,43                      | Billets du Trésor américain                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     | 143 028                          | 3,68                      | 0,375 % éch. 30/09/2027 (k)                                                                   | 2 900                               | 2 769                            | 0,07                      |
| 5,000 % éch. 27/07/2028                | \$ 6 500                            | 6 554                            | 0,17                      | Total des Obligations et billets privés                        |                                     | 1 210 367                        | 31,17                     | 0,625 % éch. 30/11/2027 (j)(k)                                                                | 12 800                              | 12 185                           | 0,31                      |
| HCA, Inc.                              |                                     |                                  |                           | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 31/01/2028 (j)(k)                                                                | 11 700                              | 11 093                           | 0,29                      |
| 5,600 % éch. 01/04/2034                | 9 500                               | 9 704                            | 0,25                      | Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/02/2034 (k)                                                                   | 7 200                               | 7 035                            | 0,18                      |
| 5,750 % éch. 01/03/2035                | 4 000                               | 4 125                            | 0,11                      | 3,000 % éch. 01/03/2060                                        | \$ 804                              | 695                              | 0,02                      | 4,125 % éch. 15/02/2036 (j)(k)                                                                | 9 560                               | 9 328                            | 0,24                      |
| Keurig Dr Pepper, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/01/2059                                        | 480                                 | 430                              | 0,01                      | 4,250 % éch. 15/08/2035 (j)(k)                                                                | 1 800                               | 1 777                            | 0,05                      |
| 5,050 % éch. 15/03/2029                | 4 300                               | 4 333                            | 0,11                      | 4,788 % éch. 25/03/2055                                        | 9 474                               | 9 585                            | 0,25                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| Kraft Heinz Foods Co.                  |                                     |                                  |                           | Freddie Mac                                                    |                                     |                                  |                           | Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                             |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 15/03/2029                | € 1 400                             | 1 615                            | 0,04                      | 3,500 % éch. 01/05/2048                                        | 4 094                               | 3 774                            | 0,10                      | 4,596 % éch. 18/12/2066                                                                       | £ 2 257                             | 2 997                            | 0,08                      |
| Motability Operations Group PLC        |                                     |                                  |                           | 4,568 % éch. 25/11/2054                                        | 8 365                               | 8 434                            | 0,22                      | American Home Mortgage Assets Trust                                                           |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 22/01/2033                | 4 900                               | 5 564                            | 0,14                      | 4,578 % éch. 25/10/2054                                        | 8 994                               | 9 071                            | 0,23                      | 3,953 % éch. 25/10/2046                                                                       | \$ 919                              | 458                              | 0,01                      |
| 3,875 % éch. 24/01/2034                | 4 600                               | 5 272                            | 0,14                      | 5,028 % éch. 25/03/2055                                        | 5 930                               | 5 995                            | 0,15                      | 4,684 % éch. 25/10/2046                                                                       | 69                                  | 45                               | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 17/01/2030                | 2 600                               | 3 031                            | 0,08                      | 5,078 % éch. 25/06/2055                                        | 9 262                               | 9 388                            | 0,24                      | American Home Mortgage Investment Trust                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 17/06/2035                | 3 600                               | 4 192                            | 0,11                      | Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | 5,770 % éch. 25/09/2035                                                                       | 146                                 | 53                               | 0,00                      |
| Norsk Hydro ASA                        |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/02/2055                           | 82 394                              | 73 266                           | 1,89                      | Atlas Funding PLC                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 23/01/2032                | 1 300                               | 1 497                            | 0,04                      | 3,500 % éch. 20/05/2052 - 20/12/2055                           | 9 573                               | 8 663                            | 0,22                      | 4,524 % éch. 20/07/2067                                                                       | £ 1 881                             | 2 496                            | 0,06                      |
| NTT Finance Corp.                      |                                     |                                  |                           | 4,259 % éch. 20/02/2074                                        | 2 601                               | 2 609                            | 0,07                      | Atrium Hotel Portfolio Trust                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,665 % éch. 20/06/2031 (a)            | \$ 9 700                            | 9 698                            | 0,25                      | 4,539 % éch. 20/01/2074                                        | 3 400                               | 3 454                            | 0,09                      | 4,853 % éch. 15/12/2036                                                                       | \$ 4 085                            | 4 067                            | 0,10                      |
| RD Michigan Property Owner LLC         |                                     |                                  |                           | 4,898 % éch. 20/04/2067                                        | 61                                  | 61                               | 0,00                      | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                | 20 000                              | 19 945                           | 0,51                      | 6,500 % éch. 20/08/2054                                        | 128                                 | 133                              | 0,00                      | 4,394 % éch. 25/11/2036                                                                       | 546                                 | 271                              | 0,01                      |
| Robert Bosch GmbH                      |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Mortgage Funding Trust                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 21/05/2036                | € 3 900                             | 4 479                            | 0,12                      | 2,500 % éch. 01/07/2056                                        | 37 500                              | 32 024                           | 0,82                      | 4,103 % éch. 25/06/2047                                                                       | 742                                 | 658                              | 0,02                      |
| Sandoz Finance BV                      |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/07/2056                                        | 31 700                              | 28 139                           | 0,72                      | Braccan Mortgage Funding PLC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 26/03/2035                | 6 800                               | 7 911                            | 0,20                      | 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 155 000                             | 139 167                          | 3,58                      | 4,587 % éch. 15/02/2067                                                                       | £ 6 231                             | 8 275                            | 0,21                      |
| SGS Finance BV                         |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2056                                        | 155 000                             | 160 595                          | 4,14                      | Canada Square Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 10/09/2030                | 8 500                               | 9 666                            | 0,25                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | 5,409 % éch. 17/06/2058                                                                       | 222                                 | 296                              | 0,01                      |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV   |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/03/2047 - 01/09/2047                           | 2 607                               | 2 418                            | 0,06                      | Chase Mortgage Finance Trust                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 22/02/2037                | 3 700                               | 4 147                            | 0,11                      | 4,000 % éch. 01/07/2048 - 01/07/2053                           | 40 524                              | 38 026                           | 0,98                      | 4,763 % éch. 25/07/2037                                                                       | \$ 5                                | 4                                | 0,00                      |
| Stryker Corp.                          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/06/2053 - 01/07/2053                           | 26 570                              | 25 601                           | 0,66                      | Citigroup Mortgage Loan Trust                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 11/09/2036                | 13 500                              | 15 333                           | 0,39                      | 5,000 % éch. 01/02/2053 - 01/07/2054                           | 35 335                              | 34 981                           | 0,90                      | 3,250 % éch. 25/03/2061                                                                       | 878                                 | 866                              | 0,02                      |
| Synopsys, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/02/2053 - 01/09/2053                           | 67 299                              | 67 950                           | 1,75                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,850 % éch. 01/04/2030                | \$ 3 900                            | 3 907                            | 0,10                      | 6,000 % éch. 01/01/2053 - 01/09/2053                           | 14 175                              | 14 563                           | 0,38                      | 4,802 % éch. 25/12/2035                                                                       | 273                                 | 161                              | 0,00                      |
| T-Mobile USA, Inc.                     |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | Commercial Mortgage Trust                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 15/01/2035                | 7 800                               | 7 531                            | 0,19                      | 2,500 % éch. 01/08/2056                                        | 28 400                              | 23 725                           | 0,61                      | 4,228 % éch. 10/05/2051                                                                       | 1 700                               | 1 668                            | 0,04                      |
| 5,050 % éch. 15/07/2033                | 7 600                               | 7 590                            | 0,20                      | 4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 45 630                              | 42 642                           | 1,10                      | Countrywide Alternative Loan Trust                                                            |                                     |                                  |                           |
| Vmed O2 UK Financing PLC               |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 128 740                             | 123 240                          | 3,17                      | 4,003 % éch. 25/06/2036                                                                       | 51                                  | 49                               | 0,00                      |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                | € 12 200                            | 12 294                           | 0,32                      | 5,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 993 850                             | 975 565                          | 25,13                     | 4,183 % éch. 25/07/2046                                                                       | 326                                 | 308                              | 0,01                      |
| 6,750 % éch. 15/01/2033                | \$ 2 200                            | 1 865                            | 0,05                      | 5,500 % éch. 01/08/2056                                        | 83 150                              | 83 305                           | 2,15                      | 4,243 % éch. 25/08/2047                                                                       | 599                                 | 561                              | 0,01                      |
| Weir Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/07/2056                                        | 13 600                              | 13 905                           | 0,36                      | 5,500 % éch. 25/11/2034                                                                       | 37                                  | 37                               | 0,00                      |
| 5,350 % éch. 06/05/2030                | 7 000                               | 7 064                            | 0,18                      |                                                                |                                     | 1 941 404                        | 50,00                     | 6,250 % éch. 25/12/2036                                                                       | 1 021                               | 390                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                             |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/04/2046                                                                       | 1 851                               | 509                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,343 % éch. 25/03/2035                                                                       | 253                                 | 237                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,443 % éch. 25/03/2035                                                                       | 52                                  | 51                               | 0,00                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2036                                                                       | 236                                 | 106                              | 0,00                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/12/2036                                                                       | 601                                 | 261                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/03/2037                                                                       | 577                                 | 234                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/11/2047                                                                       | 91                                  | 40                               | 0,00                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>                                          |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/09/2047                                                                       | 570                                 | 503                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 4,323 % éch. 25/08/2036                                                                       | 3 126                               | 2 912                            | 0,08                      |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Elstree PLC                                           |                                     |                                  |                           | 4,054 % éch. 25/09/2036                                    | \$ 48                               | 41                               | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/04/2037                               | \$ 2 625                            | 1 281                            | 0,03                      |
| 4,475 % éch. 21/10/2065                               | £ 8 473                             | \$ 11 234                        | 0,29                      | 4,408 % éch. 25/10/2035                                    | 60                                  | 56                               | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/01/2037                               | 208                                 | 136                              | 0,00                      |
| EMF-UK PLC                                            |                                     |                                  |                           | 4,744 % éch. 25/02/2046                                    | 217                                 | 202                              | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/03/2037                               | 811                                 | 537                              | 0,01                      |
| 4,846 % éch. 13/03/2046                               | 89                                  | 119                              | 0,00                      | 5,270 % éch. 25/09/2033                                    | 28                                  | 27                               | 0,00                      | Renaissance Home Equity Loan Trust                    |                                     |                                  |                           |
| Eurohome UK Mortgages PLC                             |                                     |                                  |                           | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | 5,762 % éch. 25/08/2036                               | 708                                 | 230                              | 0,01                      |
| 4,016 % éch. 15/06/2044                               | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,213 % éch. 25/04/2035                                    | 221                                 | 189                              | 0,00                      | Residential Asset Securities Corp. Trust              |                                     |                                  |                           |
| EuroMASTR PLC                                         |                                     |                                  |                           | Winchester PLC                                             |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/12/2035                               | 3 771                               | 3 682                            | 0,10                      |
| 4,066 % éch. 15/06/2040                               | 23                                  | 30                               | 0,00                      | 4,637 % éch. 21/10/2056                                    | £ 6 941                             | 9 222                            | 0,24                      | Saxon Asset Securities Trust                          |                                     |                                  |                           |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     | 179 437                          | 4,62                      | 1,661 % éch. 25/05/2035                               | 1 463                               | 1 428                            | 0,04                      |
| 6,250 % éch. 25/11/2036                               | \$ 32                               | 8                                | 0,00                      | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                 |                                     |                                  |                           | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust        |                                     |                                  |                           |
| Frontier Mortgage Funding PLC                         |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES              |                                     |                                  |                           | 4,483 % éch. 25/10/2035                               | 4 500                               | 4 062                            | 0,11                      |
| 4,464 % éch. 20/12/2066                               | £ 4 764                             | 6 315                            | 0,16                      | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                          |                                     |                                  |                           | Soundview Home Loan Trust                             |                                     |                                  |                           |
| GSR Mortgage Loan Trust                               |                                     |                                  |                           | 2,953 % éch. 26/12/2041                                    | € 8 100                             | 9 277                            | 0,24                      | 4,168 % éch. 25/12/2036                               | 826                                 | 812                              | 0,02                      |
| 4,596 % éch. 25/11/2035                               | \$ 30                               | 29                               | 0,00                      | Golden Bar Securitisation SRL                              |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/11/2036                               | 675                                 | 649                              | 0,02                      |
| 5,727 % éch. 25/10/2035                               | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 3,436 % éch. 22/09/2043                                    | 899                                 | 1 034                            | 0,03                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| Harbour PLC                                           |                                     |                                  |                           | LT Autorahoitus DAC                                        |                                     |                                  |                           | 4,288 % éch. 25/07/2036                               | 725                                 | 702                              | 0,02                      |
| 4,797 % éch. 28/10/2054                               | £ 3 782                             | 5 036                            | 0,13                      | 2,899 % éch. 18/07/2033                                    | 1 159                               | 1 327                            | 0,03                      | Terwin Mortgage Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| Hops Hill PLC                                         |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     | 11 638                           | 0,30                      | 4,703 % éch. 25/11/2033                               | 4                                   | 3                                | 0,00                      |
| 4,614 % éch. 21/04/2056                               | 7 623                               | 10 126                           | 0,26                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                        |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                     |                                  |                           |
| Impac Secured Assets Trust                            |                                     |                                  |                           | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                |                                     |                                  |                           | 4,108 % éch. 25/01/2037                               | 1 535                               | 1 534                            | 0,04                      |
| 4,283 % éch. 25/01/2037                               | \$ 326                              | 289                              | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/12/2034                                    | \$ 76                               | 70                               | 0,00                      |                                                       |                                     | 51 209                           | 1,32                      |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                           |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/08/2035                                    | 875                                 | 863                              | 0,02                      | AUTRES TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                     |                                     |                                  |                           |
| 4,103 % éch. 25/11/2036                               | 1 821                               | 1 891                            | 0,05                      | Argent Securities Trust                                    |                                     |                                  |                           | Ares European CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,355 % éch. 25/12/2034                               | 90                                  | 86                               | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/04/2036                                    | 4 678                               | 1 415                            | 0,04                      | 2,984 % éch. 15/10/2031                               | € 220                               | 252                              | 0,01                      |
| JP Morgan Mortgage Trust                              |                                     |                                  |                           | Bayview Financial Asset Trust                              |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 20/04/2032                               | 4 737                               | 5 419                            | 0,14                      |
| 5,831 % éch. 25/08/2035                               | 55                                  | 54                               | 0,00                      | 5,263 % éch. 25/03/2037                                    | 72                                  | 74                               | 0,00                      | 3,512 % éch. 15/07/2037                               | 9 000                               | 10 298                           | 0,26                      |
| JPMorgan Alternative Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.          |                                     |                                  |                           | Aurium CLO DAC                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/10/2036                               | 161                                 | 150                              | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/02/2036                                    | 340                                 | 325                              | 0,01                      | 2,973 % éch. 16/01/2031                               | 1 972                               | 2 258                            | 0,06                      |
| JPMorgan Mortgage Trust                               |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/07/2037                                    | 1 428                               | 1 313                            | 0,03                      | Avoca CLO DAC                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/06/2037                               | 747                                 | 278                              | 0,01                      | 4,203 % éch. 25/09/2037                                    | 103                                 | 113                              | 0,00                      | 3,164 % éch. 15/10/2034                               | 3 000                               | 3 433                            | 0,09                      |
| Kinbane DAC                                           |                                     |                                  |                           | 4,223 % éch. 25/04/2047                                    | 4 779                               | 4 411                            | 0,11                      | Bauhinia Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| 3,379 % éch. 24/01/2063                               | € 7 876                             | 9 021                            | 0,23                      | 4,738 % éch. 25/01/2036                                    | 1 319                               | 1 302                            | 0,03                      | 4,919 % éch. 19/10/2045                               | \$ 5 324                            | 5 316                            | 0,14                      |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC                    |                                     |                                  |                           | Encore Credit Receivables Trust                            |                                     |                                  |                           | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.              |                                     |                                  |                           |
| 4,546 % éch. 15/03/2061                               | £ 7 491                             | 9 949                            | 0,26                      | 4,453 % éch. 25/07/2035                                    | 236                                 | 232                              | 0,01                      | 5,026 % éch. 11/04/2043                               | 5 804                               | 5 805                            | 0,15                      |
| Lehman XS Trust                                       |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           | Black Diamond CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,244 % éch. 25/03/2047                               | \$ 313                              | 290                              | 0,01                      | 4,828 % éch. 25/06/2035                                    | 53                                  | 53                               | 0,00                      | 3,263 % éch. 15/05/2032                               | € 362                               | 414                              | 0,01                      |
| Ludgate Funding PLC                                   |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                                |                                     |                                  |                           | BlueMountain Fuji Euro CLO DAC                        |                                     |                                  |                           |
| 4,026 % éch. 01/01/2061                               | £ 1 178                             | 1 524                            | 0,04                      | 4,263 % éch. 25/05/2046                                    | 727                                 | 702                              | 0,02                      | 3,114 % éch. 15/01/2033                               | 1 364                               | 1 561                            | 0,04                      |
| 4,466 % éch. 01/01/2061                               | 992                                 | 1 308                            | 0,03                      | 4,483 % éch. 25/11/2035                                    | 2 675                               | 2 347                            | 0,06                      | BNPP AM Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           |
| Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust            |                                     |                                  |                           | Home Equity Asset Trust                                    |                                     |                                  |                           | 3,014 % éch. 22/07/2032                               | 4 272                               | 4 883                            | 0,13                      |
| 3,294 % éch. 25/10/2047                               | \$ 9 654                            | 2 293                            | 0,06                      | 4,438 % éch. 25/02/2036                                    | 388                                 | 380                              | 0,01                      | Bridgepoint CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| New Residential Mortgage Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust               |                                     |                                  |                           | 3,414 % éch. 15/01/2034                               | 1 993                               | 2 281                            | 0,06                      |
| 3,500 % éch. 25/12/2057                               | 543                                 | 526                              | 0,01                      | 3,983 % éch. 25/04/2037                                    | 207                                 | 163                              | 0,01                      | Cairn CLO DAC                                         |                                     |                                  |                           |
| Pierpont BTL PLC                                      |                                     |                                  |                           | 5,713 % éch. 25/03/2035                                    | 1 295                               | 1 222                            | 0,03                      | 3,434 % éch. 15/01/2040                               | 6 200                               | 7 094                            | 0,18                      |
| 4,586 % éch. 21/09/2061                               | £ 2 360                             | 3 134                            | 0,08                      | HSI Asset Securitization Corp. Trust                       |                                     |                                  |                           | Capital Four CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                      |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/01/2037                                    | 1 252                               | 960                              | 0,03                      | 3,394 % éch. 15/04/2038                               | 8 300                               | 9 490                            | 0,24                      |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (a)                           | AUD 55 674                          | 38 445                           | 0,99                      | IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust       |                                     |                                  |                           | Carlyle Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,713 % éch. 30/12/2057 (a)                           | 3 139                               | 2 170                            | 0,06                      | 4,270 % éch. 25/03/2035                                    | 1 141                               | 1 112                            | 0,03                      | 3,173 % éch. 15/08/2032                               | 567                                 | 648                              | 0,02                      |
| 5,863 % éch. 30/12/2057 (a)                           | 2 198                               | 1 519                            | 0,04                      | Long Beach Mortgage Loan Trust                             |                                     |                                  |                           | CVC Cordatus Loan Fund DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 6,163 % éch. 30/12/2057 (a)                           | 1 151                               | 796                              | 0,02                      | 4,363 % éch. 25/01/2036                                    | 532                                 | 483                              | 0,01                      | 3,066 % éch. 25/04/2036                               | 1 000                               | 1 144                            | 0,03                      |
| 6,563 % éch. 30/12/2057 (a)                           | 838                                 | 579                              | 0,02                      | MASTR Asset-Backed Securities Trust                        |                                     |                                  |                           | Dillon's Park CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust              |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/08/2036                                    | 11 555                              | 3 938                            | 0,10                      | 3,224 % éch. 15/10/2034                               | 5 500                               | 6 293                            | 0,16                      |
| 3,870 % éch. 25/11/2037                               | \$ 210                              | 176                              | 0,00                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                     |                                     |                                  |                           | Dryden Euro CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/06/2037                               | 204                                 | 201                              | 0,01                      | 4,003 % éch. 25/02/2037                                    | 582                                 | 160                              | 0,00                      | 3,143 % éch. 15/05/2034                               | 347                                 | 397                              | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                               | 271                                 | 225                              | 0,01                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                     |                                     |                                  |                           | Euro-Galaxy CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| RMAC PLC                                              |                                     |                                  |                           | 3,833 % éch. 25/10/2036                                    | 730                                 | 316                              | 0,01                      | 2,995 % éch. 25/07/2035                               | 1 397                               | 1 595                            | 0,04                      |
| 4,947 % éch. 15/02/2047                               | £ 6 667                             | 8 853                            | 0,23                      | 3,863 % éch. 25/11/2036                                    | 5 148                               | 2 446                            | 0,06                      | Grosvenor Place CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |
| RMAC Securities PLC                                   |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/07/2036                                    | 46                                  | 42                               | 0,00                      | 3,444 % éch. 15/01/2039                               | 11 200                              | 12 820                           | 0,33                      |
| 4,036 % éch. 12/06/2044                               | 21                                  | 27                               | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/12/2034                                    | 478                                 | 453                              | 0,01                      | Harvest CLO DAC                                       |                                     |                                  |                           |
| Sequoia Mortgage Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,438 % éch. 25/09/2035                                    | 1 995                               | 1 909                            | 0,05                      | 3,054 % éch. 15/01/2032                               | 2 684                               | 3 070                            | 0,08                      |
| 4,015 % éch. 20/07/2037                               | \$ 146                              | 111                              | 0,00                      | 4,723 % éch. 25/09/2034                                    | 439                                 | 479                              | 0,01                      | 3,464 % éch. 15/10/2038                               | 3 200                               | 3 664                            | 0,09                      |
| Stratton Mortgage Funding PLC                         |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Structured Trust                            |                                     |                                  |                           | ICG Euro CLO DAC                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,721 % éch. 25/06/2049                               | £ 3 335                             | 4 429                            | 0,11                      | 4,063 % éch. 25/06/2037                                    | 2 107                               | 1 956                            | 0,05                      | 3,455 % éch. 26/01/2038                               | 9 400                               | 10 758                           | 0,28                      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           | New Century Home Equity Loan Trust                         |                                     |                                  |                           | Madison Park Euro Funding DAC                         |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/01/2036                               | \$ 114                              | 97                               | 0,00                      | 4,528 % éch. 25/02/2035                                    | 1 861                               | 1 838                            | 0,05                      | 3,004 % éch. 15/07/2032                               | 5 128                               | 5 870                            | 0,15                      |
| 4,053 % éch. 25/10/2036                               | 225                                 | 193                              | 0,01                      | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust       |                                     |                                  |                           | Margay CLO DAC                                        |                                     |                                  |                           |
| TBW Mortgage-Backed Trust                             |                                     |                                  |                           | 4,393 % éch. 25/02/2036                                    | 2 917                               | 2 655                            | 0,07                      | 3,439 % éch. 15/07/2037                               | 1 800                               | 2 060                            | 0,05                      |
| 5,965 % éch. 25/07/2037                               | 2 086                               | 580                              | 0,02                      | NovaStar Mortgage Funding Trust                            |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                                      |                                     |                                  |                           |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                       |                                     |                                  |                           | 3,963 % éch. 25/01/2037                                    | 2 266                               | 730                              | 0,02                      | 3,158 % éch. 20/04/2035                               | 11 300                              | 12 931                           | 0,33                      |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                               | £ 7 526                             | 9 995                            | 0,26                      | 4,303 % éch. 25/05/2036                                    | 1 641                               | 1 612                            | 0,04                      | Providus CLO DAC                                      |                                     |                                  |                           |
| Tower Bridge Funding PLC                              |                                     |                                  |                           | Option One Mortgage Loan Trust                             |                                     |                                  |                           | 3,364 % éch. 15/10/2038                               | 6 400                               | 7 329                            | 0,19                      |
| 4,497 % éch. 20/01/2073                               | 5 152                               | 6 833                            | 0,18                      | 3,903 % éch. 25/03/2037                                    | 87                                  | 79                               | 0,00                      | Sculptor European CLO DAC                             |                                     |                                  |                           |
| Uropa Securities PLC                                  |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           | 3,254 % éch. 15/10/2034                               | 8 672                               | 9 932                            | 0,26                      |
| 4,216 % éch. 10/10/2040                               | 248                                 | 316                              | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust         |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,976 % éch. 25/02/2037                               | \$ 2 143                            | 1 942                            | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |          |      |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------|------|
| Toro European CLO DAC                                 |                                     |                                |                           | Development Bank of Kazakhstan JSC                                |                                     |                                  |                           | Émission d'investissement du gouvernement malaisien |                                                        |                                  |                           |          |      |
| 3,093 % éch. 15/02/2034                               | €                                   | 3 637                          | \$ 4 162                  | 18,400 % éch. 16/10/2028                                          | KZT                                 | 1 037 000                        | \$ 2 259                  | 0,06                                                | 4,193 % éch. 07/10/2032                                | MYR                              | 16 550                    | \$ 4 219 | 0,11 |
| Venture CLO Ltd.                                      |                                     |                                |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain  |                                                        |                                  |                           |          |      |
| 5,195 % éch. 15/01/2032                               | \$                                  | 505                            | 506                       | 21,954 % éch. 04/03/2028                                          | EGP                                 | 417 200                          | 8 232                     | 0,21                                                | 4,490 % éch. 25/05/2032                                | €                                | 4 500                     | 5 235    | 0,13 |
|                                                       |                                     |                                | 141 683                   | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 27/04/2051                             | \$                                                     | 500                              | 396                       | 0,01     |      |
|                                                       |                                     |                                | 3,65                      |                                                                   |                                     |                                  |                           | Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap              |                                                        |                                  |                           |          |      |
|                                                       |                                     |                                |                           | 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | \$                                  | 10 400                           | 10 366                    | 0,27                                                | 0,875 % éch. 21/03/2046                                | €                                | 3 800                     | 2 424    | 0,06 |
| PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE               |                                     |                                |                           | Union européenne                                                  |                                     |                                  |                           | Nederlandse Waterschapsbank NV                      |                                                        |                                  |                           |          |      |
| Curzon Mortgages PLC                                  |                                     |                                |                           | 2,500 % éch. 14/10/2030                                           | €                                   | 8 400                            | 9 505                     | 0,24                                                | 2,500 % éch. 13/09/2027                                |                                  | 38 200                    | 43 603   | 1,12 |
| 4,592 % éch. 28/07/2049                               | £                                   | 5 400                          | 7 170                     | 2,750 % éch. 13/12/2032                                           |                                     | 3 400                            | 3 844                     | 0,10                                                | 2,750 % éch. 24/09/2032                                |                                  | 4 700                     | 5 312    | 0,14 |
|                                                       |                                     |                                | 211 700                   | 2,750 % éch. 04/02/2033                                           |                                     | 60 600                           | 68 526                    | 1,76                                                | 3,000 % éch. 05/06/2031                                |                                  | 4 600                     | 5 289    | 0,14 |
|                                                       |                                     |                                | 5,45                      | 3,125 % éch. 12/10/2033                                           |                                     | 6 300                            | 7 253                     | 0,19                                                | New South Wales Treasury Corp.                         |                                  |                           |          |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                 |                                     |                                |                           | 3,625 % éch. 12/12/2040                                           |                                     | 2 300                            | 2 624                     | 0,07                                                | 1,750 % éch. 20/03/2034                                | AUD                              | 5 700                     | 3 114    | 0,08 |
| Adif Alta Velocidad                                   |                                     |                                |                           | Exportation et Développement Canada                               |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 22/11/2032                             |                                                        | 45 700                           | 27 523                    | 0,71     |      |
| 0,550 % éch. 31/10/2031                               | €                                   | 5 000                          | 5 008                     | 7,130 % éch. 11/03/2029                                           | INR                                 | 529 300                          | 5 569                     | 0,14                                                | 4,750 % éch. 20/02/2037                                |                                  | 8 700                     | 5 717    | 0,15 |
| 3,125 % éch. 31/10/2032                               |                                     | 2 300                          | 2 620                     | Obligation internationale du gouvernement français                |                                     |                                  |                           | 0,02                                                | 0,900 % éch. 20/05/2041                                | €                                | 1 400                     | 1 087    | 0,03 |
| 3,500 % éch. 30/04/2032                               |                                     | 3 700                          | 4 304                     | 0,000 % éch. 25/11/2029 (b)                                       | €                                   | 800                              | 833                       | 1,07                                                | 1,850 % éch. 03/05/2032                                |                                  | 4 000                     | 4 282    | 0,11 |
| Agence Française de Développement                     |                                     |                                |                           | 2,750 % éch. 25/02/2029                                           |                                     | 36 200                           | 41 392                    | 1,61                                                | Obligation internationale du gouvernement péruvien     |                                  |                           |          |      |
| 4,500 % éch. 05/03/2029                               | \$                                  | 17 200                         | 17 224                    | 2,750 % éch. 25/02/2030                                           |                                     | 54 900                           | 62 573                    | 0,22                                                | 2,780 % éch. 01/12/2060                                |                                  |                           |          |      |
| Agence France Locale                                  |                                     |                                |                           | Obligation internationale du gouvernement hongrois                |                                     |                                  |                           | (i)                                                 |                                                        | \$ 1 500                         | 823                       | 0,02     |      |
| 3,250 % éch. 20/12/2031                               | €                                   | 3 500                          | 4 008                     | 4,500 % éch. 16/06/2034                                           |                                     | 7 000                            | 8 380                     | 0,07                                                | 5,400 % éch. 12/08/2034                                | PEN                              | 700                       | 201      | 0,01 |
| Auckland Council                                      |                                     |                                |                           | 6,250 % éch. 22/09/2032                                           | \$                                  | 2 600                            | 2 752                     | 0,12                                                | 5,500 % éch. 30/03/2036                                |                                  | \$ 9 300                  | 9 404    | 0,24 |
| 0,250 % éch. 17/11/2031                               |                                     | 5 000                          | 4 953                     | Obligation internationale du gouvernement indonésien              |                                     |                                  |                           | 0,05                                                | 6,150 % éch. 12/08/2032                                | PEN                              | 56 200                    | 17 851   | 0,46 |
| Obligation internationale du gouvernement australien  |                                     |                                |                           | 4,125 % éch. 15/01/2037                                           | €                                   | 1 800                            | 1 978                     | 0,05                                                | 6,850 % éch. 12/08/2035                                |                                  |                           |          |      |
| 1,750 % éch. 21/06/2051                               | AUD                                 | 1 400                          | 498                       | 5,600 % éch. 15/01/2035                                           | \$                                  | 1 800                            | 1 834                     | 0,08                                                | (j)                                                    |                                  | 95 700                    | 29 538   | 0,76 |
| Communauté autonome de Catalogne                      |                                     |                                |                           | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                 |                                     |                                  |                           | 0,09                                                | 6,900 % éch. 12/08/2037                                |                                  | 20 600                    | 6 191    | 0,16 |
| 4,220 % éch. 26/04/2035                               | €                                   | 200                            | 238                       | 3,150 % éch. 15/03/2033                                           | €                                   | 2 800                            | 3 185                     | 0,12                                                | 6,950 % éch. 12/08/2031                                |                                  | 3 120                     | 1 041    | 0,03 |
| BNG Bank NV                                           |                                     |                                |                           | 3,250 % éch. 15/07/2032                                           |                                     | 3 000                            | 3 448                     | 0,25                                                | 7,300 % éch. 12/08/2033                                |                                  | 105 300                   | 34 597   | 0,89 |
| 0,250 % éch. 12/01/2032                               |                                     | 4 000                          | 3 962                     | 3,250 % éch. 15/11/2032                                           |                                     | 4 000                            | 4 588                     | 0,12                                                | Obligation internationale du gouvernement polonais     |                                  |                           |          |      |
| 1,875 % éch. 13/07/2032                               |                                     | 5 000                          | 5 383                     | 3,300 % éch. 15/06/2033                                           |                                     | 8 600                            | 9 852                     | 0,12                                                | 4,875 % éch. 12/02/2030                                | \$                               | 2 800                     | 2 833    | 0,07 |
| 3,000 % éch. 11/01/2033                               |                                     | 4 600                          | 5 267                     | Japan Bank for International Cooperation                          |                                     |                                  |                           | 0,12                                                | 5,125 % éch. 18/09/2034                                |                                  | 5 700                     | 5 735    | 0,15 |
| 3,300 % éch. 17/07/2028                               | AUD                                 | 3 000                          | 2 019                     | 3,125 % éch. 22/04/2031                                           |                                     | 4 200                            | 4 823                     | 0,43                                                | 5,375 % éch. 12/02/2035                                |                                  | 2 100                     | 2 147    | 0,06 |
| Bpifrance SACA                                        |                                     |                                |                           | Japan Finance Organization for Municipalities                     |                                     |                                  |                           | 0,50                                                | Province du Québec                                     |                                  |                           |          |      |
| 2,000 % éch. 02/09/2030                               | €                                   | 4 200                          | 4 607                     | 0,010 % éch. 02/02/2028                                           |                                     | 15 100                           | 16 507                    | 0,21                                                | 3,600 % éch. 01/09/2033                                | CAD                              | 69 700                    | 49 472   | 1,27 |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien   |                                     |                                |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais                |                                     |                                  |                           | 0,27                                                | 4,450 % éch. 01/09/2034                                |                                  | 3 000                     | 2 237    | 0,06 |
| 4,875 % éch. 23/04/2033                               |                                     | 8 400                          | 9 647                     | 0,100 % éch. 10/03/2028 (d)                                       | ¥                                   | 3 163 830                        | 19 545                    | 0,44                                                | Obligation internationale du gouvernement qatari       |                                  |                           |          |      |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare     |                                     |                                |                           | 0,100 % éch. 10/03/2029 (d)                                       |                                     | 1 347 865                        | 8 289                     | 0,04                                                | 4,625 % éch. 29/05/2029                                | \$                               | 4 900                     | 4 933    | 0,13 |
| 3,375 % éch. 18/07/2035                               |                                     | 3 000                          | 3 345                     | 0,400 % éch. 20/06/2029                                           |                                     | 1 730 000                        | 10 298                    | 0,13                                                | RAK Capital                                            |                                  |                           |          |      |
| 4,125 % éch. 18/07/2045                               |                                     | 5 900                          | 6 482                     | 0,400 % éch. 20/06/2040                                           |                                     | 4 030 000                        | 17 056                    | 0,13                                                | 5,000 % éch.                                           |                                  |                           |          |      |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale            |                                     |                                |                           | 0,500 % éch. 20/09/2046                                           |                                     | 477 000                          | 1 625                     | 0,13                                                | 12/03/2035 (j)                                         |                                  | 6 000                     | 6 055    | 0,16 |
| 2,875 % éch. 25/05/2030                               |                                     | 7 900                          | 9 023                     | 0,500 % éch. 20/03/2049                                           |                                     | 1 571 000                        | 4 874                     | 0,03                                                | Région d'Île de France                                 |                                  |                           |          |      |
| Obligation internationale du gouvernement canadien    |                                     |                                |                           | 0,700 % éch. 20/12/2048                                           |                                     | 108 000                          | 358                       | 0,03                                                | 2,230 % éch. 19/07/2032                                | €                                | 6 000                     | 6 494    | 0,17 |
| 2,750 % éch. 01/03/2030                               | CAD                                 | 200                            | 140                       | 0,700 % éch. 20/12/2050                                           |                                     | 410 000                          | 1 269                     | 0,03                                                | République d'Allemagne                                 |                                  |                           |          |      |
| 3,000 % éch. 01/03/2032                               |                                     | 39 400                         | 27 667                    | 0,700 % éch. 20/03/2051                                           |                                     | 410 000                          | 1 258                     | 0,12                                                | 0,000 % éch.                                           |                                  |                           |          |      |
| 3,000 % éch. 01/06/2034                               |                                     | 36 900                         | 25 585                    | 0,700 % éch. 20/06/2051                                           |                                     | 1 502 000                        | 4 567                     | 0,06                                                | 15/08/2031 (b)                                         |                                  | 50 500                    | 50 648   | 1,30 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien  |                                     |                                |                           | 1,300 % éch. 20/06/2052                                           |                                     | 620 000                          | 2 198                     | 0,02                                                | 2,900 % éch. 15/02/2036                                |                                  | 500                       | 573      | 0,01 |
| 1,500 % éch.                                          |                                     |                                |                           | 1,400 % éch. 20/09/2052                                           |                                     | 260 000                          | 943                       | 0,11                                                | Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                  |                           |          |      |
| 01/12/2044 (d)                                        |                                     | 581                            | 401                       | 1,800 % éch. 20/09/2044                                           |                                     | 930 000                          | 4 407                     | 0,01                                                | 1,375 % éch.                                           |                                  |                           |          |      |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA                         |                                     |                                |                           | 1,800 % éch. 20/03/2054                                           |                                     | 119 800                          | 473                       | 0,12                                                | 02/12/2029 (j)                                         |                                  | 1 170                     | 1 228    | 0,03 |
| 4,375 % éch. 01/10/2030                               | \$                                  | 12 100                         | 11 935                    | 2,200 % éch. 20/12/2044                                           |                                     | 2 905 000                        | 14 175                    | 0,12                                                | 2,000 % éch. 28/01/2032                                |                                  | 200                       | 198      | 0,01 |
| Obligation internationale du gouvernement chilien     |                                     |                                |                           | 2,200 % éch. 20/06/2054                                           |                                     | 85 100                           | 371                       | 0,12                                                | 2,000 % éch. 14/04/2033                                |                                  | 2 900                     | 2 728    | 0,07 |
| 4,850 % éch. 22/01/2029                               |                                     | 3 500                          | 3 532                     | 2,200 % éch. 20/03/2064                                           |                                     | 1 147 000                        | 4 764                     | 0,35                                                | 2,124 % éch. 16/07/2031                                |                                  | 100                       | 102      | 0,00 |
| Banque de développement chinoise                      |                                     |                                |                           | 2,300 % éch. 20/12/2054                                           |                                     | 550                              | 2                         | 0,01                                                | 2,125 % éch. 07/03/2028                                |                                  | 9 100                     | 10 205   | 0,26 |
| 2,630 % éch. 08/01/2034                               | CNY                                 | 627 570                        | 98 561                    | 2,400 % éch. 20/03/2045                                           |                                     | 2 593 000                        | 13 460                    | 0,11                                                | 5,625 % éch. 22/02/2036                                |                                  | 2 000                     | 2 305    | 0,06 |
| 2,820 % éch. 22/05/2033                               |                                     | 381 820                        | 60 534                    | 3,700 % éch. 20/03/2056                                           |                                     | 736 050                          | 4 377                     | 0,04                                                | 6,625 % éch. 27/09/2029                                |                                  | 7 700                     | 9 511    | 0,24 |
| Obligation internationale du gouvernement chinois     |                                     |                                |                           | Junta de Andalucía                                                |                                     |                                  |                           | 0,04                                                | Obligation internationale du gouvernement saoudien     |                                  |                           |          |      |
| 2,190 % éch. 25/09/2054                               |                                     | 214 400                        | 31 167                    | 0,500 % éch. 30/04/2031                                           | €                                   | 1 400                            | 1 428                     | 0,01                                                | 3,375 % éch. 05/03/2032                                |                                  | 21 800                    | 24 614   | 0,63 |
| 3,190 % éch. 15/04/2053                               |                                     | 28 440                         | 4 980                     | Kommunalbanken A/S                                                |                                     |                                  |                           | 0,01                                                | Obligation internationale du gouvernement serbe        |                                  |                           |          |      |
| TES colombien                                         |                                     |                                |                           | 1,900 % éch. 19/01/2027                                           | AUD                                 | 800                              | 546                       | 0,20                                                | 1,000 % éch. 23/09/2028                                |                                  | 3 100                     | 3 344    | 0,09 |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                              | COP                                 | 46 886 400                     | 13 199                    | Korea Housing Finance Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 0,25                                                | 1,650 % éch. 03/03/2033                                |                                  | 3 000                     | 2 904    | 0,07 |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                              |                                     | 44 608 600                     | 12 708                    | 2,696 % éch. 04/03/2031                                           | €                                   | 7 000                            | 7 887                     | 0,25                                                | 2,050 % éch. 23/09/2036                                |                                  | 2 550                     | 2 316    | 0,06 |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                              |                                     | 47 276 500                     | 14 306                    | 3,742 % éch. 05/03/2030                                           |                                     | 8 700                            | 9 858                     | 0,25                                                | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                  |                           |          |      |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                              |                                     | 40 928 700                     | 12 526                    | 3,124 % éch. 18/03/2029                                           |                                     | 8 500                            | 9 759                     | 0,15                                                | 6,250 % éch. 31/03/2036                                | ZAR                              | 44 900                    | 2 349    | 0,06 |
| Communauté Française de Belgique                      |                                     |                                |                           | 3,714 % éch. 11/04/2027                                           |                                     | 5 000                            | 5 760                     | 0,34                                                | 8,000 % éch. 31/01/2030                                |                                  | 205 400                   | 12 637   | 0,33 |
| 3,750 % éch. 22/06/2033                               | €                                   | 16 300                         | 19 022                    | Kuntarahoitus Oyj                                                 |                                     |                                  |                           | 0,25                                                | 8,500 % éch. 31/01/2037                                |                                  | 48 700                    | 2 960    | 0,08 |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain |                                     |                                |                           | 0,050 % éch. 06/09/2029                                           |                                     | 12 700                           | 13 358                    | 0,14                                                | 8,750 % éch. 31/01/2044                                |                                  | 91 800                    | 5 499    | 0,14 |
| 5,500 % éch. 21/11/2030                               |                                     | 6 500                          | 7 819                     | Obligation internationale du gouvernement du Koweït               |                                     |                                  |                           | 0,27                                                | 8,750 % éch. 28/02/2048                                |                                  | 53 800                    | 3 229    | 0,08 |
| 6,001 % éch. 16/01/2036                               |                                     | 1 500                          | 1 816                     | 4,016 % éch. 09/10/2028                                           | \$                                  | 10 000                           | 9 872                     | 0,14                                                | 8,875 % éch. 28/02/2035                                |                                  | 888 000                   | 56 148   | 1,45 |
| CPPIB Capital, Inc.                                   |                                     |                                |                           | 4,136 % éch. 09/10/2030                                           |                                     | 5 400                            | 5 301                     | 0,13                                                | 9,000 % éch. 31/01/2040                                |                                  | 38 700                    | 2 389    | 0,06 |
| 1,500 % éch. 23/06/2028                               | AUD                                 | 2 300                          | 1 502                     | 4,804 % éch. 20/04/2033 (i)                                       |                                     | 10 500                           | 10 482                    | 0,02                                                | 10,500 % éch. 21/12/2026                               |                                  | 52 100                    | 3 225    | 0,08 |
| Development Bank of Japan, Inc.                       |                                     |                                |                           | Obligation internationale du gouvernement malaisien               |                                     |                                  |                           | 0,13                                                | South Australian Government Financing Authority        |                                  |                           |          |      |
| 4,000 % éch. 28/08/2027                               | \$                                  | 9 700                          | 9 674                     | 2,632 % éch. 15/04/2031                                           | MYR                                 | 20 600                           | 4 883                     | 0,66                                                | 4,750 % éch                                            |                                  |                           |          |      |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                 |           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------|-----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Treasury Corp. of Victoria |     |                                     |                                  |                           | BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN     |           |                                     |                                  |                           |                                     |     |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 17/09/2035    | AUD | 57 400                              | \$ 30 218                        | 0,78                      | 24,060 % éch.               |           |                                     |                                  |                           | 7,305 % éch.                        |     |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 20/11/2037    |     | 29 500                              | 14 346                           | 0,37                      | 20/10/2026 (b)(c) EGP       | 75        | \$                                  | 2                                | 0,00                      | 18/11/2026 (b)(c)                   | ZAR | 58 310                              | 3 469                            | 0,09                      |
| 2,250 % éch. 15/09/2033    |     | 22 300                              | 12 842                           | 0,33                      | 24,651 % éch.               |           |                                     |                                  |                           | 7,393 % éch.                        |     |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 20/12/2032    |     | 8 800                               | 5 866                            | 0,15                      | 10/11/2026 (b)(c)           | 33 325    |                                     | 625                              | 0,01                      | 22/07/2026 (b)(c)                   |     | 129 990                             | 7 905                            | 0,20                      |
| Bon du Trésor britannique  |     |                                     |                                  |                           |                             |           |                                     | 627                              | 0,01                      |                                     |     |                                     | 29 181                           | 0,75                      |
| 1,500 % éch. 31/07/2053    | £   | 21 700                              | 12 640                           | 0,33                      | BONS DU TRÉSOR HONGROIS     |           |                                     |                                  |                           |                                     |     |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 07/03/2030    |     | 71 100                              | 94 800                           | 2,44                      | 6,082 % éch.                |           |                                     |                                  |                           | Total des Instruments à court terme |     |                                     | 52 992                           | 1,36                      |
| 4,375 % éch. 31/07/2054    |     | 100                                 | 112                              | 0,00                      | 02/07/2026 (b)(c) HUF       | 6 007 000 |                                     | 19 295                           | 0,50                      | Total des Valeurs mobilières        | \$  | 5 821 186                           |                                  | 149,90                    |
|                            |     |                                     | 1 754 781                        | 45,19                     | BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAÏN |           |                                     |                                  |                           |                                     |     |                                     |                                  |                           |
| INSTRUMENTS À COURT TERME  |     |                                     |                                  |                           | 7,046 % éch.                |           |                                     |                                  |                           | ACTIONS                             |     |                                     |                                  |                           |
| BILLETS À COURT TERME      |     |                                     |                                  |                           | 27/01/2027 (b)(c) ZAR       | 100 200   |                                     | 5 879                            | 0,15                      | FONDS D'INVESTISSEMENT              |     |                                     |                                  |                           |
| Kona Spc Ltd.              |     |                                     |                                  |                           | 7,304 % éch.                |           |                                     |                                  |                           | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE            |     |                                     |                                  |                           |
| 5,718 % éch. 15/09/2026    | €   | 3 400                               | 3 889                            | 0,10                      | 19/08/2026 (b)(c)           | 197 190   |                                     | 11 928                           | 0,31                      | PIMCO ETFs plc - Fonds              |     |                                     |                                  |                           |
|                            |     |                                     |                                  |                           |                             |           |                                     |                                  |                           | PIMCO Advantage Euro                |     |                                     |                                  |                           |
|                            |     |                                     |                                  |                           |                             |           |                                     |                                  |                           | Government Bond                     |     |                                     |                                  |                           |
|                            |     |                                     |                                  |                           |                             |           |                                     |                                  |                           | UCITS ETF                           |     |                                     |                                  |                           |
|                            |     |                                     |                                  |                           |                             |           |                                     |                                  |                           | 710 000                             |     | 20 604                              |                                  | 0,53                      |
|                            |     |                                     |                                  |                           |                             |           |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement    | \$  | 20 604                              |                                  | 0,53                      |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                             | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| FICC                                  | 3,620 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 2 300             | Billets du Trésor américain 3,750 % échéance 15/05/2028 | \$ (2 346)       | \$ 2 300                                 | \$ 2 300                                                           | 0,06                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                         | \$ (2 346)       | \$ 2 300                                 | \$ 2 300                                                           | 0,06                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                       | Long  | 12/2026           | 2 339              | \$ (657)                          | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Court | 09/2026           | 25                 | (10)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026           | 522                | (567)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre           | Court | 09/2026           | 54                 | (22)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026           | 649                | 698                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026           | 1 458              | (855)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 2 446              | 4 046                             | 0,10                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 1 321              | (2 032)                           | (0,05)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 43                 | (115)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 1 705              | (900)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026           | 2 192              | (225)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026           | 438                | (915)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 1 087              | 20                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 2 942              | 2 666                             | 0,07                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 3 610              | 4 841                             | 0,11                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Court | 09/2026           | 227                | (754)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026           | 1 374              | 3 905                             | 0,10                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                        |       |                   |                    | \$ 9 124                          | 0,23                |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

## SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG    | 1,000 %              | 20/12/2032      | € 3 500                          | \$ 45                             | 0,00                |

## SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 10 ans            | (1,000) %           | 20/12/2035      | \$ 11 975                        | \$ 2                              | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans            | (1,000)             | 20/06/2036      | 44 200                           | (345)                             | (0,01)              |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | (1,000)             | 20/06/2031      | € 17 800                         | (164)                             | 0,00                |
|                                            |                     |                 |                                  | \$ (507)                          | (0,01)              |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/12/2030         | \$ 118 155                          | \$ (46)                                 | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 120 060                             | 142                                     | 0,00                   |
|                                |                         |                    |                                     | \$ 96                                   | 0,00                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,000 %      | 17/06/2027         | £ 95 700             | \$ (975)                                | (0,03)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2028         | 59 400               | 90                                      | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                     | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 16/09/2028         | 469 750              | 209                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2031         | 6 610                | (187)                                   | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                     | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 16/09/2031         | 85 170               | (251)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 17/03/2028         | 1 600                | (6)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 18/03/2036         | 29 100               | 664                                     | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 16/09/2036         | 128 750              | (1 369)                                 | (0,04)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500        | 18/03/2056         | 3 780                | 196                                     | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500        | 16/09/2056         | 7 790                | 87                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 5,750        | 18/03/2031         | INR 475 060          | 73                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000        | 17/03/2031         | ¥ 1 500 000          | (495)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050        | 15/12/2031         | 1 981 000            | (779)                                   | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400        | 19/06/2039         | 430 000              | 562                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,600        | 18/12/2029         | 6 340 000            | (1 315)                                 | (0,03)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750        | 19/03/2027         | 9 590 000            | (163)                                   | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750        | 19/03/2030         | 7 820 000            | (1 271)                                 | (0,03)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/06/2030         | 110 000              | (18)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 19/03/2032         | 15 730 000           | (4 884)                                 | (0,13)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/09/2034         | 15 500 000           | (8 813)                                 | (0,23)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/12/2034         | 395 000              | (273)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 19/03/2035         | 8 770 000            | (4 863)                                 | (0,13)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 19/06/2044         | 1 010 300            | (1 463)                                 | (0,04)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250        | 17/12/2030         | 1 240 000            | (175)                                   | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250        | 18/03/2031         | 1 780 000            | (109)                                   | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250        | 17/09/2035         | 18 020 100           | (9 441)                                 | (0,24)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 16/09/2028         | 83 858 000           | (531)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 18/03/2036         | 720 000              | (138)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 18/09/2054         | 1 100                | 2                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 18/12/2054         | 280 000              | 446                                     | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | 22 830 000           | 955                                     | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | SGD 222 434          | 826                                     | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,000        | 16/09/2031         | 110 200              | (350)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750        | 16/09/2031         | THB 1 359 700        | (164)                                   | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000        | 16/09/2031         | 361 600              | (34)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,965        | 30/11/2026         | \$ 53 060            | 669                                     | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 19/03/2027         | 269 940              | (3 048)                                 | (0,08)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 17/06/2028         | 49 800               | 10                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 18/06/2027         | 104 900              | 80                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 17/06/2031         | 56 576               | (191)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 18/06/2035         | 54 100               | 729                                     | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 19/03/2055         | 3 500                | 153                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325        | 15/03/2028         | 150 170              | 2 065                                   | 0,05                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325        | 31/08/2030         | 100 080              | 1 781                                   | 0,05                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 18/03/2028         | 30 000               | (400)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 18/03/2031         | 203 570              | 3 343                                   | 0,09                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 17/06/2033         | 6 000                | 65                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 17/09/2055         | 11 000               | 266                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,525        | 04/09/2034         | 4 800                | 180                                     | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,548        | 31/08/2030         | 21 200               | (293)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,550        | 21/08/2034         | 9 700                | 345                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551        | 17/09/2035         | 4 800                | 190                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,557        | 31/08/2030         | 30 100               | (405)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,574        | 31/08/2030         | 27 000               | (346)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,582        | 31/08/2030         | 28 800               | (361)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,583        | 31/08/2030         | 32 300               | (403)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,587        | 31/08/2030         | 21 700               | (267)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,599        | 31/08/2030         | 25 400               | (302)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,599        | 28/08/2034         | 10 800               | 342                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,600        | 28/08/2034         | 11 350               | 364                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,611        | 28/08/2034         | 1 350                | 42                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,637        | 31/08/2030         | 17 200               | (179)                                   | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,643        | 31/08/2030         | 55 000               | (560)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,645        | 07/08/2034         | 2 000                | 56                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,649        | 31/08/2030         | 46 900               | (468)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,672        | 31/01/2033         | 14 200               | 210                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,678        | 31/01/2033         | 19 800               | 285                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691        | 31/01/2033         | 18 900               | 257                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,693        | 31/01/2033         | 21 200               | 287                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,698        | 31/01/2033         | 14 200               | 188                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700        | 31/01/2033         | 17 700               | 232                                     | 0,01                   |



## Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700 %   | 20/02/2049      | \$ 400            | \$ 29                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,714     | 31/01/2033      | 18 500            | 228                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 20 399            | 377                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,735     | 31/01/2033      | 37 500            | 417                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 31/01/2033      | 11 400            | 118                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 03/03/2036      | 14 800            | 338                               | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2026      | 16 900            | (197)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      | 437 900           | (4 443)                           | (0,11)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 15 800            | 315                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 46 068            | 446                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2034      | 50 000            | (628)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035      | 52 500            | 2 063                             | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 167 740           | 4 376                             | 0,11                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 193 771           | (719)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 20 100            | (44)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 40 900            | (854)                             | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,753     | 31/01/2033      | 30 900            | 311                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,772     | 15/02/2055      | 1 800             | 129                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,773     | 04/03/2055      | 8 300             | 594                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      | 14 800            | 305                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,804     | 15/02/2055      | 8 200             | 543                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,806     | 15/02/2055      | 4 000             | 263                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,836     | 15/05/2034      | 8 600             | 70                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,847     | 15/05/2034      | 5 100             | 38                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,851     | 28/02/2029      | 12 100            | 28                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,860     | 15/05/2034      | 9 100             | 59                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,861     | 15/02/2055      | 3 000             | 170                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,862     | 28/02/2029      | 22 600            | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,866     | 15/02/2055      | 2 400             | 133                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,899     | 11/03/2035      | 10 200            | 90                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 15/08/2026      | 41 700            | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 12/03/2035      | 5 100             | 40                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 24/03/2035      | 10 200            | 63                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 25/06/2055      | 7 343             | 306                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,955     | 15/11/2054      | 5 500             | 222                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,959     | 15/11/2054      | 9 300             | 369                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 27/06/2055      | 1 924             | 86                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,964     | 15/11/2054      | 4 400             | 171                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      | 5 100             | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,988     | 30/11/2027      | 62 800            | 254                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,988     | 15/11/2053      | 7 400             | 271                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,996     | 15/11/2054      | 3 000             | 100                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      | 700               | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 33 310            | (122)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 23 500            | 80                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 46 560            | 377                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2056      | 4 930             | (18)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 11 110            | 77                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 430               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,015     | 15/11/2053      | 330               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,052     | 15/02/2056      | 600               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,066     | 15/02/2046      | 500               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,076     | 15/02/2046      | 700               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,082     | 15/11/2053      | 500               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,083     | 15/11/2053      | 2 400             | 51                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,111     | 15/11/2054      | 8 040             | 109                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,130     | 15/11/2054      | 10 460            | 108                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,193     | 30/11/2027      | 42 200            | 217                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,222     | 15/11/2052      | 1 900             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,224     | 15/11/2052      | 1 900             | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,225     | 15/11/2052      | 4 200             | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,227     | 15/11/2052      | 6 200             | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,228     | 15/11/2052      | 1 900             | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,232     | 15/11/2052      | 2 100             | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,233     | 15/11/2052      | 3 600             | (12)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,238     | 15/11/2052      | 2 600             | (11)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,244     | 15/11/2052      | 2 600             | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,245     | 15/11/2052      | 5 600             | (30)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,248     | 15/11/2052      | 4 300             | (25)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | 72 000            | (202)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/09/2029      | 27 000            | 153                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/06/2033      | 3 700             | (16)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,880     | 01/09/2033      | 11 700            | 28                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      | 43 000            | (235)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2033      | 5 200             | (33)                              | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 18/03/2036      | 2 000             | 18                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,180     | 01/06/2033      | 40 600            | (408)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 20/12/2028      | 12 100            | 222                               | 0,01                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 21/06/2053      | 2 600             | 67                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,300     | 01/06/2033      | 17 300            | (392)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,400     | 01/06/2033      | 2 700             | (53)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 01/06/2032      | 17 300            | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 01/09/2033      | 14 000            | (552)                             | (0,01)              |

| Taux variable à payer/ à recevoir                         | Indice de taux variable          | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------|----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                                   | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,000 %   | 18/03/2028      | CHF 105 270       | \$ 267                            | 0,01                |
| À payer                                                   | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,250     | 18/03/2031      | 22 800            | 160                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,250     | 16/09/2031      | 37 800            | 603                               | 0,02                |
| À payer                                                   | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,283     | 14/02/2027      | 4 200             | 120                               | 0,00                |
| À payer                                                   | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,294     | 10/02/2027      | 15 500            | 436                               | 0,01                |
| À payer                                                   | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,343     | 16/05/2027      | 6 300             | 179                               | 0,00                |
| À payer                                                   | KORIBOR KRW à 3 mois             | 2,750     | 18/03/2036      | KRW 70 535 490    | (4 907)                           | (0,13)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR NZD à 3 mois                 | 3,750     | 16/12/2028      | NZD 177 700       | 379                               | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR NZD à 3 mois                 | 3,750     | 16/09/2029      | 9 400             | 40                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR NZD à 3 mois                 | 4,000     | 16/12/2031      | 44 300            | 281                               | 0,01                |
| À payer                                                   | STIBOR SEK à 3 mois              | 2,474     | 03/02/2030      | SEK 100 400       | 99                                | 0,00                |
| À payer                                                   | STIBOR SEK à 3 mois              | 2,500     | 18/03/2031      | 718 100           | 915                               | 0,02                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | STIBOR SEK à 3 mois              | 2,750     | 16/09/2031      | 181 000           | 164                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | JIBAR ZAR à 3 mois               | 8,300     | 08/06/2036      | ZAR 117 900       | 194                               | 0,01                |
| À payer                                                   | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 1,750     | 16/03/2027      | AUD 3 000         | 100                               | 0,00                |
| À payer                                                   | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 3,500     | 18/03/2031      | 480 400           | (11 723)                          | (0,30)              |
| À recevoir                                                | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 3,750     | 18/03/2031      | 81 700            | (92)                              | 0,00                |
| À payer                                                   | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 4,250     | 19/03/2035      | 44 900            | (1 331)                           | (0,03)              |
| À payer                                                   | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 4,250     | 17/09/2035      | 23 300            | (819)                             | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 4,500     | 16/09/2031      | 143 200           | (1 063)                           | (0,03)              |
| À payer                                                   | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 4,500     | 18/06/2035      | 11 400            | (380)                             | (0,01)              |
| À payer                                                   | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 4,500     | 17/09/2035      | 40 600            | (1 268)                           | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 5,000     | 16/09/2036      | 56 100            | (207)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | BBR-BBSW AUD à 6 mois            | 5,000     | 16/09/2056      | 800               | (12)                              | 0,00                |
| À payer                                                   | PRIBOR CZK à 6 mois              | 1,913     | 30/01/2029      | CZK 7 400         | 23                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | PRIBOR CZK à 6 mois              | 4,530     | 31/12/2035      | 200 000           | 77                                | 0,00                |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois             | 0,451     | 27/05/2050      | € 1 700           | (769)                             | (0,02)              |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois             | 1,795     | 11/10/2029      | 13 450            | (324)                             | (0,01)              |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois             | 1,923     | 11/10/2029      | 41 600            | (766)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,170     | 15/12/2028      | 174 400           | (565)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,250     | 16/09/2028      | 323 400           | (933)                             | (0,02)              |
| À payer                                                   | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,250     | 21/09/2042      | 6 060             | (1 144)                           | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,350     | 15/12/2028      | 177 400           | 590                               | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,500     | 16/09/2031      | 204 400           | (2 626)                           | (0,07)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,750     | 16/09/2036      | 92 520            | 1 324                             | 0,03                |
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,750     | 18/09/2039      | 11 700            | (71)                              | 0,00                |
| À recevoir                                                | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,750     | 18/03/2041      | 2 200             | 31                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois             | 2,825     | 19/09/2055      | 121 600           | (913)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois             | 3,000     | 16/09/2056      | 32 260            | 811                               | 0,02                |
| À payer                                                   | NIBOR NOK à 6 mois               | 3,750     | 18/03/2031      | NOK 230 200       | 12                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | NIBOR NOK à 6 mois               | 4,500     | 16/09/2031      | 20 600            | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | WIBOR PLN à 6 mois               | 4,730     | 31/12/2035      | PLN 37 000        | (66)                              | 0,00                |
|                                                           |                                  |           |                 |                   | \$ (46 293)                       | (1,19)              |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés compensés</b> |                                  |           |                 |                   | <b>\$ (46 659)</b>                | <b>(1,20)</b>       |

- <sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- <sup>(2)</sup> Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- <sup>(3)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- <sup>(4)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

| OPTIONS ACHETÉES  |                                            |                 |                   |                                  |        |              |                     |  |
|-------------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|--|
| OPTIONS DE CHANGE |                                            |                 |                   |                                  |        |              |                     |  |
| Contrepartie      | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |  |
| BOA               | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 8 335                            | \$ 85  | \$ 0         | 0,00                |  |
|                   | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 1 856                            | 13     | 0            | 0,00                |  |
|                   | Option d'achat - USD contre SGD hors cote  | SGD 1,315       | 05/11/2026        | 10 297                           | 73     | 26           | 0,00                |  |
| BPS               | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 13/08/2026        | 4 062                            | 15     | 1            | 0,00                |  |
| GLM               | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 19 895                           | 83     | 33           | 0,00                |  |
|                   | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 19 895                           | 43     | 69           | 0,00                |  |
| MBC               | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 15 923                           | 146    | 0            | 0,00                |  |
|                   | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 15 923                           | 127    | 0            | 0,00                |  |
|                   |                                            |                 |                   |                                  | \$ 585 | \$ 129       | 0,00                |  |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 11 990                           | \$ (158) | \$ (33)      | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 4 145                            | (53)     | (15)         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 8 335                            | (30)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 1 856                            | (4)      | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - USD contre SGD hors cote | SGD 1,237       | 05/11/2026        | 10 297                           | (74)     | (14)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 19 895                           | (103)    | (200)        | (0,01)              |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 15 923                           | (49)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 15 923                           | (41)     | 0            | 0,00                |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 450                              | (6)      | (1)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 15 610                           | (247)    | (134)        | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (765) | \$ (397)     | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %           | 20/12/2029      | \$ 8 500                         | \$ (284)               | \$ 48                             | \$ (236)     | (0,01)              |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000)             | 20/12/2030      | 12 900                           | (473)                  | 44                                | (429)        | (0,01)              |
|              |                                                      |                     |                 |                                  | \$ (757)               | \$ 92                             | \$ (665)     | (0,02)              |

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

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

#### SWAPS SUR DEVICES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                           | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,357 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027      | \$ 167 080                           | ¥ 25 062 000                          | \$ 1 299               | \$ 139                            | \$ 1 438     | 0,04                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 9 246                                | 1 460 900                             | 42                     | 63                                | 105          | 0,00                |
| FAR          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,442 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 39 158                               | 5 750 000                             | 63                     | 260                               | 323          | 0,01                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/02/2032      | 88 498                               | 13 982 700                            | 403                    | 601                               | 1 004        | 0,03                |
| GLM          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,301 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR GBP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 15/10/2045      | 41 034                               | £ 30 853                              | (14)                   | 85                                | 71           | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,315 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027      | 155 523                              | ¥ 24 106 000                          | (358)                  | 76                                | (282)        | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,425 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 3 946                                | 580 000                               | 5                      | 24                                | 29           | 0,00                |
|              |                                                                                                                      |                                                                                                         |                 |                                      |                                       | \$ 1 440               | \$ 1 248                          | \$ 2 688     | 0,07                |



## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500 %   | 17/03/2032      | CNY 108 200       | \$ (137)               | \$ 150                            | \$ 13        | 0,00                |
| BPS          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 721 300           | (858)                  | 945                               | 87           | 0,00                |
| JPM          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 64 200            | (40)                   | 48                                | 8            | 0,00                |
| SCX          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 54 800            | (35)                   | 41                                | 6            | 0,00                |
|              |                                  |                         |           |                 |                   | \$ (1 070)             | \$ 1 184                          | \$ 114       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | \$ 23 248         | \$ 741             | \$ 0                  | \$ 741                                  | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 945             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 24 438            | 531                | 0                     | 531                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 710             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12 142            | 85                 | 0                     | 85                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 2 428             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 21 494            | 0                  | (85)                  | (85)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 469               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 2 627             | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 6 551             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 530             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 357 806           | 48                 | 0                     | 48                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 523 501           | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 11 455            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 44                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 969             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 903             | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 52                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 242             | 0                  | (69)                  | (69)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 219             | 0                  | (136)                 | (136)                                   | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           |                 | 344               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | 18 961            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 6 689             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 190 850           | 0                  | (642)                 | (642)                                   | (0,02)              |
|              | 09/2026           | COP             | 14 170 367        | 0                  | (331)                 | (331)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | INR             | 160 088           | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 19 061            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 7 477             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 4 056             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 16                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | HUF             | 274 918           | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 30 598            | 0                  | (38)                  | (38)                                    | 0,00                |
|              | 01/2027           | ZAR             | 96 054            | 78                 | 0                     | 78                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 9 044             | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 10 002            | 6                  | (6)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 2 636             | 83                 | 0                     | 83                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 2 048             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 56 149            | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | €               | 1 182 905         | 25 110             | (219)                 | 24 891                                  | 0,64                |
|              | 07/2026           | £               | 3 888             | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 370 154 958       | 17                 | (12)                  | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 10 956            | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 680 968           | 0                  | (104)                 | (104)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 604 934         | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 96 115            | 39                 | (5)                   | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 21 647            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 664             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 929             | 6                  | (11)                  | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 011             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 469             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 982             | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 22 884            | 87                 | (37)                  | 50                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 023             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 887             | 0                  | (44)                  | (44)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 240             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 76 818            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK             | 23 121            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 282             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | TWD             | 1 446 647         | 258                | 0                     | 258                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 4 165             | 0                  | (99)                  | (99)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 26 710            | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 76                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 7 589 751         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 42 870 636        | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 89 054            | 47                 | 0                     | 47                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 8 682             | 0                  | (265)                 | (265)                                   | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 09/2026           | \$              | 61                | 5 803              | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 529               | 17 331             | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 1 525             | 27 761 089         | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           |                 | 50 914            | 1 600 949          | 0                     | (952)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | ILS             | 13 446            | 4 543              | 28                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 145 898           | 35 923             | 206                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | NZD             | 35 497            | 20 992             | 800                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | SGD             | 8 051             | 6 275              | 51                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 222 814           | 4 659              | 0                     | (62)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 438             | 43 649             | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12                | 1 957              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 30 523            | 1 465 581          | 464                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 450 512           | 27 377             | 246                   | (312)                                   | (66)                |
|              | 08/2026           | ¥               | 1 952             | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | ZAR             | 24 357            | 1 384              | 0                     | (82)                                    | (82)                |
| BSH          | 07/2026           | €               | 237 018           | 276 348            | 5 365                 | 0                                       | 5 365               |
|              | 07/2026           | ¥               | 3 689 771         | 23 207             | 504                   | 0                                       | 504                 |
|              | 07/2026           | PEN             | 41 762            | 12 327             | 117                   | (29)                                    | 88                  |
|              | 07/2026           | \$              | 21 035            | 37 230             | 143                   | 0                                       | 143                 |
|              | 08/2026           | NZD             | 37 230            | 21 059             | 0                     | (143)                                   | (143)               |
|              | 08/2026           | PEN             | 3 781             | 1 116              | 9                     | 0                                       | 9                   |
|              | 02/2027           |                 | 19 581            | 5 626              | 0                     | (66)                                    | (66)                |
|              | 07/2026           | COP             | 20 705 934        | 5 432              | 0                     | (552)                                   | (552)               |
|              | 07/2026           | DKK             | 5 183             | 809                | 16                    | 0                                       | 16                  |
|              | 07/2026           | €               | 10 982            | 12 807             | 251                   | 0                                       | 251                 |
| CBK          | 07/2026           | HUF             | 24 658            | 81                 | 2                     | 0                                       | 2                   |
|              | 07/2026           | ILS             | 12 215            | 4 205              | 103                   | 0                                       | 103                 |
|              | 07/2026           | INR             | 460 966           | 4 886              | 16                    | 0                                       | 16                  |
|              | 07/2026           | NOK             | 11 645            | 1 255              | 79                    | 0                                       | 79                  |
|              | 07/2026           | PEN             | 26 180            | 7 735              | 59                    | 0                                       | 59                  |
|              | 07/2026           | SEK             | 8 525             | 921                | 40                    | 0                                       | 40                  |
|              | 07/2026           | \$              | 3 084             | 20 861             | 0                     | (11)                                    | (11)                |
|              | 07/2026           |                 | 72                | 493                | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 07/2026           |                 | 4 387             | 15 360 751         | 52                    | 0                                       | 52                  |
|              | 07/2026           |                 | 1 547             | 1 153              | 0                     | (16)                                    | (16)                |
|              | 07/2026           |                 | 1 215             | 379 329            | 3                     | 0                                       | 3                   |
|              | 07/2026           |                 | 3 961             | 71 066 315         | 6                     | 0                                       | 6                   |
|              | 07/2026           |                 | 4 757             | 460 966            | 113                   | 0                                       | 113                 |
|              | 07/2026           |                 | 533               | 806 497            | 0                     | (13)                                    | (13)                |
|              | 07/2026           |                 | 16 230            | 54 854             | 0                     | (152)                                   | (152)               |
|              | 07/2026           |                 | 2 322             | 8 486              | 0                     | (65)                                    | (65)                |
|              | 07/2026           |                 | 23 746            | 219 407            | 0                     | (1 077)                                 | (1 077)             |
|              | 07/2026           |                 | 1 362             | 43 087             | 0                     | (10)                                    | (10)                |
|              | 08/2026           | ILS             | 15 580            | 5 373              | 139                   | 0                                       | 139                 |
|              | 08/2026           | INR             | 1 530 557         | 16 332             | 229                   | 0                                       | 229                 |
|              | 08/2026           | PEN             | 22 882            | 6 708              | 10                    | 0                                       | 10                  |
|              | 08/2026           | TWD             | 1 489 010         | 46 925             | 283                   | 0                                       | 283                 |
|              | 08/2026           | \$              | 1 049             | 3 114              | 0                     | (2)                                     | (2)                 |
|              | 08/2026           |                 | 219               | 115 531            | 20                    | 0                                       | 20                  |
|              | 09/2026           | COP             | 9 939 364         | 2 586              | 0                     | (247)                                   | (247)               |
|              | 09/2026           | IDR             | 157 177 717       | 8 707              | 0                     | (6)                                     | (6)                 |
|              | 09/2026           | INR             | 50 934            | 530                | 0                     | (4)                                     | (4)                 |
|              | 09/2026           | KZT             | 39 802            | 79                 | 0                     | (2)                                     | (2)                 |
|              | 09/2026           | PEN             | 19 884            | 5 796              | 19                    | (36)                                    | (17)                |
|              | 09/2026           | THB             | 783 872           | 24 254             | 520                   | (10)                                    | 510                 |
|              | 09/2026           | \$              | 2 797             | 49 879 594         | 0                     | (32)                                    | (32)                |
|              | 09/2026           |                 | 1 445             | 25 847             | 25                    | 0                                       | 25                  |
|              | 10/2026           | COP             | 2 525 085         | 709                | 0                     | (5)                                     | (5)                 |
|              | 10/2026           | PEN             | 41 946            | 12 363             | 115                   | 0                                       | 115                 |
|              | 11/2026           | COP             | 13 276 727        | 3 678              | 0                     | (50)                                    | (50)                |
|              | 12/2026           | PEN             | 133 734           | 38 573             | 0                     | (396)                                   | (396)               |
|              | 12/2026           | \$              | 4 746             | 86 275 521         | 5                     | 0                                       | 5                   |
|              | 05/2027           | PEN             | 11 055            | 3 113              | 0                     | (92)                                    | (92)                |
| DUB          | 07/2026           | CNH             | 80                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 36 239            | 5 317              | 0                     | (24)                                    | (24)                |
|              | 07/2026           | IDR             | 9 535 477         | 533                | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 07/2026           | INR             | 645 033           | 6 831              | 23                    | 0                                       | 23                  |
|              | 07/2026           | \$              | 8 955             | 60 535             | 0                     | (37)                                    | (37)                |
|              | 07/2026           |                 | 5 317             | 36 231             | 6                     | 0                                       | 6                   |
|              | 07/2026           |                 | 4 803             | 100 006            | 0                     | (91)                                    | (91)                |
|              | 07/2026           |                 | 4 122             | 397 572            | 72                    | 0                                       | 72                  |
|              | 07/2026           |                 | 726               | 389 481            | 82                    | 0                                       | 82                  |
|              | 07/2026           |                 | 695               | 6 459              | 0                     | (42)                                    | (42)                |
|              | 07/2026           |                 | 2 320             | 8 608              | 0                     | (30)                                    | (30)                |
|              | 07/2026           |                 | 22                | 98                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 228 628           | 13 848             | 152                   | (231)                                   | (79)                |
|              | 08/2026           | INR             | 982 745           | 10 448             | 109                   | 0                                       | 109                 |
|              | 08/2026           | \$              | 12                | 80                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 91 787 933        | 5 094              | 6                     | 0                                       | 6                   |
|              | 09/2026           | PEN             | 7 681             | 2 232              | 0                     | (14)                                    | (14)                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 371             | 61 209 090         | 22                    | 0                                       | 22                  |
|              | 09/2026           |                 | 6 831             | 649 405            | 0                     | (23)                                    | (23)                |
|              | 10/2026           |                 | 1 275             | 2 150 925          | 217                   | 0                                       | 217                 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 12/2026           | ZAR             | 33 603     | \$ 1 907          | \$ 0               | \$ (115)              | \$ (115)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 546 963    | 80 818            | 248                | (8)                   | 240                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | £               | 196 013    | 263 364           | 3 207              | (1)                   | 3 206                                   | 0,08                |
|              | 07/2026           | INR             | 12 258     | 130               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 148 764    | 936               | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 131 862    | 13 589            | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 78 582     | 61 596            | 842                | 0                     | 842                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 215 865    | CNH 1 468 306     | 444                | 0                     | 444                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 294 397    | € 258 130         | 723                | 0                     | 723                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 18 405     | HUF 5 685 546     | 0                  | (154)                 | (154)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 128        | INR 12 258        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 97 866     | ¥ 15 834 749      | 0                  | (437)                 | (437)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 10 745     | PLN 39 442        | 0                  | (252)                 | (252)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 251 321    | \$ 15 229         | 0                  | (81)                  | (81)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 1 465 079  | 215 865           | 0                  | (429)                 | (429)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | COP             | 4 288 796  | 1 136             | 0                  | (98)                  | (98)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 258 130    | 294 794           | 0                  | (722)                 | (722)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 5 413      | 1 891             | 72                 | 0                     | 72                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 15 793 313 | 97 866            | 439                | 0                     | 439                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 5 930      | CNH 40 217        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 333        | £ 251             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 13 589     | SEK 131 628       | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 7 357 240  | \$ 2 024          | 0                  | (73)                  | (73)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 63         | INR 6 015         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 173      | MXN 20 708        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| GLM          | 03/2027           | PEN             | 15 769     | \$ 4 545          | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 8 643 176  | 2 272             | 0                  | (223)                 | (223)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 515 089  | 981               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 74         | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON             | 586        | 129               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 141 433    | CAD 201 259       | 424                | 0                     | 424                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 20 976     | CNH 141 749       | 0                  | (93)                  | (93)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 116     | COP 35 101 897    | 48                 | (30)                  | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 794      | IDR 68 022 296    | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 981        | KRW 1 514 873     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 163        | ZAR 2 698         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 200 973    | \$ 141 433        | 0                  | (424)                 | (424)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 6 773      | BRL 34 612        | 0                  | (138)                 | (138)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 48         | INR 4 646         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 12 300 554 | \$ 3 524          | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 68 420 642 | 3 794             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 8 707      | 498               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 509 520    | 15 789            | 356                | 0                     | 356                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 9 019      | BRL 46 421        | 0                  | (183)                 | (183)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 10 547     | IDR 189 824 605   | 32                 | (57)                  | (25)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 217        | INR 20 835        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 573      | MXN 27 410        | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 23 482 161 | \$ 6 545          | 6                  | (50)                  | (44)                                    | 0,00                |
| IND JPM      | 07/2026           | DKK             | 9 266      | 1 447             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 143 909    | 102 592           | 2 892              | 0                     | 2 892                                   | 0,08                |
|              | 07/2026           | BRL             | 8 807      | 1 711             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 59 832     | 195               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 34 428     | 11 530            | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 131 698    | 1 396             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 468 172    | 302               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 14 489     | 1 464             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 574      | 1 489             | 30                 | (6)                   | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 14 140     | CNH 96 057        | 24                 | (13)                  | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 129      | € 976             | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 360      | £ 1 758           | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 579        | IDR 10 412 699    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 149      | ILS 6 241         | 0                  | (54)                  | (54)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 395      | INR 131 698       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 454        | KRW 697 215       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 912     | PLN 39 790        | 2                  | (328)                 | (326)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 2 097      | THB 70 101        | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 33 960     | \$ 2 090          | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK             | 60 219     | € 2 468           | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | 70 440     | \$ 9 004          | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 24 463     | 8 389             | 170                | 0                     | 170                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 36         | INR 3 359         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 464      | NOK 14 495        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 10 820 223 | \$ 599            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 1 084 964  | 11 377            | 3                  | (12)                  | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 18 497     | 1 049             | 1                  | (4)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 363 131    | 11 162            | 183                | (21)                  | 162                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 69 808     | BRL 359 266       | 0                  | (1 428)               | (1 428)                                 | (0,04)              |
|              | 09/2026           |                 | 94         | INR 8 963         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 4 349      | MXN 75 948        | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 7 308      | THB 238 343       | 0                  | (89)                  | (89)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 1 711      | BRL 9 001         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR             | 55 823     | \$ 3 185          | 0                  | (183)                 | (183)                                   | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 51 405     | MXN 902 726       | 0                  | (437)                 | (437)                                   | (0,01)              |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 4 405             | \$ 3 161           | \$ 109                | \$ 109                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 27 502            | 34 973             | 900                   | (21)                                    | 879                 |
|              | 07/2026           | COP             | 9 468 630         | 2 499              | 0                     | (234)                                   | (234)               |
|              | 07/2026           | €               | 24 110            | 27 939             | 374                   | 0                                       | 374                 |
|              | 07/2026           | IDR             | 935 754           | 52                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 3 919 260         | 24 662             | 547                   | 0                                       | 547                 |
|              | 07/2026           | KRW             | 9 010 712         | 5 944              | 124                   | 0                                       | 124                 |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 665             | 269                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 417             | AUD 7 691          | 9                     | (98)                                    | (89)                |
|              | 07/2026           |                 | 1 358 416         | € 1 195 912        | 8 944                 | (74)                                    | 8 870               |
|              | 07/2026           |                 | 1 199             | £ 895              | 0                     | (11)                                    | (11)                |
|              | 07/2026           |                 | 9 560             | INR 921 525        | 160                   | 0                                       | 160                 |
|              | 07/2026           |                 | 1 656             | NOK 15 351         | 0                     | (104)                                   | (104)               |
|              | 07/2026           |                 | 2 136             | NZD 3 785          | 17                    | 0                                       | 17                  |
|              | 07/2026           |                 | 1 147             | SEK 10 657         | 0                     | (46)                                    | (46)                |
|              | 07/2026           |                 | 1 776             | SGD 2 280          | 0                     | (13)                                    | (13)                |
|              | 08/2026           | €               | 1 195 193         | \$ 1 359 346       | 0                     | (8 951)                                 | (8 951)             |
|              | 08/2026           | ILS             | 536               |                    | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
|              | 08/2026           | TWD             | 216 132           | 6 836              | 63                    | 0                                       | 63                  |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 941             | 110                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 61 334            | 1 837              | 0                     | (21)                                    | (21)                |
|              | 09/2026           | \$              | 236               | INR 22 624         | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 07/2026           | £               | 21                | \$ 28              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 98                |                    | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 528               |                    | 4                     | 0                                       | 4                   |
|              | 07/2026           | \$              | 183               | € 161              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 617             | £ 1 960            | 2                     | (17)                                    | (15)                |
|              | 09/2026           | PEN             | 6 299             | \$ 1 839           | 0                     | (2)                                     | (2)                 |
| NSL          | 01/2027           | \$              | 48 195            | TWD 1 512 303      | 0                     | (996)                                   | (996)               |
|              | 07/2026           |                 | 3 531             | IDR 62 962 848     | 0                     | (10)                                    | (10)                |
|              | 07/2026           |                 | 9 668             | INR 930 086        | 149                   | 0                                       | 149                 |
|              | 07/2026           |                 | 4 548             | TRY 213 805        | 11                    | 0                                       | 11                  |
| SCX          | 09/2026           | IDR             | 63 315 957        | \$ 3 531           | 21                    | 0                                       | 21                  |
|              | 09/2026           | \$              | 1 711             | IDR 30 452 582     | 0                     | (23)                                    | (23)                |
|              | 07/2026           | CAD             | 916               | \$ 644             | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
|              | 07/2026           | COP             | 12 300 554        | 3 193              | 0                     | (357)                                   | (357)               |
|              | 07/2026           | \$              | 5 105             | CNH 34 571         | 0                     | (12)                                    | (12)                |
|              | 07/2026           |                 | 5 278             | CNY 36 170         | 53                    | 0                                       | 53                  |
|              | 07/2026           |                 | 1 346             | IDR 24 151 745     | 2                     | 0                                       | 2                   |
|              | 07/2026           |                 | 12 724            | INR 1 219 583      | 149                   | 0                                       | 149                 |
|              | 07/2026           |                 | 3 465             | ¥ 550 500          | 0                     | (78)                                    | (78)                |
|              | 08/2026           | HKD             | 66 474            | \$ 8 499           | 8                     | 0                                       | 8                   |
| SOG          | 08/2026           | \$              | 120               | INR 11 541         | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 09/2026           | IDR             | 72 149 827        | \$ 3 997           | 0                     | (3)                                     | (3)                 |
|              | 09/2026           | KZT             | 6 240             | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 199 725           | 6 169              | 124                   | (5)                                     | 119                 |
|              | 09/2026           | \$              | 4 918             | IDR 88 363 364     | 8                     | (28)                                    | (20)                |
|              | 09/2026           |                 | 718               | THB 23 493         | 0                     | (7)                                     | (7)                 |
|              | 02/2027           |                 | 821               | NGN 1 237 028      | 8                     | 0                                       | 8                   |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 326 019         | \$ 196 018         | 671                   | 0                                       | 671                 |
|              | 07/2026           | DKK             | 9 728             | 1 515              | 27                    | 0                                       | 27                  |
|              | 07/2026           | £               | 266               | 352                | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
|              | 07/2026           | ¥               | 8 952 806         | 56 354             | 1 268                 | 0                                       | 1 268               |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 724             | 1 330              | 0                     | (3)                                     | (3)                 |
|              | 07/2026           | \$              | 55 787            | AUD 80 850         | 226                   | 0                                       | 226                 |
|              | 07/2026           |                 | 64                | CAD 89             | 0                     | (2)                                     | (2)                 |
| SSB          | 07/2026           |                 | 39                | CHF 32             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12                | € 10               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 65 290            | SGD 84 517         | 76                    | (23)                                    | 53                  |
|              | 08/2026           | AUD             | 80 850            | \$ 55 751          | 0                     | (229)                                   | (229)               |
|              | 08/2026           | CHF             | 31                | 39                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD             | 81 201            | 62 845             | 0                     | (79)                                    | (79)                |
|              | 08/2026           | \$              | 352               | £ 266              | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 08/2026           |                 | 1 330             | SGD 1 720          | 3                     | 0                                       | 3                   |
|              | 07/2026           | CAD             | 204 343           | \$ 148 189         | 4 160                 | 0                                       | 4 160               |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 191             | 1 515              | 39                    | 0                                       | 39                  |
|              | 07/2026           | \$              | 1 511             | CAD 2 141          | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | 253 706           | £ 191 931          | 1 034                 | 0                                       | 1 034               |
|              | 08/2026           | CAD             | 2 138             | \$ 1 511           | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 08/2026           | COP             | 20 698 467        | 5 427              | 0                     | (513)                                   | (513)               |
| UAG          | 08/2026           | £               | 191 931           | 253 700            | 0                     | (1 034)                                 | (1 034)             |
|              | 08/2026           | \$              | 1 470             | € 1 288            | 4                     | 0                                       | 4                   |
|              | 07/2026           |                 | 2 362             | PLN 8 629          | 0                     | (66)                                    | (66)                |
|              | 09/2026           | COP             | 93 146 872        | \$ 24 139          | 0                     | (2 411)                                 | (2 411)             |
| WST          | 09/2026           | MXN             | 7 647             | 436                | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              | 09/2026           | THB             | 11 400            | 347                | 2                     | 0                                       | 2                   |
|              | 10/2026           | HUF             | 30 946            | € 83               | 0                     | (3)                                     | (3)                 |
|              | 11/2026           |                 | 1 294 160         | 3 590              | 0                     | (13)                                    | (13)                |
| WST          | 07/2026           | \$              | 38 763            | CHF 31 297         | 35                    | 0                                       | 35                  |
|              | 08/2026           | CHF             | 31 185            | \$ 38 763          | 0                     | (36)                                    | (36)                |
|              |                   |                 |                   | \$ 67 847          | \$ (29 008)           | \$ 38 839                               | 1,00                |

**CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS**

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation et Z en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 99 055      | \$ 68 298         | \$ 0               | \$ (327)              | \$ (327)                                | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 127 462      | AUD 178 981       | 0                  | (3 464)               | (3 464)                                 | (0,09)              |
|              | 08/2026           | 68 255          | 99 055            | 330                | 0                     | 330                                     | 0,01                |
| BOA          | 07/2026           | AUD 645         | \$ 462            | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 287             | 198               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 1 906           | 1 341             | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | 103 839         | 72 126            | 187                | 0                     | 187                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 101 520      | AUD 142 451       | 0                  | (2 830)               | (2 830)                                 | (0,07)              |
|              | 08/2026           | 72 080          | 103 839           | 0                  | (183)                 | (183)                                   | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD 561         | \$ 396            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 219          | AUD 312           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 13 856          | 19 399            | 0                  | (416)                 | (416)                                   | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | AUD 101 198     | \$ 70 273         | 163                | 0                     | 163                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 132 551      | AUD 185 812       | 0                  | (3 821)               | (3 821)                                 | (0,10)              |
|              | 08/2026           | 70 229          | 101 198           | 0                  | (160)                 | (160)                                   | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 170 990     | \$ 119 607        | 1 146              | 0                     | 1 146                                   | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$ 203          | AUD 284           | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 119 531         | 170 990           | 0                  | (1 139)               | (1 139)                                 | (0,03)              |
| MBC          | 07/2026           | AUD 101 529     | \$ 69 919         | 10                 | (430)                 | (420)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 3 864        | AUD 5 540         | 15                 | (40)                  | (25)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 69 106          | 100 431           | 432                | 0                     | 432                                     | 0,01                |
| MYI          | 07/2026           | AUD 720         | \$ 504            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | \$ 4 161        | AUD 5 848         | 0                  | (110)                 | (110)                                   | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD 1 620       | \$ 1 118          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 31 111       | AUD 43 722        | 0                  | (820)                 | (820)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 1 117           | 1 620             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 337           | \$ (13 755)           | \$ (11 418)                             | (0,29)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 1 169        | CHF 943           | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 731             | 575               | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 840             | 669               | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 1 339           | 1 064             | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 401 760         | 314 033           | 0                  | (12 456)              | (12 456)                                | (0,32)              |
| MBC          | 07/2026           | 445 973         | 349 416           | 11                 | (12 815)              | (12 804)                                | (0,33)              |
| MYI          | 08/2026           | 861             | 694               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 345 428     | \$ 426 972        | 0                  | (1 253)               | (1 253)                                 | (0,03)              |
|              | 08/2026           | \$ 426 972      | CHF 344 188       | 1 257              | 0                     | 1 257                                   | 0,03                |
| SSB          | 07/2026           | 429 148         | 337 394           | 8                  | (10 890)              | (10 882)                                | (0,28)              |
| UAG          | 07/2026           | 901             | 716               | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 343 795     | \$ 425 812        | 0                  | (389)                 | (389)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 425 812      | CHF 342 565       | 397                | 0                     | 397                                     | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 675           | \$ (37 864)           | \$ (36 189)                             | (0,93)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (exposition au risque de change) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 9           | \$ 6              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 1           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 24           | AUD 34            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3               | NZD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 6               | AUD 9             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | CAD 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | CLP 380         | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 7           | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 0             | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 26 007      | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1            | CAD 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | CLP 380           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9               | € 8               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5               | ¥ 774             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | MXN 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | NOK 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 1           | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 0            | CLP 380           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 08/2026           | 17              | KRW 26 004        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 0           | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 2             | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 416         | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 53           | CNH 361           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ 64           | £ 48              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16              | ¥ 2 618           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7               | THB 214           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1               | HUF 417           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 6               | MXN 97            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | NZD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 97          | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | PEN 4           | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | CLP 380           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | DKK 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7               | IDR 119 829       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | PEN 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6               | SEK 59            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1               | PEN 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CIB          | 07/2026           | 4               | CNH 28            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | CNY 157         | \$ 23             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | AUD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | NOK 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD 19          | \$ 13             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP 426         | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 1 268       | 186               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 20 239        | 125               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 104         | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 0           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 35          | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1            | AUD 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 53              | CNH 359           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2               | ¥ 322             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | MXN 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | PEN 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4               | SGD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 13              | AUD 19            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | CLP 426           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 186             | CNH 1 265         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 125             | ¥ 20 186          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 6               | MXN 104           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | NZD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 4               | SEK 35            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CAD 63          | \$ 44             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | CLP 380           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 44              | CAD 63            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | CLP 334         | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 59          | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 60          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1            | DKK 8             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | HKD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | HUF 416           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | CLP 334           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3               | CZK 60            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 9           | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 16          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 17            | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 119 829     | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 16          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 5           | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 21          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | AUD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8               | CHF 7             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9               | € 8               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3               | ILS 9             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 39              | ¥ 6 167           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | NOK 11            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6               | PLN 21            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 6               | AUD 9             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3               | DKK 16            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 7               | IDR 119 829       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | NOK 16            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3               | NZD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | SEK 21            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | 0               | CNH 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | CNH 15          | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 47            | 62                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | PEN 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 59              | £ 45              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 7           | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 318           | 362               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 2             | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 111         | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 5           | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | AUD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 87              | CNH 586           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3               | CZK 60            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | DKK 9              | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 374               | € 321              | \$ 0                  | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 65                | ¥ 10 360           | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 0                 | MXN 0              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2                 | RON 9              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 8                 | CHF 7              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 362               | € 318              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 3                 | £ 2                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 6                 | MXN 111            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 4                 | SGD 5              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 1                 | \$ 0               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 29                | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 46                | CAD 63             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7                 | MYR 29             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 0                 | CAD 1              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 7                 | MYR 29             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | PLN             | 21                | \$ 5               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 17                | KRW 26 001         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7                 | MXN 115            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 5                 | PLN 21             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3               | \$ (19)               | \$ (16)                                 | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | €               | 4 439             | \$ 5 167           | \$ 92                 | \$ 92                                   | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 2 458             | 2 798              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 366 535           | € 314 618          | 0                     | (6 832)                                 | (0,18)              |
| BSH          | 07/2026           | €               | 782               | \$ 910             | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 349 315           | € 299 601          | 0                     | (6 781)                                 | (0,17)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 2 729             | 2 340              | 0                     | (54)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | 289 184           | \$ 329 814         | 0                     | (810)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$              | 330 259           | € 289 184          | 809                   | 0                                       | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | €               | 323 181           | \$ 367 246         | 110                   | (2 357)                                 | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$              | 3 641             | € 3 146            | 0                     | (44)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 364 306           | 320 292            | 2 374                 | 0                                       | 0,06                |
| SOG          | 07/2026           | €               | 314 280           | \$ 357 493         | 0                     | (1 823)                                 | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$              | 367 015           | € 314 618          | 0                     | (7 312)                                 | (0,19)              |
|              | 08/2026           |                 | 357 978           | 314 280            | 1 819                 | 0                                       | 0,05                |
|              |                   |                 |                   | \$ 5 219           | \$ (26 024)           | \$ (20 805)                             | (0,54)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 42 446            | £ 31 616           | \$ 0                  | \$ (483)                                | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           |                 | 37                | 28                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £               | 28 013            | \$ 36 971          | 17                    | (226)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 46 871            | £ 34 985           | 4                     | (442)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 35 208            | 26 698             | 226                   | 0                                       | 0,01                |
| BRC          | 07/2026           | £               | 2 668             | \$ 3 527           | 0                     | (15)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 94                | 127                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 73                | £ 54               | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £               | 31                | \$ 41              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 335             | £ 1 736            | 0                     | (30)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 41                | 31                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 46 193            | 34 425             | 0                     | (503)                                   | (0,02)              |
| MBC          | 07/2026           | £               | 34                | \$ 46              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 321               | £ 241              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £               | 742               | \$ 997             | 12                    | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 5 484             | 7 217              | 0                     | (61)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 7 216             | £ 5 484            | 62                    | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £               | 34 182            | \$ 45 269          | 18                    | (118)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 249               | £ 185              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 42 663            | 32 234             | 118                   | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £               | 31 249            | \$ 41 280          | 0                     | (195)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 41 279            | £ 31 249           | 195                   | 0                                       | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £               | 721               | \$ 953             | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 953               | £ 721              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 657             | \$ (2 083)            | \$ (1 426)                              | (0,04)              |



## Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | NOK 96 790      | \$ 9 786          | \$ 5               | \$ 0                  | \$ 5                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 163 298      | NOK 1 511 823     | 0                  | (10 520)              | (10 520)                                | (0,27)              |
| CBK          | 07/2026           | 237 310         | 2 198 352         | 0                  | (15 155)              | (15 155)                                | (0,39)              |
| DUB          | 07/2026           | 185 234         | 1 721 094         | 0                  | (11 307)              | (11 307)                                | (0,29)              |
| FAR          | 07/2026           | NOK 2 398       | \$ 246            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 1 829 854       | 184 865           | 0                  | (53)                  | (53)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 184 865      | NOK 1 830 656     | 52                 | 0                     | 52                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NOK 2 351 567   | \$ 236 628        | 3                  | (1 016)               | (1 013)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 179 957      | NOK 1 668 375     | 0                  | (11 358)              | (11 358)                                | (0,29)              |
|              | 08/2026           | 236 599         | 2 352 326         | 1 013              | 0                     | 1 013                                   | 0,03                |
| MYI          | 07/2026           | NOK 1 304       | \$ 138            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 816        | NOK 63 932        | 0                  | (355)                 | (355)                                   | (0,01)              |
| RYL          | 07/2026           | 223             | 2 065             | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 6 275           | 58 071            | 0                  | (406)                 | (406)                                   | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 083           | \$ (50 184)           | \$ (49 101)                             | (1,26)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NZD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | NZD 495         | \$ 280            | \$ 0               | \$ (2)                | \$ (2)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 555        | NZD 14 645        | 0                  | (224)                 | (224)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 280             | 495               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | NZD 16 994      | \$ 9 570          | 0                  | (97)                  | (97)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 9 769        | NZD 16 654        | 0                  | (295)                 | (295)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 9 581           | 16 994            | 97                 | 0                     | 97                                      | 0,01                |
| BSH          | 07/2026           | NZD 858         | \$ 485            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 485          | NZD 858           | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | NZD 15 814      | \$ 8 997          | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9 007        | NZD 15 814        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NZD 15 280      | \$ 8 749          | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 8 758        | NZD 15 280        | 0                  | (57)                  | (57)                                    | 0,00                |
| RYL          | 08/2026           | 184             | 325               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | 8 848           | 15 123            | 0                  | (245)                 | (245)                                   | (0,01)              |
| UAG          | 07/2026           | 1 773           | 3 019             | 0                  | (55)                  | (55)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 162             | \$ (979)              | \$ (817)                                | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 16 864       | SEK 155 958       | \$ 0               | \$ (749)              | \$ (749)                                | (0,02)              |
| BPS          | 07/2026           | SEK 242         | \$ 25             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 059        | SEK 10 087        | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | SEK 651         | \$ 69             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 18 483       | SEK 170 806       | 0                  | (835)                 | (835)                                   | (0,02)              |
| FAR          | 07/2026           | SEK 102 872     | \$ 10 602         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 10 602       | SEK 102 690       | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 158 754     | \$ 16 317         | 8                  | (95)                  | (87)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 18 197       | SEK 169 054       | 1                  | (730)                 | (729)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 16 034          | 155 822           | 95                 | 0                     | 95                                      | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | SEK 646         | \$ 68             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 201          | SEK 1 888         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | SEK 75          | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | \$ 240          | SEK 2 334         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 137             | \$ (2 459)            | \$ (2 322)                              | (0,06)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (81 386) (2,10)

### TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 2,000 % éch. 01/07/2041                                        | \$ 44 600                     | \$ (40 634)                | (1,05)              |
| 2,000 % éch. 01/08/2056                                        | 280 950                       | (224 320)                  | (5,78)              |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 8 300                         | (7 234)                    | (0,19)              |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 18 200                        | (16 501)                   | (0,42)              |
| 5,500 % éch. 01/08/2056 (h)                                    | 35 350                        | (35 416)                   | (0,91)              |
| 5,500 % éch. 01/09/2056                                        | 35 350                        | (35 388)                   | (0,91)              |
| 6,000 % éch. 01/07/2056 (h)                                    | 13 600                        | (13 905)                   | (0,36)              |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 6 200                         | (6 313)                    | (0,16)              |

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,500 % éch. 01/08/2056                | \$ 64 000                           | \$ (66 132)                      | (1,70)                    |
| Total des Titres vendus à découvert    |                                     | \$ (445 843)                     | (11,48)                   |
| Total des Investissements              |                                     | \$ 5 279 326                     | 135,94                    |
| Autres actifs et passifs à court terme |                                     | \$ (1 395 763)                   | (35,94)                   |
| Actif net                              |                                     | \$ 3 883 563                     | 100,00                    |

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

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

- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.
- (i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,17 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût      | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|--------------------|-----------------|-----------|-----------------|------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804 % | 20/04/2033         | 13/04/2026      | \$ 10 500 | \$ 10 482       | 0,27                   |
| Project Dorchester                                  | 4,610   | 04/01/2027         | 10/12/2025      | 1 979     | 1 944           | 0,05                   |
| RBC International                                   | 4,660   | 16/12/2028         | 18/11/2025      | 5 000     | 4 918           | 0,13                   |
|                                                     |         |                    |                 | \$ 17 479 | \$ 17 344       | 0,45                   |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 369 081 \$ (31 décembre 2025 : 424 928 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 86 851 \$ (31 décembre 2025 : 1 137 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 30 juin 2026.

Un titre d'une juste valeur globale de 99 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 765 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 80 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de transactions à terme au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 95 239 \$ (31 décembre 2025 : 77 746 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 106 290 \$ (31 décembre 2025 : 18 940 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 5 746 389                                               | \$ 74 797                                                  | \$ 5 821 186        |
| Fonds d'investissement                        | 20 604                                                                                     | 0                                                          | 0                                                          | 20 604              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 2 300                                                      | 0                                                          | 2 300               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 2 351                                                                                      | (121 272)                                                  | 0                                                          | (118 921)           |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (445 843)                                                  | 0                                                          | (445 843)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 22 955</b>                                                                           | <b>\$ 5 181 574</b>                                        | <b>\$ 74 797</b>                                           | <b>\$ 5 279 326</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 6 020 381                                               | \$ 75 203                                                  | \$ 6 095 584        |
| Fonds d'investissement                        | 4 363                                                                                      | 0                                                          | 0                                                          | 4 363               |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 5 700                                                      | 0                                                          | 5 700               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 8 650                                                                                      | (7 580)                                                    | 0                                                          | 1 070               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (408 961)                                                  | 0                                                          | (408 961)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 13 013</b>                                                                           | <b>\$ 5 609 540</b>                                        | <b>\$ 75 203</b>                                           | <b>\$ 5 697 756</b> |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

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

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

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,760 %        | 29/06/2026        | 06/07/2026         | \$ (3 294)       | \$ (3 294)                               | (0,09)              |
|                                               | 3,780          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (6 855)          | (6 856)                                  | (0,18)              |
| BRC                                           | 2,050          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (648)          | (741)                                    | (0,02)              |
|                                               | 3,650          | 12/12/2025        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (4 827)       | (4 926)                                  | (0,13)              |
|                                               | 3,700          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (10 224)         | (10 226)                                 | (0,26)              |
|                                               | 3,740          | 23/06/2026        | 07/07/2026         | (3 171)          | (3 173)                                  | (0,08)              |
| BSN                                           | 3,720          | 09/06/2026        | 15/07/2026         | (3 085)          | (3 092)                                  | (0,08)              |
| FAR                                           | 3,710          | 17/06/2026        | 13/07/2026         | (89 271)         | (89 400)                                 | (2,30)              |
| MYI                                           | 3,470          | 30/06/2026        | 14/07/2026         | (1 286)          | (1 286)                                  | (0,03)              |
| SCX                                           | 3,700          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (773)            | (778)                                    | (0,02)              |
|                                               | 3,700          | 13/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (920)            | (925)                                    | (0,02)              |
|                                               | 3,750          | 30/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (779)            | (784)                                    | (0,02)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (240 032)        | (240 057)                                | (6,18)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (365 538)</b>                      | <b>(9,41)</b>       |

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

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                                             | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BCY                                                                      | 3,730 %        | 24/06/2026        | 01/07/2026      | \$ (5 913)       | \$ (5 918)                                                                         | (0,15)              |
| BPS                                                                      | 3,720          | 04/06/2026        | 02/07/2026      | (10 381)         | (10 410)                                                                           | (0,27)              |
|                                                                          | 3,730          | 16/06/2026        | 07/07/2026      | (2 378)          | (2 381)                                                                            | (0,06)              |
| MSC                                                                      | 3,720          | 22/06/2026        | 06/07/2026      | (5 154)          | (5 159)                                                                            | (0,13)              |
|                                                                          | 3,830          | 30/06/2026        | 01/07/2026      | (15 808)         | (15 810)                                                                           | (0,41)              |
| TDM                                                                      | 3,740          | 22/06/2026        | 06/07/2026      | (20 990)         | (21 009)                                                                           | (0,54)              |
|                                                                          | 3,790          | 30/06/2026        | 01/07/2026      | (27 271)         | (27 274)                                                                           | (0,70)              |
| <b>Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (87 961)</b>                                                                 | <b>(2,26)</b>       |

(1) Le montant à payer sur opération de financement par vente et rachat dos-à-dos comprend 16 \$ de baisse de prix différée.

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (2 894)                                                 | \$ 3 360                | \$ 466                            | \$ 4 372                                                   | \$ (5 310)              | \$ (938)                          |
| BOA          | (12 238)                                                   | 12 730                  | 492                               | (48)                                                       | (90)                    | (138)                             |
| BPS          | 16 558                                                     | (17 750)                | (1 192)                           | 3 359                                                      | (4 230)                 | (871)                             |
| BRC          | 1 337                                                      | (1 550)                 | (213)                             | 6 171                                                      | (6 880)                 | (709)                             |
| BSH          | (3 692)                                                    | 4 690                   | 998                               | 3 800                                                      | (4 130)                 | (330)                             |
| CBK          | (15 177)                                                   | 17 160                  | 1 983                             | 4 521                                                      | (4 020)                 | 501                               |
| DUB          | (11 640)                                                   | 12 240                  | 600                               | (374)                                                      | 520                     | 146                               |
| FAR          | 1 184                                                      | (430)                   | 754                               | 2 046                                                      | (2 150)                 | (104)                             |
| GLM          | (588)                                                      | 120                     | (468)                             | 5 283                                                      | (5 910)                 | (627)                             |
| IND          | 29                                                         | 0                       | 29                                | 1 562                                                      | (2 580)                 | (1 018)                           |
| JPM          | (12 287)                                                   | 11 990                  | (297)                             | 3 055                                                      | (4 110)                 | (1 055)                           |
| MBC          | (23 142)                                                   | 24 710                  | 1 568                             | (10 870)                                                   | 11 570                  | 700                               |
| MYC          | (665)                                                      | 750                     | 85                                | (732)                                                      | 750                     | 18                                |
| MYI          | (1 342)                                                    | 1 240                   | (102)                             | 153                                                        | 0                       | 153                               |
| NSL          | 149                                                        | 0                       | 149                               | 852                                                        | (890)                   | (38)                              |
| RYL          | (123)                                                      | 0                       | (123)                             | (10)                                                       | 0                       | (10)                              |
| SCX          | (523)                                                      | 240                     | (283)                             | 1 262                                                      | (1 630)                 | (368)                             |
| SOG          | (6 452)                                                    | 6 810                   | 358                               | (5 402)                                                    | 5 800                   | 398                               |
| SSB          | (7 192)                                                    | 7 440                   | 248                               | 573                                                        | (410)                   | 163                               |
| UAG          | (2 695)                                                    | 2 810                   | 115                               | (430)                                                      | 300                     | (130)                             |
| WST          | 7                                                          | 0                       | 7                                 | 3 560                                                      | (4 360)                 | (800)                             |

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

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|--------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 35,76            | 32,86                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 28,26            | 25,43                |
| Autres valeurs mobilières                                    | 0,72             | 0,60                 |

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Fonds d'investissement                                           | 0,23             | 0,04                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,03             | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,18             | 0,11                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,43             | 0,26                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,92             | 0,70                 |
| Autres actifs                                                    | 33,47            | 39,94                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,29             | 0,28                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 31,17            | 28,68                |
| Obligations et billets municipaux                                                                        | S/O              | 0,09                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 50,00            | 50,81                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 11,82            | 10,94                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 4,62             | 4,72                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 5,45             | 4,71                 |
| Émissions souveraines                                                                                    | 45,19            | 46,66                |
| Instruments à court terme                                                                                | 1,36             | 0,85                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 0,53             | 0,11                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 0,06             | 0,14                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,23             | 0,16                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,01)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (1,19)           | (0,70)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,02                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,02)           | (0,02)               |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | 0,07             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,00             | (0,01)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | 1,00             | (0,85)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (3,14)           | 1,40                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (11,48)          | (9,91)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (35,94)          | (38,10)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                                      |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                          | <b>COLOMBIE</b>                                              |                                     |                                  |                          |
| <b>AUSTRALIE</b>                                                                               |                                     |                                  |                          | <b>Obligations internationales du gouvernement canadien</b> |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                          |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                          | 1,750 % éch. 01/12/2053                                     | CAD 1 050                           | \$ 485                           | 0,05                     | <b>TES colombien</b>                                         |                                     |                                  |                          |
| Bank of Queensland Ltd.                                                                        |                                     |                                  |                          | 2,000 % éch. 01/12/2051                                     |                                     | 650                              | 0,03                     | 7,250 % éch. 18/10/2034                                      | COP 1 976 000                       | \$ 435                           | 0,04                     |
| 3,300 % éch. 30/07/2029                                                                        | € 2 200                             | \$ 2 535                         | 0,24                     | 2,750 % éch. 01/03/2030                                     |                                     | 200                              | 0,01                     | 11,000 % éch. 22/08/2029                                     | 10 866 700                          | 3 059                            | 0,29                     |
| Canadian Imperial Bank of Commerce                                                             |                                     |                                  |                          | 2,750 % éch. 01/12/2048                                     |                                     | 400                              | 0,02                     | 11,750 % éch. 24/01/2035                                     | 10 338 800                          | 2 945                            | 0,28                     |
| 4,495 % éch. 20/12/2027                                                                        | AUD 9 200                           | 6 337                            | 0,60                     | <b>Obligation à rendement réel du gouvernement canadien</b> |                                     |                                  |                          | 12,750 % éch. 28/11/2040                                     | 10 957 200                          | 3 316                            | 0,31                     |
| National Australia Bank Ltd.                                                                   |                                     |                                  |                          | 1,500 % éch. 01/12/2044 (e)                                 | 1 017                               | 701                              | 0,07                     | 13,250 % éch. 09/02/2033                                     | 10 322 000                          | 3 159                            | 0,30                     |
| 3,146 % éch. 05/02/2031                                                                        | € 4 900                             | 5 641                            | 0,53                     | <b>CPPIB Capital, Inc.</b>                                  |                                     |                                  |                          | Total Colombie                                               |                                     | 12 914                           | 1,22                     |
| Westpac Banking Corp.                                                                          |                                     |                                  |                          | 4,600 % éch. 16/01/2030                                     | AUD 1 300                           | 899                              | 0,09                     | <b>COSTA RICA</b>                                            |                                     |                                  |                          |
| 3,131 % éch. 15/04/2031                                                                        | 2 700                               | 3 107                            | 0,29                     | <b>Exportation et Développement Canada</b>                  |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                          |
|                                                                                                |                                     | 17 620                           | 1,66                     | 7,130 % éch. 11/03/2029                                     | INR 121 100                         | 1 274                            | 0,12                     | <b>Obligation internationale du gouvernement costaricain</b> |                                     |                                  |                          |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                          | <b>Ontario Teachers' Finance Trust</b>                      |                                     |                                  |                          | 5,500 % éch. 21/11/2030                                      | € 1 500                             | 1 804                            | 0,17                     |
| Project Cashmere                                                                               |                                     |                                  |                          | 0,900 % éch. 20/05/2041                                     | € 700                               | 544                              | 0,05                     | 6,001 % éch. 16/01/2036                                      | 250                                 | 303                              | 0,03                     |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                                                    | AUD 14 200                          | 9 805                            | 0,92                     | 1,850 % éch. 03/05/2032                                     | 3 300                               | 3 533                            | 0,33                     | Total Costa Rica                                             |                                     | 2 107                            | 0,20                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                          | <b>Province de l'Ontario</b>                                |                                     |                                  |                          | <b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE</b>                                    |                                     |                                  |                          |
| Obligation internationale du gouvernement australien                                           |                                     |                                  |                          | 0,010 % éch. 25/11/2030                                     |                                     | 2 300                            | 0,22                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                          |
| 1,750 % éch. 21/06/2051                                                                        | 1 300                               | 463                              | 0,04                     | 4,150 % éch. 02/06/2034                                     | CAD 3 200                           | 2 348                            | 0,22                     | <b>Ceska sporitelna A/S</b>                                  |                                     |                                  |                          |
| New South Wales Treasury Corp.                                                                 |                                     |                                  |                          | <b>Province du Québec</b>                                   |                                     |                                  |                          | 3,224 % éch. 19/05/2031                                      | 2 300                               | 2 657                            | 0,25                     |
| 1,750 % éch. 20/03/2034                                                                        | 3 000                               | 1 639                            | 0,15                     | 3,600 % éch. 01/09/2033                                     | 25 100                              | 17 816                           | 1,68                     | Komerční Banka A/S                                           |                                     |                                  |                          |
| 2,000 % éch. 08/03/2033                                                                        | 7 200                               | 4 156                            | 0,39                     | 4,450 % éch. 01/09/2034                                     | 1 200                               | 895                              | 0,08                     | 2,750 % éch. 15/10/2030                                      | 1 900                               | 2 150                            | 0,20                     |
| 3,500 % éch. 20/11/2037                                                                        | 2 000                               | 1 156                            | 0,11                     | <b>PSP Capital, Inc.</b>                                    |                                     |                                  |                          | Total République tchèque                                     |                                     | 4 807                            | 0,45                     |
| Queensland Treasury Corp.                                                                      |                                     |                                  |                          | 4,500 % éch. 05/09/2031                                     | AUD 4 900                           | 3 336                            | 0,31                     | <b>DANEMARK</b>                                              |                                     |                                  |                          |
| 1,500 % éch. 20/08/2032                                                                        | 1 800                               | 1 026                            | 0,10                     | Total Canada                                                |                                     | 56 773                           | 5,35                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                          |
| 1,750 % éch. 20/07/2034                                                                        | 3 000                               | 1 616                            | 0,15                     | <b>ÎLES CAÏMANS</b>                                         |                                     |                                  |                          | <b>Danske Bank A/S</b>                                       |                                     |                                  |                          |
| 2,000 % éch. 22/08/2033                                                                        | 7 200                               | 4 092                            | 0,39                     | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                          |                                     |                                  |                          | 2,456 % éch. 04/06/2027                                      | 2 200                               | 2 518                            | 0,24                     |
| 4,500 % éch. 22/08/2035                                                                        | 4 400                               | 2 884                            | 0,27                     | <b>BlueMountain CLO Ltd.</b>                                |                                     |                                  |                          | Jyske Realkredit A/S                                         |                                     |                                  |                          |
| 5,250 % éch. 21/07/2036                                                                        | 4 300                               | 2 959                            | 0,28                     | 5,015 % éch. 15/07/2031                                     | \$ 204                              | 204                              | 0,02                     | 1,000 % éch. 01/10/2050                                      | DKK 0                               | 0                                | 0,00                     |
| South Australian Government Financing Authority                                                |                                     |                                  |                          | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                          | 1,500 % éch. 01/10/2037                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 4,750 % éch. 24/05/2035                                                                        | 1 500                               | 1 006                            | 0,10                     | <b>Gaci First Investment Co.</b>                            |                                     |                                  |                          | 1,500 % éch. 01/07/2050                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| Treasury Corp. of Victoria                                                                     |                                     |                                  |                          | 4,750 % éch. 14/02/2030                                     | 1 400                               | 1 391                            | 0,13                     | 1,500 % éch. 01/10/2050                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 2,000 % éch. 17/09/2035                                                                        | 2 300                               | 1 211                            | 0,11                     | 4,875 % éch. 14/05/2029                                     | 1 700                               | 1 695                            | 0,16                     | 1,500 % éch. 01/10/2050                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                                                                        | 5 200                               | 2 529                            | 0,24                     | 5,000 % éch. 29/01/2029                                     | 1 700                               | 1 701                            | 0,16                     | 1,500 % éch. 01/10/2052                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 2,250 % éch. 15/09/2033                                                                        | 8 400                               | 4 837                            | 0,46                     | 5,250 % éch. 29/01/2030                                     | 3 400                               | 3 432                            | 0,32                     | 1,500 % éch. 01/10/2053                                      | 5 071                               | 630                              | 0,06                     |
| 2,250 % éch. 20/11/2034                                                                        | 2 600                               | 1 441                            | 0,14                     | 5,250 % éch. 29/01/2034                                     | 1 000                               | 1 000                            | 0,09                     | 2,000 % éch. 01/10/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 4,250 % éch. 20/12/2032                                                                        | 2 300                               | 1 533                            | 0,07                     | 5,625 % éch. 29/07/2034                                     | 1 200                               | 1 229                            | 0,12                     | 2,500 % éch. 01/10/2036                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
|                                                                                                |                                     | 32 548                           | 3,07                     | <b>QNB Finance Ltd.</b>                                     |                                     |                                  |                          | 2,500 % éch. 01/10/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| Total Australie                                                                                |                                     | 59 973                           | 5,65                     | 4,538 % éch. 19/09/2027                                     | 5 200                               | 5 199                            | 0,49                     | 2,500 % éch. 01/10/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| <b>BELGIQUE</b>                                                                                |                                     |                                  |                          | 4,875 % éch. 30/01/2029                                     | 1 800                               | 1 808                            | 0,17                     | <b>Nykredit Realkredit A/S</b>                               |                                     |                                  |                          |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                          | <b>Sands China Ltd.</b>                                     |                                     |                                  |                          | 1,000 % éch. 01/10/2050                                      | DKK 0                               | 0                                | 0,00                     |
| Belfius Bank S.A.                                                                              |                                     |                                  |                          | 5,400 % éch. 08/08/2028                                     | 900                                 | 907                              | 0,09                     | 1,500 % éch. 01/10/2037                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 2,875 % éch. 12/02/2031                                                                        | € 1 800                             | 2 053                            | 0,19                     | <b>Suci Second Investment Co.</b>                           |                                     |                                  |                          | 1,500 % éch. 01/10/2050                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| ING Belgium S.A.                                                                               |                                     |                                  |                          | 6,000 % éch. 25/10/2028                                     | 1 500                               | 1 538                            | 0,14                     | 1,500 % éch. 01/10/2052                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 3,000 % éch. 15/02/2031                                                                        | 1 500                               | 1 721                            | 0,16                     |                                                             |                                     | 19 900                           | 1,87                     | 1,500 % éch. 01/10/2053                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| KBC Group NV                                                                                   |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                          | 2,000 % éch. 01/10/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| 5,796 % éch. 19/01/2029                                                                        | \$ 800                              | 814                              | 0,08                     | <b>RAK Capital</b>                                          |                                     |                                  |                          | 2,000 % éch. 01/10/2050                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| Total Belgique                                                                                 |                                     | 4 588                            | 0,43                     | 5,000 % éch. 12/03/2035                                     | 1 600                               | 1 614                            | 0,15                     | 2,500 % éch. 01/10/2036                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| <b>BULGARIE</b>                                                                                |                                     |                                  |                          | Total Îles Caïmans                                          |                                     | 21 718                           | 2,04                     | 2,500 % éch. 01/10/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                          | <b>CHILI</b>                                                |                                     |                                  |                          | 3,750 % éch. 26/09/2033                                      | € 900                               | 1 027                            | 0,10                     |
| <b>Obligation internationale du gouvernement bulgare</b>                                       |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                          | <b>Realkredit Danmark A/S</b>                                |                                     |                                  |                          |
| 3,375 % éch. 18/07/2035                                                                        | € 800                               | 892                              | 0,08                     | <b>Obligation internationale du gouvernement chilien</b>    |                                     |                                  |                          | 1,000 % éch. 01/10/2050                                      | DKK 0                               | 0                                | 0,00                     |
| 4,125 % éch. 18/07/2045                                                                        | 1 400                               | 1 538                            | 0,15                     | 4,850 % éch. 22/01/2029                                     | 800                                 | 807                              | 0,07                     | 2,000 % éch. 01/10/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| Total Bulgarie                                                                                 |                                     | 2 430                            | 0,23                     | <b>CHINE</b>                                                |                                     |                                  |                          | 2,000 % éch. 01/10/2053                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| <b>CANADA</b>                                                                                  |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                          | 2,500 % éch. 01/04/2036                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                          | <b>Banque de développement chinoise</b>                     |                                     |                                  |                          | 2,500 % éch. 01/04/2047                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     |
| Bank of Nova Scotia                                                                            |                                     |                                  |                          | 2,630 % éch. 08/01/2034                                     | CNY 217 910                         | 34 223                           | 3,22                     | Total Danemark                                               |                                     | 4 859                            | 0,46                     |
| 3,084 % éch. 17/06/2030                                                                        | 2 300                               | 2 648                            | 0,25                     | 2,820 % éch. 22/05/2033                                     | 166 770                             | 26 440                           | 2,49                     | <b>ÉGYPTE</b>                                                |                                     |                                  |                          |
| 4,299 % éch. 20/03/2028                                                                        | \$ 5 000                            | 5 000                            | 0,47                     | <b>Obligation internationale du gouvernement chinois</b>    |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                 |                                     |                                  |                          |
| Canadian Imperial Bank of Commerce                                                             |                                     |                                  |                          | 1,650 % éch. 15/05/2035                                     | 40 600                              | 5 974                            | 0,56                     | <b>Obligation internationale du gouvernement égyptien</b>    |                                     |                                  |                          |
| 4,876 % éch. 14/01/2030                                                                        | 7 400                               | 7 525                            | 0,71                     | 1,900 % éch. 15/07/2055                                     | 3 700                               | 504                              | 0,05                     | 19,698 % éch. 14/10/2030                                     | EGP 4 400                           | 85                               | 0,01                     |
| Fairfax Financial Holdings Ltd.                                                                |                                     |                                  |                          | 1,920 % éch. 15/01/2055                                     | 11 500                              | 1 578                            | 0,15                     | 21,954 % éch. 04/03/2028                                     | 104 900                             | 2 070                            | 0,19                     |
| 2,750 % éch. 29/03/2028                                                                        | € 800                               | 909                              | 0,09                     | 2,190 % éch. 25/09/2054                                     | 52 900                              | 7 690                            | 0,73                     | Total Égypte                                                 |                                     | 2 155                            | 0,20                     |
| Royal Bank of Canada                                                                           |                                     |                                  |                          | 3,530 % éch. 18/10/2051                                     | 29 100                              | 5 354                            | 0,50                     | <b>FINLANDE</b>                                              |                                     |                                  |                          |
| 4,305 % éch. 03/11/2031                                                                        | \$ 2 300                            | 2 256                            | 0,21                     | Total Chine                                                 |                                     | 81 763                           | 7,70                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                         |                                     |                                  |                          |
| Toronto-Dominion Bank                                                                          |                                     |                                  |                          |                                                             |                                     |                                  |                          | <b>Danske Kiinnitysluottopankki Oyj</b>                      |                                     |                                  |                          |
| 3,191 % éch. 16/02/2029                                                                        | € 3 100                             | 3 575                            | 0,34                     |                                                             |                                     |                                  |                          | 2,750 % éch. 17/11/2032                                      | € 1 900                             | 2 141                            | 0,20                     |
|                                                                                                |                                     | 21 913                           | 2,07                     |                                                             |                                     |                                  |                          | Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj                             |                                     |                                  |                          |
|                                                                                                |                                     |                                  |                          |                                                             |                                     |                                  |                          | 2,875 % éch. 03/04/2029                                      | 2 300                               | 2 636                            | 0,25                     |

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                 | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |       |      |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-------|------|
| SP Kiinnitysluottopankki Oyj                       |                                     |                                  |                          | OCP Euro CLO DAC                                    |                                     |                                  |                          | 2,200 % éch. 20/03/2064                             | ¥                                                   | 557 000                          | 2 314                    | 0,22  |      |
| 3,250 % éch. 02/05/2031                            | €                                   | 800                              | \$                       | 3,513 % éch. 15/04/2037                             | €                                   | 1 900                            | \$                       | 2 172                                               |                                                     | 200 000                          | 1 081                    | 0,10  |      |
|                                                    |                                     |                                  |                          |                                                     |                                     |                                  |                          | 3,200 % éch. 20/09/2055                             |                                                     | 200 000                          | 1 080                    | 0,10  |      |
| Total Finlande                                     |                                     | 5 701                            |                          | Providus CLO DAC                                    |                                     |                                  |                          | 3,700 % éch. 20/03/2056                             |                                                     | 140 050                          | 833                      | 0,08  |      |
|                                                    |                                     |                                  | 0,54                     | 3,189 % éch. 20/05/2034                             |                                     | 900                              |                          |                                                     |                                                     |                                  | 38 236                   | 3,60  |      |
| FRANCE                                             |                                     |                                  |                          | 3,374 % éch. 15/07/2038                             |                                     | 2 200                            |                          | 2 516                                               |                                                     |                                  |                          |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                          | Sound Point Euro CLO Funding DAC                    |                                     |                                  |                          |                                                     |                                                     |                                  | 44 832                   | 4,22  |      |
| BNP Paribas S.A.                                   |                                     |                                  |                          | 2,985 % éch. 25/05/2034                             | 4 498                               | 5 140                            | 0,48                     | Total Japon                                         |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 5,497 % éch. 20/05/2030                            | \$                                  | 2 000                            | 2 036                    | Tikehau CLO DAC                                     |                                     |                                  |                          | KAZAKHSTAN                                          |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 5,786 % éch. 13/01/2033                            |                                     | 2 400                            | 2 480                    | 3,483 % éch. 20/04/2038                             | 900                                 | 1 030                            | 0,10                     | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.          |                                     |                                  |                          | Toro European CLO DAC                               |                                     |                                  |                          | Development Bank of Kazakhstan JSC                  |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 2,750 % éch. 06/09/2030                            | €                                   | 3 700                            | 4 202                    | 3,093 % éch. 15/02/2034                             | 1 600                               | 1 831                            | 0,17                     | 18,400 % éch. 16/10/2028                            | KZT                                                 | 231 000                          | 503                      | 0,05  |      |
| 2,875 % éch. 25/03/2031                            |                                     | 2 300                            | 2 618                    | 3,155 % éch. 25/07/2034                             | 1 077                               | 1 233                            | 0,12                     |                                                     |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Cie de Financement Foncier S.A.                    |                                     |                                  |                          | 3,474 % éch. 15/04/2037                             | 4 400                               | 5 036                            | 0,47                     | KOWEÏT                                              |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 3,000 % éch. 24/04/2032                            |                                     | 1 700                            | 1 933                    |                                                     |                                     |                                  |                          | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 3,125 % éch. 06/06/2030                            |                                     | 800                              | 921                      |                                                     |                                     | 40 658                           | 3,83                     | Obligation internationale du gouvernement du Koweït |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                 |                                     |                                  |                          | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS |                                     |                                  |                          | 4,016 % éch. 09/10/2028                             | \$                                                  | 2 200                            | 2 172                    | 0,21  |      |
| 3,000 % éch. 01/12/2030                            |                                     | 1 200                            | 1 376                    | PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX                  |                                     |                                  |                          | 4,136 % éch. 09/10/2030                             |                                                     | 1 200                            | 1 178                    | 0,11  |      |
| Crédit Agricole S.A.                               |                                     |                                  |                          | Kinbane DAC                                         |                                     |                                  |                          | 4,804 % éch.                                        |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 4,656 % éch. 12/01/2032                            | \$                                  | 1 000                            | 984                      | 3,378 % éch. 24/08/2075                             | 1 747                               | 2 001                            | 0,19                     | 20/04/2033 (j)                                      |                                                     | 2 800                            | 2 795                    | 0,26  |      |
|                                                    |                                     | 16 550                           | 1,56                     | Total Irlande                                       |                                     | 42 659                           | 4,02                     | Total Koweït                                        |                                                     |                                  | 6 145                    | 0,58  |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                          | ISRAËL                                              |                                     |                                  |                          | LUXEMBOURG                                          |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Agence Française de Développement                  |                                     |                                  |                          | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                          | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 1,125 % éch. 02/03/2037                            | €                                   | 2 900                            | 2 538                    | Obligation internationale du gouvernement israélien |                                     |                                  |                          | CIMA Luxembourg SARL                                |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement français |                                     |                                  |                          | 4,500 % éch. 17/01/2033                             | \$                                  | 500                              | 483                      | 0,05                                                | 4,979 % éch.                                        |                                  |                          |       |      |
| 2,700 % éch. 25/02/2031                            |                                     | 5 500                            | 6 220                    | 5,000 % éch. 30/10/2026                             | €                                   | 5 400                            | 6 216                    | 0,58                                                | 01/04/2027 (j)                                      | €                                | 1 900                    | 2 187 | 0,21 |
| 2,750 % éch. 25/02/2030                            |                                     | 20 900                           | 23 821                   | 5,375 % éch. 12/03/2029                             | \$                                  | 700                              | 707                      | 0,07                                                | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                  |                          |       |      |
|                                                    |                                     |                                  | 3,07                     | 5,375 % éch. 19/02/2030                             |                                     | 200                              | 203                      | 0,02                                                | Eagle Funding Luxco SARL                            |                                  |                          |       |      |
| Total France                                       |                                     | 49 129                           | 4,63                     | 5,500 % éch. 12/03/2034                             |                                     | 1 200                            | 1 218                    | 0,11                                                | 5,500 % éch. 17/08/2030                             | \$                               | 6 700                    | 6 735 | 0,63 |
| ALLEMAGNE                                          |                                     |                                  |                          | 5,625 % éch. 19/02/2035                             |                                     | 3 300                            | 3 378                    | 0,32                                                | Total Luxembourg                                    |                                  |                          | 8 922 | 0,84 |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                         |                                     |                                  |                          | 5,750 % éch. 12/03/2054                             |                                     | 600                              | 574                      | 0,05                                                | MALAISIE                                            |                                  |                          |       |      |
| SC Germany S.A.                                    |                                     |                                  |                          | Total Israël                                        |                                     | 12 779                           | 1,20                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 2,863 % éch. 14/05/2036                            |                                     | 1 400                            | 1 602                    | ITALIE                                              |                                     |                                  |                          | Petronas Capital Ltd.                               |                                                     |                                  |                          |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                          | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                          |                                     |                                  |                          | 2,480 % éch. 28/01/2032                             |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Commerzbank AG                                     |                                     |                                  |                          | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                   |                                     |                                  |                          | 400                                                 |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 2,500 % éch. 25/02/2028                            |                                     | 5 000                            | 5 696                    | 2,953 % éch. 26/12/2041                             | €                                   | 2 200                            | 2 520                    | 0,24                                                | 3,500 % éch. 21/04/2030                             |                                  |                          | 385   | 0,04 |
| Total Allemagne                                    |                                     | 7 298                            | 0,69                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                          | 4,550 % éch. 21/04/2050                             |                                                     | 300                              | 263                      | 0,02  |      |
| HONGRIE                                            |                                     |                                  |                          | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                 |                                     |                                  |                          | 4,800 % éch. 21/04/2060                             |                                                     | 300                              | 266                      | 0,03  |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                          | 6,750 % éch. 05/09/2027                             |                                     | 700                              | 806                      | 0,08                                                |                                                     |                                  | 1 271                    | 0,12  |      |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois |                                     |                                  |                          | Intesa Sanpaolo SpA                                 |                                     |                                  |                          | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 4,000 % éch. 25/07/2029                            |                                     | 1 000                            | 1 171                    | 6,625 % éch. 20/06/2033                             | \$                                  | 600                              | 651                      | 0,06                                                | Obligation internationale du gouvernement malaisien |                                  |                          |       |      |
| 4,500 % éch. 16/06/2034                            |                                     | 500                              | 599                      |                                                     |                                     | 1 457                            | 0,14                     | 2,632 % éch. 15/04/2031                             | MYR                                                 | 4 500                            | 1 067                    | 0,10  |      |
| Magyar Export-Import Bank                          |                                     |                                  |                          | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                          | 3,519 % éch. 20/04/2028                             |                                                     | 44 429                           | 10 958                   | 1,03  |      |
| 4,500 % éch. 27/11/2031                            |                                     | 1 200                            | 1 411                    | Obligation internationale du gouvernement italien   |                                     |                                  |                          | 3,582 % éch. 15/07/2032                             |                                                     | 2 040                            | 503                      | 0,05  |      |
| Total Hongrie                                      |                                     | 3 181                            | 0,30                     | 6,000 % éch. 04/08/2028                             | £                                   | 100                              | 136                      | 0,01                                                | Émission d'investissement du gouvernement malaisien |                                  |                          |       |      |
| IRLANDE                                            |                                     |                                  |                          | Total Italie                                        |                                     | 4 113                            | 0,39                     | 4,193 % éch. 07/10/2032                             |                                                     | 11 010                           | 2 807                    | 0,26  |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                         |                                     |                                  |                          | JAPON                                               |                                     |                                  |                          |                                                     |                                                     |                                  | 15 335                   | 1,44  |      |
| Aurium CLO DAC                                     |                                     |                                  |                          | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                          | Total Malaisie                                      |                                                     |                                  | 16 606                   | 1,56  |      |
| 2,973 % éch. 16/01/2031                            |                                     | 863                              | 988                      | Sumitomo Mitsui Banking Corp.                       |                                     |                                  |                          | MEXIQUE                                             |                                                     |                                  |                          |       |      |
| Black Diamond CLO DAC                              |                                     |                                  |                          | 0,409 % éch. 07/11/2029                             | €                                   | 1 800                            | 1 891                    | 0,18                                                | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                  |                          |       |      |
| 3,263 % éch. 15/05/2032                            |                                     | 185                              | 212                      | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.               |                                     |                                  |                          | Obligation internationale du gouvernement mexicain  |                                                     |                                  |                          |       |      |
| BNPP AM Euro CLO DAC                               |                                     |                                  |                          | 5,246 % éch. 08/07/2036                             | \$                                  | 2 500                            | 2 503                    | 0,23                                                | 4,000 % éch. 15/03/2115                             | €                                | 400                      | 314   | 0,03 |
| 3,014 % éch. 22/07/2032                            |                                     | 1 958                            | 2 238                    | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.                     |                                     |                                  |                          | MULTINATIONALES                                     |                                                     |                                  |                          |       |      |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                         |                                     |                                  |                          | 0,010 % éch. 15/10/2027                             | €                                   | 2 000                            | 2 202                    | 0,21                                                | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                  |                          |       |      |
| 3,066 % éch. 25/04/2036                            |                                     | 500                              | 572                      |                                                     |                                     | 6 596                            | 0,62                     | Preferred Term Securities Ltd.                      |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 3,285 % éch. 23/01/2039                            |                                     | 2 000                            | 2 290                    | ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                          | 4,329 % éch. 23/06/2035                             | \$                                                  | 284                              | 277                      | 0,03  |      |
| Dryden Euro CLO DAC                                |                                     |                                  |                          | Obligation internationale du gouvernement japonais  |                                     |                                  |                          | PAYS-BAS                                            |                                                     |                                  |                          |       |      |
| 2,864 % éch. 15/04/2033                            |                                     | 370                              | 424                      | 0,100 % éch. 10/03/2028                             | ¥                                   | 1 100 611                        | 6 799                    | 0,64                                                | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                  |                          |       |      |
| 3,143 % éch. 15/05/2034                            |                                     | 333                              | 381                      | (e)                                                 |                                     | 320 000                          | 1 905                    | 0,18                                                | ABN AMRO Bank NV                                    |                                  |                          |       |      |
| Euro-Galaxy CLO DAC                                |                                     |                                  |                          | 0,400 % éch. 20/06/2029                             |                                     | 690 000                          | 2 920                    | 0,27                                                | 2,500 % éch. 02/10/2029                             | €                                | 1 900                    | 2 155 | 0,20 |
| 2,995 % éch. 25/07/2035                            |                                     | 3 193                            | 3 645                    | 0,400 % éch. 20/06/2040                             |                                     | 334 000                          | 1 036                    | 0,10                                                | 5,515 % éch. 03/12/2035                             | \$                               | 1 600                    | 1 627 | 0,15 |
| Harvest CLO DAC                                    |                                     |                                  |                          | 0,500 % éch. 20/03/2049                             |                                     | 968 000                          | 3 209                    | 0,30                                                | ASN Bank NV                                         |                                  |                          |       |      |
| 3,054 % éch. 15/01/2032                            |                                     | 1 199                            | 1 372                    | 0,700 % éch. 20/12/2048                             |                                     | 270 000                          | 836                      | 0,08                                                | 3,000 % éch. 26/03/2031                             | €                                | 1 500                    | 1 716 | 0,16 |
| 3,154 % éch. 21/10/2034                            |                                     | 2 200                            | 2 517                    | 0,700 % éch. 20/12/2050                             |                                     | 270 000                          | 829                      | 0,08                                                | ENEL Finance International NV                       |                                  |                          |       |      |
| ICG Euro CLO DAC                                   |                                     |                                  |                          | 0,700 % éch. 20/03/2051                             |                                     | 660 000                          | 1 989                    | 0,19                                                | 3,375 % éch. 23/07/2028                             |                                  | 800                      | 922   | 0,09 |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                            |                                     | 2 200                            | 2 518                    | 0,700 % éch. 20/09/2051                             |                                     | 150 000                          | 564                      | 0,05                                                | ING Bank NV                                         |                                  |                          |       |      |
| Madison Park Euro Funding DAC                      |                                     |                                  |                          | 1,600 % éch. 20/12/2053                             |                                     | 650 000                          | 3 080                    | 0,29                                                | 3,125 % éch. 08/04/2031                             |                                  | 2 300                    | 2 654 | 0,25 |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                            |                                     | 2 170                            | 2 483                    | 1,800 % éch. 20/09/2044                             |                                     | 56 800                           | 225                      | 0,02                                                | ING Groep NV                                        |                                  |                          |       |      |
| Margay CLO DAC                                     |                                     |                                  |                          | 1,800 % éch. 20/03/2054                             |                                     | 1 515 000                        | 7 392                    | 0,70                                                | 4,000 % éch. 12/02/2035                             |                                  | 1 000                    | 1 171 | 0,11 |
| 3,439 % éch. 15/07/2037                            |                                     | 900                              | 1 030                    | 2,100 % éch. 20/09/2054                             |                                     | 270 000                          | 1 146                    | 0,11                                                |                                                     |                                  |                          |       |      |
|                                                    |                                     |                                  |                          | 2,200 % éch. 20/06/2054                             |                                     | 229 000                          | 998                      | 0,09                                                |                                                     |                                  |                          |       |      |



## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 5,550 % éch. 19/03/2035                                 | \$ 400                              | \$ 407                           | 0,04                     | 3,375 % éch. 05/03/2032                                | € 1 400                             | \$ 1 581                         | 0,15                     | Banque interaméricaine de développement                           |                                     |                                  |                          |
| Total Pays-Bas                                          |                                     | 10 652                           | 1,00                     | 4,750 % éch. 16/01/2030                                | \$ 1 400                            | 1 398                            | 0,13                     | 2,500 % éch. 14/04/2027                                           | AUD 1 300                           | \$ 886                           | 0,08                     |
| <b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>                                 |                                     |                                  |                          | 5,375 % éch. 13/01/2031                                | 2 000                               | 2 042                            | 0,19                     |                                                                   |                                     | 3 947                            | 0,37                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | Total Arabie saoudite                                  |                                     | 5 398                            | 0,51                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                          |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais |                                     |                                  |                          | <b>SERBIE</b>                                          |                                     |                                  |                          | Union européenne                                                  |                                     |                                  |                          |
| 1,500 % éch. 15/05/2031                                 | NZD 600                             | 306                              | 0,03                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                          | 3,250 % éch. 12/12/2036                                           | € 3 100                             | 3 527                            | 0,33                     |
| <b>NORVÈGE</b>                                          |                                     |                                  |                          | Obligation internationale du gouvernement serbe        |                                     |                                  |                          | 3,375 % éch. 12/12/2035                                           | 4 900                               | 5 683                            | 0,54                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                          | 1,000 % éch. 23/09/2028                                | € 600                               | 647                              | 0,06                     | 3,625 % éch. 12/12/2040                                           | 500                                 | 570                              | 0,05                     |
| SR-Boligkredit A/S                                      |                                     |                                  |                          | 2,050 % éch. 23/09/2036                                | 900                                 | 818                              | 0,08                     | 3,750 % éch. 12/10/2045                                           | 4 200                               | 4 741                            | 0,45                     |
| 3,125 % éch. 19/02/2032                                 | € 1 700                             | 1 962                            | 0,19                     | Total Serbie                                           |                                     | 1 465                            | 0,14                     |                                                                   |                                     | 14 521                           | 1,37                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | <b>SINGAPOUR</b>                                       |                                     |                                  |                          | Total Supranationales                                             |                                     | 18 468                           | 1,74                     |
| Kommunalbanken A/S                                      |                                     |                                  |                          | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                          | <b>SUÈDE</b>                                                      |                                     |                                  |                          |
| 1,900 % éch. 15/12/2027                                 | AUD 1 600                           | 1 092                            | 0,10                     | DBS Bank Ltd.                                          |                                     |                                  |                          | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                          |
| Total Norvège                                           |                                     | 3 054                            | 0,29                     | 4,297 % éch. 14/05/2027                                | £ 4 200                             | 5 584                            | 0,53                     | EQT AB                                                            |                                     |                                  |                          |
| <b>PÉROU</b>                                            |                                     |                                  |                          | Maybank Singapore Ltd.                                 |                                     |                                  |                          | 2,375 % éch. 06/04/2028                                           | 700                                 | 790                              | 0,07                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                          | 3,439 % éch. 07/06/2027                                | € 3 700                             | 4 258                            | 0,40                     | <b>SUISSE</b>                                                     |                                     |                                  |                          |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.            |                                     |                                  |                          | Total Singapour                                        |                                     | 9 842                            | 0,93                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                          |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                                | PEN 3 147                           | 1 015                            | 0,09                     | <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |                                     |                                  |                          | UBS Group AG                                                      |                                     |                                  |                          |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                          | 3,869 % éch. 12/01/2029                                           | \$ 1 150                            | 1 137                            | 0,11                     |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien      |                                     |                                  |                          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                          | 4,194 % éch. 01/04/2031                                           | 400                                 | 391                              | 0,04                     |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                                 | 100                                 | 28                               | 0,00                     | 6,250 % éch. 31/03/2036                                | ZAR 10 100                          | 528                              | 0,05                     | 4,282 % éch. 09/01/2028                                           | 450                                 | 448                              | 0,04                     |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                                 | 900                                 | 286                              | 0,03                     | 8,000 % éch. 31/01/2030                                | 43 100                              | 2 652                            | 0,25                     | 6,327 % éch. 22/12/2027                                           | 1 100                               | 1 109                            | 0,10                     |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                                 | 33 000                              | 10 185                           | 0,96                     | 8,500 % éch. 31/01/2037                                | 19 000                              | 1 155                            | 0,11                     | UBS Switzerland AG                                                |                                     |                                  |                          |
| 6,900 % éch. 12/08/2037                                 | 7 000                               | 2 104                            | 0,20                     | 8,750 % éch. 28/02/2048                                | 11 700                              | 702                              | 0,07                     | 2,583 % éch. 23/09/2027                                           | € 4 000                             | 4 560                            | 0,43                     |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                                 | 3 761                               | 1 255                            | 0,12                     | 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 227 400                             | 14 378                           | 1,35                     | 3,304 % éch. 05/03/2029                                           | 3 000                               | 3 466                            | 0,33                     |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                 | 21 500                              | 7 064                            | 0,66                     | 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 23 200                              | 1 432                            | 0,13                     | Total Suisse                                                      |                                     | 11 111                           | 1,05                     |
| 7,600 % éch. 12/08/2039                                 | 4 900                               | 1 544                            | 0,15                     | 10,500 % éch. 21/12/2026                               | 13 400                              | 830                              | 0,08                     | <b>THAÏLANDE</b>                                                  |                                     |                                  |                          |
|                                                         |                                     | 22 466                           | 2,12                     | Total Afrique du Sud                                   |                                     | 21 677                           | 2,04                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                          |
| Total Pérou                                             |                                     | 23 481                           | 2,21                     | <b>CORÉE DU SUD</b>                                    |                                     |                                  |                          | Obligation internationale du gouvernement thaïlandais             |                                     |                                  |                          |
| <b>POLOGNE</b>                                          |                                     |                                  |                          | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                          | 2,700 % éch. 17/06/2040                                           | THB 266 876                         | 8 241                            | 0,78                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | KEB Hana Bank                                          |                                     |                                  |                          | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                        |                                     |                                  |                          |
| Obligation internationale du gouvernement polonais      |                                     |                                  |                          | 2,875 % éch. 23/01/2028                                | € 5 700                             | 6 515                            | 0,62                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                          |
| 5,500 % éch. 04/04/2053                                 | \$ 400                              | 379                              | 0,03                     | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                          | Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC                          |                                     |                                  |                          |
| <b>PORTUGAL</b>                                         |                                     |                                  |                          | Korea Housing Finance Corp.                            |                                     |                                  |                          | 4,500 % éch. 06/05/2030                                           | \$ 200                              | 199                              | 0,02                     |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                          | 3,124 % éch. 18/03/2029                                | 1 800                               | 2 066                            | 0,19                     | 5,000 % éch. 06/05/2035                                           | 600                                 | 591                              | 0,06                     |
| Banco Espirito Santo S.A.                               |                                     |                                  |                          | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp.    |                                     |                                  |                          | Emirates NBD Bank PJSC                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,000 % éch. 21/01/2019 ^                               | € 400                               | 108                              | 0,01                     | 4,875 % éch. 13/04/2031                                | \$ 2 000                            | 2 015                            | 0,19                     | 5,125 % éch. 29/06/2031                                           | 1 000                               | 1 000                            | 0,09                     |
| 4,750 % éch. 15/01/2018 ^                               | 700                                 | 188                              | 0,02                     | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen   |                                     |                                  |                          | First Abu Dhabi Bank PJSC                                         |                                     |                                  |                          |
| Total Portugal                                          |                                     | 296                              | 0,03                     | 2,625 % éch. 10/06/2028                                | KRW 15 383 190                      | 9 753                            | 0,92                     | 4,789 % éch. 03/06/2031                                           | 2 700                               | 2 704                            | 0,25                     |
| <b>QATAR</b>                                            |                                     |                                  |                          |                                                        |                                     | 13 834                           | 1,30                     | MDGH GMTN RSC Ltd.                                                |                                     |                                  |                          |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                    |                                     |                                  |                          | Total Corée du Sud                                     |                                     | 20 349                           | 1,92                     | 5,500 % éch. 28/04/2033                                           | 500                                 | 513                              | 0,05                     |
| QatarEnergy                                             |                                     |                                  |                          | <b>ESPAGNE</b>                                         |                                     |                                  |                          |                                                                   |                                     | 5 007                            | 0,47                     |
| 2,250 % éch. 12/07/2031                                 | \$ 400                              | 356                              | 0,03                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                          |
| 4,625 % éch. 23/06/2029                                 | 600                                 | 596                              | 0,06                     | Banco Santander S.A.                                   |                                     |                                  |                          | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                          |
|                                                         |                                     | 952                              | 0,09                     | 6,607 % éch. 07/11/2028                                | \$ 1 000                            | 1 045                            | 0,10                     | 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 2 800                               | 2 791                            | 0,26                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                          | Total Émirats arabes unis                                         |                                     | 7 798                            | 0,73                     |
| Obligation internationale du gouvernement qatari        |                                     |                                  |                          | Communauté autonome de Catalogne                       |                                     |                                  |                          | <b>ROYAUME-UNI</b>                                                |                                     |                                  |                          |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                 | 1 700                               | 1 709                            | 0,16                     | 4,220 % éch. 26/04/2035                                | € 400                               | 476                              | 0,05                     | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                |                                     |                                  |                          |
| Total Qatar                                             |                                     | 2 661                            | 0,25                     | Obligation internationale du gouvernement espagnol     |                                     |                                  |                          | Curzon Mortgages PLC                                              |                                     |                                  |                          |
| <b>ROUMANIE</b>                                         |                                     |                                  |                          | 1,450 % éch. 30/04/2029                                | 1 079                               | 1 195                            | 0,11                     | 4,592 % éch. 28/07/2049                                           | £ 1 400                             | 1 859                            | 0,17                     |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | 2,400 % éch. 31/05/2028                                | 5 450                               | 6 208                            | 0,58                     | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                              |                                     |                                  |                          |
| Obligation internationale du gouvernement roumain       |                                     |                                  |                          | 3,150 % éch. 30/04/2035                                | 5 260                               | 5 987                            | 0,56                     | Anglian Water Services Financing PLC                              |                                     |                                  |                          |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                                 | € 1 000                             | 1 039                            | 0,10                     | 3,200 % éch. 31/10/2035                                | 2 400                               | 2 733                            | 0,26                     | 4,250 % éch. 23/06/2036                                           | € 1 400                             | 1 603                            | 0,15                     |
| 2,124 % éch. 16/07/2031                                 | 400                                 | 408                              | 0,04                     | 3,400 % éch. 31/10/2036                                | 1 000                               | 1 149                            | 0,11                     | Barclays PLC                                                      |                                     |                                  |                          |
| 5,000 % éch. 27/09/2026                                 | 1 247                               | 1 432                            | 0,13                     | 3,450 % éch. 31/10/2034                                | 12 320                              | 14 379                           | 1,35                     | 8,875 % éch.                                                      |                                     |                                  |                          |
| 5,125 % éch. 24/09/2031                                 | 1 500                               | 1 754                            | 0,16                     | 3,500 % éch. 31/05/2029                                | 4 600                               | 5 383                            | 0,51                     | 15/09/2027 (f)(h)                                                 | £ 600                               | 826                              | 0,08                     |
| 5,250 % éch. 10/03/2030                                 | 1 500                               | 1 782                            | 0,17                     | 5,250 % éch. 06/04/2029                                | £ 500                               | 674                              | 0,06                     | 9,250 % éch.                                                      |                                     |                                  |                          |
| Total Roumanie                                          |                                     | 6 415                            | 0,60                     |                                                        |                                     | 38 184                           | 3,59                     | 15/09/2028 (f)(h)                                                 | 200                                 | 282                              | 0,03                     |
| <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                  |                                     |                                  |                          | Total Espagne                                          |                                     | 39 229                           | 3,69                     | HSBC Holdings PLC                                                 |                                     |                                  |                          |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                            |                                     |                                  |                          | <b>SUPRANATIONALES</b>                                 |                                     |                                  |                          | 4,041 % éch. 13/03/2028                                           | \$ 300                              | 299                              | 0,03                     |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien      |                                     |                                  |                          | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                          | 4,583 % éch. 19/06/2029                                           | 1 300                               | 1 296                            | 0,12                     |
| 3,250 % éch. 22/10/2030                                 | \$ 400                              | 377                              | 0,04                     | Banque de développement du Conseil de l'Europe         |                                     |                                  |                          | 4,856 % éch. 23/05/2033                                           | € 1 800                             | 2 193                            | 0,21                     |
|                                                         |                                     |                                  |                          | 4,375 % éch. 09/01/2028                                | 2 300                               | 3 061                            | 0,29                     | Lloyds Banking Group PLC                                          |                                     |                                  |                          |
|                                                         |                                     |                                  |                          |                                                        |                                     |                                  |                          | 5,250 % éch. 04/10/2030                                           | £ 2 400                             | 3 220                            | 0,30                     |
|                                                         |                                     |                                  |                          |                                                        |                                     |                                  |                          | 5,462 % éch. 05/01/2028                                           | \$ 1 200                            | 1 206                            | 0,11                     |
|                                                         |                                     |                                  |                          |                                                        |                                     |                                  |                          | 5,590 % éch. 26/11/2035                                           | 500                                 | 510                              | 0,05                     |



| DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 7,875 % éch. 27/06/2029<br>(f)(h)                                                       | £ 200                               | \$ 277                           | 0,03                     | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust            | \$ 1 143                            | \$ 1 137                         | 0,11                     | 1,000 % éch. 31/12/2020 ^                                                               | \$ 700                              | \$ 0                             | 0,00                     |
| NatWest Group PLC                                                                       |                                     |                                  |                          | 4,378 % éch. 25/02/2036                               |                                     |                                  |                          | 1,000 % éch. 24/01/2049 ^                                                               | 600                                 | 0                                | 0,00                     |
| 5,778 % éch. 01/03/2035                                                                 | \$ 2 000                            | 2 075                            | 0,19                     | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                   | 1 513                               | 846                              | 0,08                     | 7,875 % éch. 08/05/2018 ^                                                               | £ 1 800                             | 8                                | 0,00                     |
| NatWest Markets PLC                                                                     |                                     |                                  |                          | 4,083 % éch. 25/12/2036                               | 915                                 | 856                              | 0,08                     | Morgan Stanley                                                                          |                                     |                                  |                          |
| 4,174 % éch. 06/11/2028                                                                 | 2 300                               | 2 277                            | 0,21                     | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.     | 251                                 | 231                              | 0,02                     | 3,149 % éch. 07/11/2031                                                                 | € 1 700                             | 1 919                            | 0,18                     |
| Santander UK Group Holdings PLC                                                         |                                     |                                  |                          | 4,043 % éch. 25/06/2037                               | 8                                   | 7                                | 0,00                     | 3,749 % éch. 07/11/2036                                                                 | 1 700                               | 1 918                            | 0,18                     |
| 7,482 % éch. 29/08/2029                                                                 | £ 1 700                             | 2 371                            | 0,22                     | 4,443 % éch. 25/12/2036                               | 1                                   | 1                                | 0,00                     | 3,790 % éch. 21/03/2030                                                                 | 1 300                               | 1 508                            | 0,14                     |
| Santander UK PLC                                                                        |                                     |                                  |                          | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.  |                                     |                                  |                          | 3,955 % éch. 21/03/2035                                                                 | 200                                 | 232                              | 0,02                     |
| 3,000 % éch. 12/03/2029                                                                 | € 3 300                             | 3 784                            | 0,36                     | 4,049 % éch. 25/01/2032                               | 4 270                               | 4 270                            | 0,10                     | 4,654 % éch. 13/04/2028                                                                 | \$ 3 100                            | 3 110                            | 0,29                     |
| 4,496 % éch. 12/12/2027                                                                 | \$ 3 900                            | 3 912                            | 0,37                     | IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust  | 1 109                               | 1 081                            | 0,10                     | 4,654 % éch. 18/10/2030                                                                 | 1 100                               | 1 094                            | 0,10                     |
| TP ICAP Finance PLC                                                                     |                                     |                                  |                          | 4,270 % éch. 25/03/2035                               | 989                                 | 515                              | 0,05                     | 5,042 % éch. 19/07/2030                                                                 | 900                                 | 906                              | 0,08                     |
| 2,625 % éch. 18/11/2028                                                                 | £ 700                               | 876                              | 0,08                     | Long Beach Mortgage Loan Trust                        | 32                                  | 32                               | 0,00                     | 5,831 % éch. 19/04/2035                                                                 | 2 200                               | 2 283                            | 0,21                     |
| TSB Bank PLC                                                                            |                                     |                                  |                          | 4,063 % éch. 25/05/2036                               | 4 755                               | 1 621                            | 0,15                     | Morgan Stanley Bank N.A.                                                                |                                     |                                  |                          |
| 3,319 % éch. 05/03/2029                                                                 | € 1 300                             | 1 499                            | 0,14                     | Massachusetts Educational Financing Authority         | 1 506                               | 1 357                            | 0,13                     | 5,504 % éch. 26/05/2028                                                                 | 1 800                               | 1 815                            | 0,17                     |
| Vmed O2 UK Financing PLC                                                                |                                     |                                  |                          | 4,880 % éch. 25/04/2038                               | 4 243                               | 1 506                            | 0,13                     | Pacific Gas & Electric Co.                                                              |                                     |                                  |                          |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                                                                 | 2 800                               | 2 822                            | 0,27                     | MASTR Asset-Backed Securities Trust                   | 4 755                               | 1 621                            | 0,15                     | 2,100 % éch. 13/02/2027                                                                 | 100                                 | 97                               | 0,01                     |
| 6,750 % éch. 15/01/2033                                                                 | \$ 400                              | 339                              | 0,03                     | 4,083 % éch. 25/08/2036                               | 1 506                               | 1 357                            | 0,13                     | 3,950 % éch. 01/12/2047                                                                 | 100                                 | 73                               | 0,01                     |
|                                                                                         |                                     | 31 667                           | 2,98                     | 4,243 % éch. 25/10/2036                               |                                     |                                  |                          | 4,250 % éch. 15/03/2046                                                                 | 300                                 | 233                              | 0,02                     |
|                                                                                         |                                     |                                  |                          | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                | 4                                   | 1                                | 0,00                     | 4,300 % éch. 15/03/2045                                                                 | 100                                 | 79                               | 0,01                     |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                          | 3,923 % éch. 25/09/2037                               | 2 797                               | 770                              | 0,07                     | 4,550 % éch. 01/07/2030                                                                 | 200                                 | 197                              | 0,02                     |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                       |                                     |                                  |                          | 4,003 % éch. 25/02/2037                               | 971                                 | 539                              | 0,05                     | PacificCorp                                                                             |                                     |                                  |                          |
| 4,587 % éch. 18/02/2068                                                                 | £ 4 000                             | 5 306                            | 0,50                     | 4,013 % éch. 25/07/2036                               | 74                                  | 67                               | 0,01                     | 5,300 % éch. 15/02/2031                                                                 | 800                                 | 812                              | 0,08                     |
| Auburn PLC                                                                              |                                     |                                  |                          | New Century Home Equity Loan Trust                    | 208                                 | 187                              | 0,02                     | Philip Morris International, Inc.                                                       |                                     |                                  |                          |
| 4,586 % éch. 20/07/2045                                                                 | 926                                 | 1 231                            | 0,12                     | Option One Mortgage Loan Trust                        | 462                                 | 302                              | 0,03                     | 4,875 % éch. 13/02/2029                                                                 | 800                                 | 806                              | 0,08                     |
| Braccan Mortgage Funding PLC                                                            |                                     |                                  |                          | 4,043 % éch. 25/02/2037                               | 1 699                               | 1 123                            | 0,10                     | 5,125 % éch. 13/02/2031                                                                 | 800                                 | 815                              | 0,08                     |
| 4,607 % éch. 17/01/2068                                                                 | 900                                 | 1 197                            | 0,11                     | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust        | 13                                  | 3                                | 0,00                     | RD Michigan Property Owner LLC                                                          |                                     |                                  |                          |
| Elstree PLC                                                                             |                                     |                                  |                          | 3,883 % éch. 25/12/2036                               | 4 168                               | 1 623                            | 0,15                     | 7,500 % éch. 30/03/2045                                                                 | 5 300                               | 5 285                            | 0,50                     |
| 4,454 % éch. 21/01/2065                                                                 | 3 519                               | 4 668                            | 0,44                     | Soundview Home Loan Trust                             | 1 518                               | 1 460                            | 0,14                     | Southern Co.                                                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,475 % éch. 21/10/2065                                                                 | 2 630                               | 3 486                            | 0,33                     | 4,263 % éch. 25/11/2036                               | 316                                 | 321                              | 0,03                     | 1,875 % éch. 15/09/2081                                                                 | € 500                               | 562                              | 0,05                     |
| Eurosail PLC                                                                            |                                     |                                  |                          | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.        | 5 102                               | 316                              | 0,03                     | Wells Fargo & Co.                                                                       |                                     |                                  |                          |
| 4,816 % éch. 13/06/2045                                                                 | 97                                  | 129                              | 0,01                     | 5,102 % éch. 01/04/2035                               | 1 209                               | 1 209                            | 0,11                     | 4,410 % éch. 22/01/2028                                                                 | \$ 4 700                            | 4 709                            | 0,44                     |
| Harbour PLC                                                                             |                                     |                                  |                          | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | 15 346                              | 1 44                             | 0,01                     | 4,700 % éch. 22/04/2028                                                                 | 2 300                               | 2 310                            | 0,22                     |
| 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                 | 926                                 | 1 233                            | 0,12                     | 4,108 % éch. 25/01/2037                               |                                     |                                  |                          | 4,892 % éch. 15/09/2036                                                                 | 2 000                               | 1 952                            | 0,18                     |
| Harvest Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,897 % éch. 25/07/2033                                                                 | 200                                 | 199                              | 0,02                     |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                 | 1 400                               | 1 859                            | 0,17                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,960 % éch. 23/01/2037                                                                 | 900                                 | 879                              | 0,08                     |
| Hops Hill PLC                                                                           |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,211 % éch. 03/12/2035                                                                 | 2 100                               | 2 097                            | 0,20                     |
| 4,570 % éch. 21/06/2058 (b)                                                             | 4 000                               | 5 314                            | 0,50                     |                                                       |                                     |                                  |                          |                                                                                         |                                     | 84 017                           | 7,91                     |
| 4,614 % éch. 21/04/2056                                                                 | 880                                 | 1 168                            | 0,11                     |                                                       |                                     |                                  |                          | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                          |
| Mansard Mortgages PLC                                                                   |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | Adjustable Rate Mortgage Trust                                                          |                                     |                                  |                          |
| 4,516 % éch. 15/12/2049                                                                 | 131                                 | 174                              | 0,02                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,570 % éch. 25/09/2035                                                                 | 6                                   | 5                                | 0,00                     |
| Newgate Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | American Home Mortgage Assets Trust                                                     |                                     |                                  |                          |
| 3,001 % éch. 15/12/2050                                                                 | € 209                               | 238                              | 0,02                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 3,953 % éch. 25/05/2046                                                                 | 138                                 | 124                              | 0,01                     |
| Polaris PLC                                                                             |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,684 % éch. 25/10/2046                                                                 | 747                                 | 488                              | 0,05                     |
| 4,554 % éch. 27/10/2069                                                                 | £ 1 891                             | 2 510                            | 0,24                     |                                                       |                                     |                                  |                          | Banc of America Funding Trust                                                           |                                     |                                  |                          |
| RMAC PLC                                                                                |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,074 % éch. 20/02/2047                                                                 | 440                                 | 419                              | 0,04                     |
| 4,947 % éch. 15/02/2047                                                                 | 1 567                               | 2 080                            | 0,20                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,353 % éch. 20/10/2046                                                                 | 59                                  | 48                               | 0,01                     |
| Stratton Mortgage Funding PLC                                                           |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,727 % éch. 20/01/2047                                                                 | 23                                  | 20                               | 0,00                     |
| 4,721 % éch. 25/06/2049                                                                 | 818                                 | 1 086                            | 0,10                     |                                                       |                                     |                                  |                          | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                             |                                     |                                  |                          |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                                         |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 3,803 % éch. 25/08/2033                                                                 | 2                                   | 2                                | 0,00                     |
| 4,584 % éch. 20/04/2051                                                                 | 1 866                               | 2 477                            | 0,23                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,000 % éch. 25/05/2034                                                                 | 6                                   | 5                                | 0,00                     |
| Tower Bridge Funding PLC                                                                |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,015 % éch. 25/05/2047                                                                 | 97                                  | 87                               | 0,01                     |
| 4,497 % éch. 20/01/2073                                                                 | 991                                 | 1 314                            | 0,12                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,461 % éch. 25/10/2033                                                                 | 3                                   | 3                                | 0,00                     |
| Winchester PLC                                                                          |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                |                                     |                                  |                          |
| 4,637 % éch. 21/10/2056                                                                 | 1 823                               | 2 422                            | 0,23                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,394 % éch. 25/11/2036                                                                 | 334                                 | 165                              | 0,02                     |
|                                                                                         |                                     | 37 892                           | 3,57                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,486 % éch. 25/11/2035                                                                 | 79                                  | 59                               | 0,01                     |
|                                                                                         |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,642 % éch. 25/09/2035                                                                 | 196                                 | 101                              | 0,01                     |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                                            |                                     |                                  |                          |
| Bon du Trésor britannique                                                               |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 3,918 % éch. 26/12/2046                                                                 | 278                                 | 216                              | 0,02                     |
| 0,625 % éch. 22/10/2050                                                                 | 2 700                               | 1 267                            | 0,12                     |                                                       |                                     |                                  |                          | Chase Mortgage Finance Trust                                                            |                                     |                                  |                          |
| 1,250 % éch. 31/07/2051                                                                 | 3 500                               | 1 973                            | 0,19                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,763 % éch. 25/07/2037                                                                 | 32                                  | 25                               | 0,00                     |
| 1,500 % éch. 31/07/2053                                                                 | 1 600                               | 932                              | 0,09                     |                                                       |                                     |                                  |                          | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                     |                                     |                                  |                          |
| 1,750 % éch. 22/01/2049                                                                 | 2 200                               | 1 525                            | 0,15                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,445 % éch. 25/09/2037                                                                 | 166                                 | 160                              | 0,02                     |
| 3,250 % éch. 22/01/2044                                                                 | 1 700                               | 1 722                            | 0,16                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,669 % éch. 25/08/2035                                                                 | 152                                 | 142                              | 0,01                     |
| 4,375 % éch. 07/03/2030                                                                 | 18 100                              | 24 133                           | 2,27                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,860 % éch. 25/09/2035                                                                 | 5                                   | 5                                | 0,00                     |
| 5,250 % éch. 31/01/2041                                                                 | 500                                 | 670                              | 0,06                     |                                                       |                                     |                                  |                          | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through                               |                                     |                                  |                          |
| 5,375 % éch. 31/01/2056                                                                 | 1 000                               | 1 308                            | 0,12                     |                                                       |                                     |                                  |                          | Certificates                                                                            |                                     |                                  |                          |
|                                                                                         |                                     | 33 530                           | 3,16                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,405 % éch. 25/09/2035                                                                 | 218                                 | 210                              | 0,02                     |
| Total Royaume-Uni                                                                       |                                     | 104 948                          | 9,88                     |                                                       |                                     |                                  |                          | CitiMortgage Alternative Loan Trust                                                     |                                     |                                  |                          |
|                                                                                         |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,363 % éch. 25/02/2037                                                                 | 1 411                               | 1 202                            | 0,11                     |
| ÉTATS-UNIS                                                                              |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | Countrywide Alternative Loan Trust                                                      |                                     |                                  |                          |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 3,934 % éch. 20/02/2047                                                                 | 563                                 | 460                              | 0,04                     |
| Amortizing Residential Collateral Trust                                                 |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,113 % éch. 25/05/2037                                                                 | 66                                  | 20                               | 0,00                     |
| 4,463 % éch. 25/10/2031                                                                 | \$ 1                                | 1                                | 0,00                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,174 % éch. 20/07/2046                                                                 | 121                                 | 106                              | 0,01                     |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                                                 |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 4,437 % éch. 25/02/2037                                                                 | 77                                  | 69                               | 0,01                     |
| 4,463 % éch. 25/06/2034                                                                 | 58                                  | 56                               | 0,01                     |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,244 % éch. 25/11/2035                                                                 | 33                                  | 31                               | 0,00                     |
|                                                                                         |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,250 % éch. 25/06/2035                                                                 | 13                                  | 9                                | 0,00                     |
|                                                                                         |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,303 % éch. 25/11/2035                                                                 | 103                                 | 96                               | 0,01                     |
|                                                                                         |                                     |                                  |                          |                                                       |                                     |                                  |                          | 5,784 % éch. 25/11/2035                                                                 | 13                                  | 13                               | 0,00                     |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 5,794 % éch. 20/10/2035                                      | \$ 922                              | \$ 660                           | 0,06                     | Wachovia Mortgage Loan Trust LLC                               | \$ 1 266                            | \$ 425                           | 0,04                     | 3,000 % éch. 15/02/2048 (k)                                | \$ 2 000                            | \$ 1 473                         | 0,14                     |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                                      | 1 960                               | 974                              | 0,09                     | 1,492 % éch. 25/01/2037                                        |                                     |                                  |                          | 3,375 % éch. 15/11/2048 (k)                                | 4 200                               | 3 286                            | 0,31                     |
| 6,250 % éch. 25/08/2037                                      | 49                                  | 21                               | 0,00                     | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                  |                                     |                                  |                          | 4,125 % éch. 15/08/2044 (k)                                | 2 800                               | 2 533                            | 0,24                     |
| 6,500 % éch. 25/06/2036                                      | 151                                 | 72                               | 0,01                     | 3,667 % éch. 25/06/2037                                        | 73                                  | 64                               | 0,01                     | 4,500 % éch. 15/11/2054 (k)                                | 22 800                              | 21 229                           | 2,00                     |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust            |                                     |                                  |                          | 3,781 % éch. 25/05/2037                                        | 266                                 | 241                              | 0,02                     | 4,625 % éch. 15/02/2055 (k)                                | 13 500                              | 12 832                           | 1,21                     |
| 4,223 % éch. 25/05/2035                                      | 14                                  | 12                               | 0,00                     | 3,978 % éch. 27/02/2034                                        | 3                                   | 3                                | 0,00                     | 4,750 % éch. 15/02/2056                                    | 200                                 | 194                              | 0,02                     |
| 4,403 % éch. 25/03/2035                                      | 71                                  | 68                               | 0,01                     | 3,986 % éch. 25/02/2037                                        | 511                                 | 483                              | 0,05                     | 4,875 % éch. 15/08/2045                                    | 213                                 | 212                              | 0,02                     |
| 4,423 % éch. 25/02/2035                                      | 34                                  | 33                               | 0,00                     | 4,054 % éch. 25/09/2036                                        | 108                                 | 94                               | 0,01                     | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) |                                     |                                  |                          |
| 4,523 % éch. 25/09/2034                                      | 2                                   | 2                                | 0,00                     | 4,383 % éch. 25/01/2045                                        | 7                                   | 7                                | 0,00                     | 0,125 % éch. 15/07/2031                                    | 3 230                               | 2 966                            | 0,28                     |
| 4,669 % éch. 25/11/2034                                      | 3                                   | 3                                | 0,00                     | 4,744 % éch. 25/02/2046                                        | 158                                 | 147                              | 0,01                     | 0,125 % éch. 15/01/2032                                    | 1 321                               | 1 196                            | 0,11                     |
| 6,000 % éch. 25/02/2037                                      | 876                                 | 363                              | 0,03                     | 5,595 % éch. 25/03/2034                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                     | 0,500 % éch. 15/01/2028 (k)                                | 7 153                               | 6 973                            | 0,66                     |
| Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust               |                                     |                                  |                          | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust     |                                     |                                  |                          | 0,625 % éch. 15/07/2032                                    | 458                                 | 425                              | 0,04                     |
| 4,103 % éch. 25/06/2035                                      | 40                                  | 39                               | 0,00                     | 4,684 % éch. 25/07/2046                                        | 67                                  | 42                               | 0,00                     | 1,125 % éch. 15/01/2033                                    | 5 924                               | 5 605                            | 0,53                     |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                          |                                                                |                                     |                                  |                          | 2,500 % éch. 15/01/2029                                    | 5 582                               | 5 655                            | 0,53                     |
| 4,003 % éch. 25/08/2036                                      | 296                                 | 279                              | 0,03                     |                                                                |                                     | 14 774                           | 1,39                     | 3,875 % éch. 15/04/2029                                    | 4 253                               | 4 467                            | 0,42                     |
| Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                          | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                              |                                     |                                  |                          | Billets du Trésor américain                                |                                     |                                  |                          |
| 3,863 % éch. 25/10/2036                                      | 3                                   | 2                                | 0,00                     | Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                          | 3,500 % éch. 15/02/2033                                    | 600                                 | 573                              | 0,05                     |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust        |                                     |                                  |                          | 2,944 % éch. 25/07/2039                                        | 218                                 | 198                              | 0,02                     | 4,125 % éch. 15/02/2036 (k)                                | 1 180                               | 1 151                            | 0,11                     |
| 4,274 % éch. 19/08/2045                                      | 37                                  | 33                               | 0,00                     | 3,000 % éch. 01/03/2060                                        | 581                                 | 502                              | 0,05                     | 4,250 % éch. 15/05/2035                                    | 600                                 | 593                              | 0,06                     |
| 4,394 % éch. 19/07/2045                                      | 2                                   | 0                                | 0,00                     | 3,500 % éch. 01/01/2059                                        | 1 268                               | 1 137                            | 0,11                     |                                                            |                                     | 73 041                           | 6,88                     |
| First Horizon Mortgage Pass-Through Trust                    |                                     |                                  |                          | 3,847 % éch. 25/03/2034                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                     | Total États-Unis                                           |                                     | 607 332                          | 57,19                    |
| 5,737 % éch. 25/08/2035                                      | 11                                  | 7                                | 0,00                     | 3,877 % éch. 25/08/2034                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                     | INSTRUMENTS À COURT TERME                                  |                                     |                                  |                          |
| GreenPoint Mortgage Funding Trust                            |                                     |                                  |                          | 3,985 % éch. 25/03/2036                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                     | BILLETS DE TRÉSORERIE                                      |                                     |                                  |                          |
| 4,303 % éch. 25/11/2045                                      | 7                                   | 7                                | 0,00                     | 4,142 % éch. 25/06/2036                                        | 11                                  | 11                               | 0,00                     | AutoNation, Inc                                            |                                     |                                  |                          |
| GSR Mortgage Loan Trust                                      |                                     |                                  |                          | 4,242 % éch. 25/10/2040                                        | 25                                  | 25                               | 0,00                     | 4,050 % éch. 01/07/2026                                    | 1 250                               | 1 250                            | 0,12                     |
| 5,270 % éch. 25/03/2033                                      | 2                                   | 2                                | 0,00                     | 4,788 % éch. 25/03/2055                                        | 1 880                               | 1 902                            | 0,18                     | Telus Corp.                                                |                                     |                                  |                          |
| HarborView Mortgage Loan Trust                               |                                     |                                  |                          | 4,967 % éch. 01/09/2044                                        | 24                                  | 25                               | 0,00                     | 4,300 % éch. 02/07/2026                                    | 1 300                               | 1 300                            | 0,12                     |
| 4,594 % éch. 19/12/2036                                      | 88                                  | 82                               | 0,01                     | 5,717 % éch. 01/12/2034                                        | 4                                   | 4                                | 0,00                     | 4,380 % éch. 06/08/2026                                    | 1 250                               | 1 244                            | 0,12                     |
| 5,744 % éch. 19/10/2035                                      | 347                                 | 159                              | 0,02                     | 6,000 % éch. 25/04/2043 -                                      |                                     |                                  |                          |                                                            |                                     | 3 794                            | 0,36                     |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                                  |                                     |                                  |                          | 25/07/2044                                                     | 56                                  | 56                               | 0,01                     | BILLETS À COURT TERME                                      |                                     |                                  |                          |
| 3,655 % éch. 25/03/2036                                      | 454                                 | 331                              | 0,03                     | 6,225 % éch. 01/11/2034                                        | 21                                  | 22                               | 0,00                     | Kona Spc Ltd.                                              |                                     |                                  |                          |
| 4,355 % éch. 25/12/2034                                      | 6                                   | 6                                | 0,00                     | Freddie Mac                                                    |                                     |                                  |                          | 5,718 % éch. 15/09/2026                                    | € 1 000                             | 1 144                            | 0,11                     |
| JPMorgan Alternative Loan Trust                              |                                     |                                  |                          | 1,955 % éch. 15/01/2038 (a)                                    | 141                                 | 6                                | 0,00                     | BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN                                    |                                     |                                  |                          |
| 4,243 % éch. 25/10/2036                                      | 179                                 | 167                              | 0,02                     | 4,114 % éch. 15/01/2038                                        | 141                                 | 139                              | 0,01                     | 23,650 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 5,500 % éch. 25/11/2036                                      | 2                                   | 1                                | 0,00                     | 4,307 % éch. 15/12/2037 -                                      |                                     |                                  |                          | 13/10/2026 (c)(d)                                          | EGP 150                             | 3                                | 0,00                     |
| JPMorgan Mortgage Trust                                      |                                     |                                  |                          | 15/07/2040                                                     | 54                                  | 54                               | 0,01                     | 24,000 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 3,927 % éch. 27/07/2037                                      | 110                                 | 103                              | 0,01                     | 4,568 % éch. 25/11/2054                                        | 2 574                               | 2 595                            | 0,24                     | 13/10/2026 (c)(d)                                          | 300                                 | 5                                | 0,00                     |
| 5,293 % éch. 25/02/2036                                      | 61                                  | 38                               | 0,00                     | 4,608 % éch. 25/08/2055                                        | 1 740                               | 1 747                            | 0,16                     | 24,060 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 5,326 % éch. 25/11/2033                                      | 1                                   | 1                                | 0,00                     | 4,628 % éch. 25/02/2055                                        | 307                                 | 310                              | 0,03                     | 20/10/2026 (c)(d)                                          | 150                                 | 3                                | 0,00                     |
| MASTR Alternative Loan Trust                                 |                                     |                                  |                          | 4,742 % éch. 25/05/2043                                        | 15                                  | 15                               | 0,00                     | 24,651 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 4,163 % éch. 25/03/2036                                      | 86                                  | 7                                | 0,00                     | 4,944 % éch. 25/10/2044 -                                      |                                     |                                  |                          | 10/11/2026 (c)(d)                                          | 1 700                               | 32                               | 0,00                     |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust |                                     |                                  |                          | 25/02/2045                                                     | 113                                 | 107                              | 0,01                     |                                                            |                                     | 43                               | 0,00                     |
| 4,180 % éch. 15/12/2030                                      | 3                                   | 3                                | 0,00                     | 5,028 % éch. 25/03/2055                                        | 3 306                               | 3 343                            | 0,31                     | BONS DU TRÉSOR HONGROIS                                    |                                     |                                  |                          |
| Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust                   |                                     |                                  |                          | 6,522 % éch. 01/09/2035                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                     | 6,082 % éch.                                               |                                     |                                  |                          |
| 3,983 % éch. 25/03/2037                                      | 5 615                               | 1 295                            | 0,12                     | Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                          | 02/07/2026 (c)(d)                                          | HUF 1 585 000                       | 5 091                            | 0,48                     |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust                     |                                     |                                  |                          | 3,000 % éch. 20/07/2046 -                                      |                                     |                                  |                          | BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN                                    |                                     |                                  |                          |
| 3,870 % éch. 25/11/2037                                      | 601                                 | 505                              | 0,05                     | 20/11/2055                                                     | 25 742                              | 22 891                           | 2,16                     | 21,097 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 3,913 % éch. 25/02/2047                                      | 161                                 | 48                               | 0,00                     | 3,500 % éch. 20/09/2052 -                                      |                                     |                                  |                          | 07/07/2026 (c)(d)                                          | NGN 143 900                         | 105                              | 0,01                     |
| 4,063 % éch. 25/06/2037                                      | 219                                 | 216                              | 0,02                     | 20/01/2056                                                     | 38 943                              | 35 006                           | 3,30                     | 21,137 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 4,083 % éch. 25/03/2047                                      | 599                                 | 572                              | 0,05                     | 4,161 % éch. 20/01/2068                                        | 366                                 | 366                              | 0,03                     | 06/10/2026 (c)(d)                                          | 53 440                              | 37                               | 0,00                     |
| 4,123 % éch. 25/07/2036                                      | 1 039                               | 307                              | 0,03                     | 4,241 % éch. 20/02/2065                                        | 86                                  | 86                               | 0,01                     | 21,241 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 4,123 % éch. 25/06/2046                                      | 792                                 | 158                              | 0,02                     | 4,259 % éch. 20/05/2074                                        | 461                                 | 462                              | 0,04                     | 14/07/2026 (c)(d)                                          | 133 601                             | 97                               | 0,01                     |
| 4,563 % éch. 25/10/2045                                      | 54                                  | 37                               | 0,00                     | 4,361 % éch. 20/04/2064                                        | 131                                 | 131                              | 0,01                     | 21,322 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                      | 271                                 | 225                              | 0,02                     | 4,539 % éch. 20/01/2074                                        | 785                                 | 797                              | 0,08                     | 28/07/2026 (c)(d)                                          | 64 128                              | 46                               | 0,00                     |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust          |                                     |                                  |                          | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                          | 21,450 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 5,392 % éch. 25/09/2035                                      | 34                                  | 21                               | 0,00                     | 2,500 % éch. 01/07/2056                                        | 4 200                               | 3 587                            | 0,34                     | 07/07/2026 (c)(d)                                          | 179 900                             | 131                              | 0,01                     |
| 6,500 % éch. 25/03/2032                                      | 0                                   | 0                                | 0,00                     | 3,500 % éch. 01/07/2056                                        | 500                                 | 449                              | 0,04                     | 21,480 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| Sequoia Mortgage Trust                                       |                                     |                                  |                          | 6,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                          | 28/07/2026 (c)(d)                                          | 80 200                              | 58                               | 0,01                     |
| 4,015 % éch. 20/07/2037                                      | 347                                 | 264                              | 0,03                     | 01/08/2056                                                     | 37 100                              | 38 438                           | 3,62                     | 21,612 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 4,454 % éch. 20/07/2033                                      | 6                                   | 6                                | 0,00                     | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                          | 11/08/2026 (c)(d)                                          | 303 100                             | 215                              | 0,02                     |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust               |                                     |                                  |                          | 3,500 % éch. 01/10/2034 -                                      |                                     |                                  |                          | 21,625 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| 5,589 % éch. 25/04/2034                                      | 1                                   | 1                                | 0,00                     | 01/10/2039                                                     | 245                                 | 235                              | 0,02                     | 11/08/2026 (c)(d)                                          | 328 000                             | 233                              | 0,02                     |
| 5,923 % éch. 25/02/2034                                      | 6                                   | 6                                | 0,00                     | 4,000 % éch. 01/06/2050                                        | 506                                 | 479                              | 0,05                     | 21,638 % éch.                                              |                                     |                                  |                          |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust                  |                                     |                                  |                          | 5,500 % éch. 01/06/2053 -                                      |                                     |                                  |                          | 11/08/2026 (c)(d)                                          | 215 900                             | 153                              | 0,01                     |
| 4,083 % éch. 25/01/2037                                      | 797                                 | 731                              | 0,07                     | 01/10/2053                                                     | 15 220                              | 15 355                           | 1,45                     | 25/08/2026 (c)(d)                                          | 125 900                             | 89                               | 0,01                     |
| 4,143 % éch. 25/07/2046                                      | 256                                 | 182                              | 0,02                     | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                          | 18/08/2026 (c)(d)                                          | 71 900                              | 51                               | 0,01                     |
| 4,183 % éch. 25/05/2036                                      | 115                                 | 74                               | 0,01                     | 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 14 700                              | 13 741                           | 1,29                     |                                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,203 % éch. 25/05/2036                                      | 475                                 | 399                              | 0,04                     | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                          |                                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,334 % éch. 19/07/2034                                      | 2                                   | 2                                | 0,00                     | 01/08/2056                                                     | 41 950                              | 40 156                           | 3,78                     |                                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,454 % éch. 19/03/2034                                      | 1                                   | 1                                | 0,00                     | 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                          |                                                            |                                     |                                  |                          |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust        |                                     |                                  |                          | 01/08/2056                                                     | 226 890                             | 222 738                          | 20,98                    |                                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,043 % éch. 25/01/2036                                      | 133                                 | 113                              | 0,01                     | 5,500 % éch. 01/08/2056                                        | 12 700                              | 12 724                           | 1,20                     |                                                            |                                     |                                  |                          |
| 4,053 % éch. 25/10/2036                                      | 360                                 | 309                              | 0,03                     | 6,500 % éch. 01/07/2056                                        | 300                                 | 310                              | 0,03                     |                                                            |                                     |                                  |                          |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                          |                                     |                                  |                          |                                                                |                                     | 420 154                          | 39,57                    |                                                            |                                     |                                  |                          |
| 6,039 % éch. 25/06/2047                                      | 33                                  | 30                               | 0,00                     | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                |                                     |                                  |                          |                                                            |                                     |                                  |                          |
|                                                              |                                     |                                  |                          | Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                          |                                                            |                                     |                                  |                          |
|                                                              |                                     |                                  |                          | 1,375 % éch. 15/11/2040                                        | 1 200                               | 776                              | 0,07                     |                                                            |                                     |                                  |                          |
|                                                              |                                     |                                  |                          | 2,250 % éch. 15/08/2049                                        | 1 450                               | 902                              | 0,08                     |                                                            |                                     |                                  |                          |

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|------------------------------------------|---------|----------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------|---------|----------------------------------|--------------------------|
| 21,690 % éch.                       |                                     |                                  |                          | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |         |                                  |                          | <b>FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE</b>         |         |                                  |                          |
| 07/07/2026 (c)(d) NGN               | 164 100                             | \$ 119                           | 0,01                     | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |         |                                  |                          | PIMCO ETFs plc - Fonds                  |         |                                  |                          |
| 21,699 % éch.                       |                                     |                                  |                          | PIMCO Funds: Global                      |         |                                  |                          | PIMCO Advantage                         |         |                                  |                          |
| 25/08/2026 (c)(d)                   | 98 500                              | 69                               | 0,01                     | Investors Series plc -                   |         |                                  |                          | Euro Government                         |         |                                  |                          |
| 21,702 % éch.                       |                                     |                                  |                          | Fonds Global Bond                        |         |                                  |                          | Bond UCITS ETF (g)                      | 380 000 | \$ 11 026                        | 1,04                     |
| 18/08/2026 (c)(d)                   | 275 800                             | 195                              | 0,02                     | Opportunities Fund (g)                   | 327 056 | \$ 3 306                         | 0,31                     | PIMCO ETFs plc - Fonds                  |         |                                  |                          |
| 21,704 % éch.                       |                                     |                                  |                          | PIMCO Select Funds plc -                 |         |                                  |                          | PIMCO Advantage                         |         |                                  |                          |
| 01/09/2026 (c)(d)                   | 98 500                              | 69                               | 0,01                     | Fonds PIMCO                              |         |                                  |                          | Global Government                       |         |                                  |                          |
|                                     |                                     | 1 667                            | 0,16                     | US Dollar Short-Term                     |         |                                  |                          | Bond UCITS ETF (g)                      | 230 000 | 5 780                            | 0,54                     |
| <b>BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN</b>  |                                     |                                  |                          | Floating NAV Fund (g)                    | 54 475  | 543                              | 0,05                     |                                         |         | 16 806                           | 1,58                     |
| 7,046 % éch.                        |                                     |                                  |                          | PIMCO Specialty Funds                    |         |                                  |                          | <b>Total des Fonds d'investissement</b> |         | \$ 26 964                        | 2,54                     |
| 27/01/2027 (c)(d) ZAR               | 45 800                              | 2 687                            | 0,25                     | Ireland p.l.c. - Fonds                   |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| 7,304 % éch.                        |                                     |                                  |                          | PIMCO China                              |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| 19/08/2026 (c)(d)                   | 67 530                              | 4 085                            | 0,39                     | Bond Fund (g)                            | 402 852 | 6 309                            | 0,60                     |                                         |         |                                  |                          |
| 7,305 % éch.                        |                                     |                                  |                          |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| 18/11/2026 (c)(d)                   | 19 970                              | 1 188                            | 0,11                     |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| 7,393 % éch.                        |                                     |                                  |                          |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| 22/07/2026 (c)(d)                   | 14 710                              | 895                              | 0,08                     |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
|                                     |                                     | 8 855                            | 0,83                     |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| Total des Instruments à court terme |                                     | 20 594                           | 1,94                     |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |
| <b>Total des Valeurs mobilières</b> |                                     | \$ 1 381 839                     | 130,13                   |                                          |         |                                  |                          |                                         |         |                                  |                          |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                       | Long  | 12/2026              | 580                   | \$ (170)                                | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Long  | 09/2026              | 27                    | 10                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026              | 41                    | (45)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre           | Long  | 09/2026              | 27                    | 20                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026              | 314                   | 257                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026              | 373                   | (218)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026              | 792                   | 943                                     | 0,09                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026              | 266                   | (409)                                   | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 13                    | 34                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 231                   | (121)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026              | 351                   | (36)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026              | 48                    | (86)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026              | 200                   | 65                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 225                   | (5)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 173                   | 111                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 723                   | 930                                     | 0,09                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Court | 09/2026              | 46                    | (133)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026              | 433                   | 1 158                                   | 0,11                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ 2 305                                | 0,22                   |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>                 |       |                      |                       | \$ 2 305                                | 0,22                   |

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Deutsche Bank AG    | 1,000 %                 | 20/12/2032         | € 100                               | \$ 1                                    | 0,00                   |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 10 ans            | (1,000) %              | 20/12/2035         | \$ 8 017                            | \$ (3)                                  | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans            | (1,000)                | 20/06/2036         | 39 200                              | (323)                                   | (0,03)                 |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | (1,000)                | 20/06/2031         | € 47 700                            | (517)                                   | (0,05)                 |
|                                            |                        |                    |                                     | \$ (843)                                | (0,08)                 |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/12/2030         | \$ 42 253                           | \$ 22                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 72 500                              | 150                                     | 0,01                   |
|                                |                         |                    |                                     | \$ 172                                  | 0,01                   |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,000 %      | 17/06/2027         | £ 21 900             | \$ (223)                                | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2028         | 22 800               | 35                                      | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                     | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 16/09/2028         | 142 630              | (39)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2031         | 8 690                | (164)                                   | (0,02)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                     | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 16/09/2031         | 25 200               | (119)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 18/03/2036         | 5 930                | 45                                      | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 16/09/2036         | 36 100               | (374)                                   | (0,04)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500        | 18/03/2056         | 400                  | 21                                      | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500        | 16/09/2056         | 2 070                | 23                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 5,750        | 18/03/2031         | 119 070              | 18                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000        | 17/03/2031         | 328 000              | (3)                                     | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050        | 15/12/2031         | 851 000              | (34)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400        | 19/06/2039         | 540 000              | 95                                      | 0,01                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750        | 19/03/2027         | 5 930 000            | 45                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750        | 19/03/2030         | 1 370 000            | (12)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,800        | 15/06/2052         | 105 300              | (17)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/06/2027         | 730 000              | (1)                                     | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 17/12/2027         | 1 380 000            | (18)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 19/03/2032         | 2 450 000            | (153)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/09/2034         | 2 660 000            | (322)                                   | (0,03)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/12/2034         | 2 400 000            | (325)                                   | (0,03)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 19/03/2035         | 823 900              | (121)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 19/06/2044         | 140 000              | 34                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250        | 18/03/2031         | 660 000              | (68)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250        | 17/09/2035         | 3 569 950            | (533)                                   | (0,05)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 16/09/2028         | 21 687 000           | (163)                                   | (0,02)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500        | 18/03/2036         | 1 490 000            | (415)                                   | (0,04)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | 5 890 000            | 218                                     | 0,02                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,000        | 17/06/2036         | 190 000              | (39)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,200        | 17/06/2033         | 550 000              | 17                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,250        | 17/09/2055         | 60 000               | (17)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,500        | 17/12/2055         | 60 000               | (60)                                    | (0,01)                 |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,500        | 18/03/2056         | 80 000               | (42)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,750        | 17/06/2056         | 90 000               | (35)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750        | 16/09/2031         | 51 782               | 168                                     | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,000        | 16/09/2031         | 28 200               | (89)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750        | 16/09/2031         | 341 600              | (41)                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000        | 16/09/2031         | 204 500              | 80                                      | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000        | 16/09/2031         | 212 100              | (20)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,965        | 30/11/2026         | 27 900               | 227                                     | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 19/03/2027         | 61 330               | (700)                                   | (0,07)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000        | 17/06/2028         | 73 050               | 44                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 18/06/2027         | 2 200                | (5)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 17/06/2031         | 27 495               | (109)                                   | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                     | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 16/09/2031         | 2 400                | 9                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 19/03/2035         | 8 070                | 43                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250        | 19/03/2055         | 3 120                | 122                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325        | 31/08/2030         | 46 830               | 833                                     | 0,08                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,408        | 05/09/2034         | 2 100                | 98                                      | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,460        | 30/06/2027         | 35 200               | (311)                                   | (0,03)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,470        | 04/09/2034         | 2 200                | 92                                      | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 18/03/2028         | 1 680                | (22)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 18/03/2031         | 53 310               | 882                                     | 0,08                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 17/06/2033         | 300                  | 3                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500        | 18/12/2054         | 600                  | 63                                      | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,525        | 04/09/2034         | 3 500                | 131                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,548        | 31/08/2030         | 1 600                | (22)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551        | 17/09/2035         | 4 300                | 170                                     | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,555        | 28/08/2034         | 2 600                | 91                                      | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,557        | 31/08/2030         | 1 500                | (20)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,564        | 31/01/2033         | 500                  | 10                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,574        | 31/08/2030         | 1 500                | (19)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,582        | 31/08/2030         | 1 600                | (20)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,583        | 31/08/2030         | 1 800                | (22)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,587        | 31/08/2030         | 1 300                | (16)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,599        | 31/08/2030         | 1 300                | (15)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,600        | 28/08/2034         | 2 450                | 79                                      | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,611        | 28/08/2034         | 350                  | 11                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,637        | 31/08/2030         | 1 200                | (13)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,643        | 31/08/2030         | 3 800                | (39)                                    | 0,00                   |



| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,649 %   | 31/08/2030      | 2 500             | \$ (25)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,662     | 31/05/2028      | 4 700             | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,672     | 31/01/2033      | 800               | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,678     | 31/01/2033      | 1 000             | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/05/2028      | 11 000            | 64                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/01/2033      | 1 100             | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,693     | 31/01/2033      | 1 200             | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,698     | 31/01/2033      | 800               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 31/01/2033      | 1 000             | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,700     | 20/02/2049      | 600               | 43                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,714     | 31/01/2033      | 1 000             | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 11 355            | 210                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,735     | 31/01/2033      | 2 000             | 22                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 31/01/2033      | 600               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2026      | 12 000            | (81)                              | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      | 50 100            | (426)                             | (0,04)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 15 100            | 146                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2034      | 5 700             | (71)                              | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 4 400             | 71                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035      | 10 400            | 409                               | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 48 600            | 1 291                             | 0,12                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 36 503            | 52                                | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 5 600             | (118)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,753     | 31/01/2033      | 1 600             | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,755     | 15/02/2036      | 1 200             | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,765     | 15/02/2055      | 2 500             | 182                               | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,772     | 15/02/2055      | 500               | 36                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,773     | 04/03/2055      | 2 200             | 157                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,804     | 15/02/2055      | 2 100             | 139                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,806     | 15/02/2055      | 1 000             | 66                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,836     | 15/05/2034      | 1 900             | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,847     | 15/05/2034      | 1 100             | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,851     | 28/02/2029      | 7 600             | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,860     | 15/05/2034      | 2 000             | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,861     | 15/02/2055      | 700               | 40                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,862     | 28/02/2029      | 7 200             | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,866     | 15/02/2055      | 700               | 39                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 15/08/2026      | 9 200             | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 25/06/2055      | 1 676             | 70                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,931     | 15/11/2054      | 2 600             | 115                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,955     | 15/11/2054      | 1 200             | 49                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,959     | 15/11/2054      | 2 400             | 95                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 27/06/2055      | 2 072             | 85                                | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,964     | 15/11/2054      | 1 200             | 47                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      | 1 400             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,988     | 15/11/2053      | 3 100             | 114                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,996     | 15/11/2054      | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 16 810            | (55)                              | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 13 500            | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 36 140            | 581                               | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 3 730             | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,005     | 29/09/2055      | 705               | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 2 220             | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,015     | 15/11/2053      | 220               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,052     | 15/02/2056      | 200               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,065     | 26/06/2055      | 1 100             | 44                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,066     | 15/02/2046      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,075     | 15/11/2053      | 1 828             | 26                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,076     | 15/02/2046      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,082     | 15/11/2053      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,115     | 15/11/2054      | 3 220             | 41                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,130     | 15/11/2054      | 1 280             | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,222     | 15/11/2052      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,224     | 15/11/2052      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,225     | 15/11/2052      | 800               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,227     | 15/11/2052      | 1 200             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,228     | 15/11/2052      | 500               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,232     | 15/11/2052      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,233     | 15/11/2052      | 700               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,238     | 15/11/2052      | 600               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,244     | 15/11/2052      | 600               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,245     | 15/11/2052      | 1 200             | (6)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,248     | 15/11/2052      | 900               | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,500     | 16/06/2051      | 250               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,900     | 18/12/2029      | 21 800            | 927                               | 0,09                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | 20 700            | (58)                              | (0,01)              |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/09/2029      | 4 000             | 25                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,850     | 01/06/2033      | 1 000             | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,880     | 01/09/2033      | 7 300             | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 18/06/2027      | 7 300             | 39                                | 0,00                |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      | 2 000             | (10)                              | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000 %   | 01/06/2033      | CAD 1 400         | \$ (9)                            | 0,00                |
| À payer                                            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 18/03/2036      | 13 100            | 109                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,180     | 01/06/2033      | 10 600            | (107)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 15/03/2033      | 4 900             | (151)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 21/06/2053      | 2 300             | 59                                | 0,01                |
| À payer                                            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 18/03/2056      | 1 600             | 26                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,300     | 01/06/2033      | 14 700            | (331)                             | (0,03)              |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,400     | 01/06/2033      | 1 400             | (27)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 01/09/2033      | 7 000             | (276)                             | (0,03)              |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,700     | 01/09/2033      | 3 000             | (110)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,000     | 18/03/2028      | CHF 29 800        | 77                                | 0,01                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 18/03/2031      | 10 900            | 62                                | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 16/09/2031      | 9 900             | 160                               | 0,02                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,283     | 14/02/2027      | 900               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,294     | 10/02/2027      | 8 500             | 52                                | 0,01                |
| À payer                                            | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,343     | 16/05/2027      | 1 900             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 17/06/2031      | CNY 46 600        | 33                                | 0,00                |
| À payer                                            | KORIBOR KRW à 3 mois              | 2,750     | 18/03/2036      | KRW 26 167 240    | (1 780)                           | (0,17)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/12/2028      | NZD 52 900        | 115                               | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/09/2029      | 2 500             | 11                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR NZD à 3 mois                  | 4,000     | 16/12/2031      | 11 800            | 75                                | 0,01                |
| À payer                                            | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,474     | 03/02/2030      | SEK 53 000        | 52                                | 0,01                |
| À payer                                            | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,500     | 18/03/2031      | 189 000           | 233                               | 0,02                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,750     | 16/09/2031      | 46 300            | 42                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,300     | 08/06/2036      | ZAR 59 000        | 97                                | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,500     | 18/03/2031      | AUD 106 600       | (2 660)                           | (0,25)              |
| À recevoir                                         | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,750     | 18/03/2031      | 22 000            | (36)                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 19/03/2035      | 5 300             | (137)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 17/09/2035      | 1 100             | (39)                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 18/03/2036      | 2 300             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 16/09/2031      | 18 500            | (127)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 19/03/2035      | 6 000             | (140)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 17/09/2035      | 1 400             | (44)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2036      | 23 200            | (50)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2056      | 700               | (11)                              | 0,00                |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois               | 1,913     | 30/01/2029      | CZK 24 300        | (73)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,350     | 20/01/2036      | 41 700            | 3                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,523     | 01/12/2035      | 53 000            | 23                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,451     | 27/05/2050      | € 300             | (136)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,650     | 12/04/2027      | 2 400             | (39)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,650     | 11/05/2027      | 1 800             | (27)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,700     | 11/04/2027      | 1 400             | (23)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,000     | 13/05/2027      | 2 200             | (33)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,000     | 18/05/2027      | 1 300             | (20)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,795     | 11/10/2029      | 4 500             | (108)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,923     | 11/10/2029      | 10 800            | (199)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,170     | 15/12/2028      | 43 400            | (141)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | 162 100           | (687)                             | (0,06)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 21/09/2042      | 1 260             | (238)                             | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,350     | 15/12/2028      | 44 200            | 147                               | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 70 390            | 282                               | 0,03                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 47 470            | 398                               | 0,04                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 18/09/2039      | 5 400             | (33)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 18/03/2041      | 500               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,825     | 19/09/2055      | 30 400            | (229)                             | (0,02)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 19/03/2027      | 30 530            | (44)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 20 380            | 347                               | 0,03                |
| À payer                                            | NIBOR NOK à 6 mois                | 3,750     | 18/03/2031      | NOK 71 600        | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | NIBOR NOK à 6 mois                | 4,500     | 16/09/2031      | 5 300             | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,700     | 20/01/2036      | PLN 7 400         | (10)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,723     | 01/12/2035      | 9 500             | (20)                              | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ (1 939)                        | (0,18)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ (2 609)                        | (0,25)              |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONS ACHETÉES****OPTIONS DE CHANGE**

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 1 907                            | \$ 19  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 424                              | 3      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre SGD hors cote  | SGD 1,315       | 05/11/2026        | 2 348                            | 17     | 6            | 0,00                |
| BPS          | Option de vente - EUR contre CZK hors cote | CZK 24,040      | 13/08/2026        | 1 035                            | 4      | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - USD contre JPY hors cote | ¥ 155,000       | 06/08/2026        | 5 313                            | 22     | 9            | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | 165,000         | 06/08/2026        | 5 313                            | 12     | 18           | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 3 638                            | 33     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 3 638                            | 29     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 139 | \$ 33        | 0,00                |

**OPTIONS VENDUES****OPTIONS DE CHANGE**

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 390,740     | 16/10/2026        | 3 180                            | \$ (42)  | \$ (9)       | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 387,250         | 20/10/2026        | 1 099                            | (14)     | (4)          | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 1 907                            | (7)      | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 424                              | (1)      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre SGD hors cote | SGD 1,237       | 05/11/2026        | 2 348                            | (17)     | (3)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - USD contre JPY hors cote  | ¥ 162,000       | 06/08/2026        | 5 313                            | (27)     | (53)         | (0,01)              |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 3 638                            | (11)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 3 638                            | (9)      | 0            | 0,00                |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 389,720     | 21/10/2026        | 120                              | (2)      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | 375,000         | 10/11/2026        | 4 140                            | (66)     | (36)         | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (196) | \$ (105)     | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>**

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %           | 20/12/2029      | \$ 1 500                         | \$ (50)                | \$ 8                             | \$ (42)      | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %           | 20/12/2030      | 3 100                            | (114)                  | 11                               | (103)        | (0,01)              |
|              |                                                      |                     |                 |                                  | \$ (164)               | \$ 19                            | \$ (145)     | (0,01)              |

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>**

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 200                            | \$ 46                  | \$ (4)                           | \$ 42        | 0,00                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 800                            | 579                    | 17                               | 596          | 0,06                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 300                              | 68                     | (4)                              | 64           | 0,01                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 000                            | 432                    | (6)                              | 426          | 0,04                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 3 200                            | 711                    | (30)                             | 681          | 0,06                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 1 836               | \$ (27)                          | \$ 1 809     | 0,17                |

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

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

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



## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

### SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir                                                                                                           | À payer                                                                                                 | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,357 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027      | \$ 37 889                            | ¥ 5 683 300                           | \$ 295                 | \$ 32                            | \$ 327       | 0,03                |
| FAR          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 2 389                                | 377 500                               | 11                     | 16                               | 27           | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,442 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 10 215                               | 1 500 000                             | 16                     | 68                               | 84           | 0,01                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,450 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 17/03/2032      | 22 053                               | 3 484 300                             | 102                    | 150                              | 252          | 0,03                |
| GLM          | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,301 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR GBP composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 15/10/2045      | 9 266                                | £ 6 967                               | (3)                    | 19                               | 16           | 0,00                |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,315 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/12/2027      | 44 006                               | ¥ 6 821 000                           | (101)                  | 21                               | (80)         | (0,01)              |
|              | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour moins 0,425 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à SOFR JPY composé-OIS à 1 jour sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 16/09/2031      | 1 020                                | 150 000                               | 1                      | 6                                | 7            | 0,00                |
|              |                                                                                                                      |                                                                                                         |                 |                                      |                                       | \$ 321                 | \$ 312                           | \$ 633       | 0,06                |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500 %   | 17/03/2032      | CNY 109 500       | \$ (132)               | \$ 145                           | \$ 13        | 0,00                |
| BPS          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 146 590           | (113)                  | 131                              | 18           | 0,01                |
| CBK          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 15 200            | 1                      | 1                                | 2            | 0,00                |
| JPM          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 121 330           | (76)                   | 91                               | 15           | 0,00                |
| SCX          | À payer <sup>(1)</sup>           | CNREPOFIX CNY à 3 mois  | 1,500     | 17/03/2032      | 103 570           | (65)                   | 77                               | 12           | 0,00                |
|              |                                  |                         |           |                 |                   | \$ (385)               | \$ 445                           | \$ 60        | 0,01                |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                          | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 45 644                       | 1,248 %       | \$ 15 480         | 21/09/2026      | \$ 128                 | \$ (417)                         | \$ (289)     | (0,03)              |
| CBK          | À recevoir         | Indice SIBCSORA Index                          | S/O                          | 1,215         | SGD 90            | 26/08/2026      | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
|              |                    |                                                |                              |               |                   |                 | \$ 128                 | \$ (416)                         | \$ (288)     | (0,03)              |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |            | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |     | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|------------|--------------------|-----|-----------------------|-----|-----------------------------------------|---------------------|------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 13 081     | \$                | 9 354      | \$                 | 291 | \$                    | 0   | \$                                      | 291                 | 0,03 |
|              | 07/2026           | CNH             | 172 694    |                   | 25 571     |                    | 130 |                       | 0   |                                         | 130                 | 0,01 |
|              | 07/2026           | NZD             | 6 603      |                   | 3 899      |                    | 144 |                       | 0   |                                         | 144                 | 0,01 |
|              | 07/2026           | SGD             | 418        |                   | 328        |                    | 5   |                       | 0   |                                         | 5                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 337        |                   | 479        |                    | 1   |                       | 0   |                                         | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 3 428      | CAD               | 6 068      |                    | 24  |                       | 0   |                                         | 24                  | 0,00 |
|              | 08/2026           | CAD             | 478        | \$                | 337        |                    | 0   | (1)                   |     | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | NZD             | 6 068      |                   | 3 432      |                    | 0   | (24)                  |     | (24)                                    | 0,00                |      |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 104        |                   | 20         |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | ¥               | 72 994     |                   | 459        |                    | 10  |                       | 0   |                                         | 10                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | KRW             | 982 649    |                   | 645        |                    | 11  |                       | 0   |                                         | 11                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 280      |                   | 231        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | SGD             | 11         |                   | 9          |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 2 073      | CNH               | 14 019     |                    | 0   | (8)                   |     | (8)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 795        | CNY               | 5 448      |                    | 6   |                       | 0   |                                         | 6                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 530        | ILS               | 1 544      |                    | 0   | (12)                  |     | (12)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 541      | ¥                 | 245 100    |                    | 0   | (33)                  |     | (33)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 972        | NOK               | 9 030      |                    | 0   | (59)                  |     | (59)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 88         | PLN               | 333        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | HKD             | 4 791      | \$                | 612        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 681      |                   | 565        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | ZAR             | 65 359     |                   | 3 752      |                    | 0   | (220)                 |     | (220)                                   | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | INR             | 45 708     |                   | 481        |                    | 1   |                       | 0   |                                         | 1                   | 0,00 |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 976      |                   | 111        |                    | 0   | (1)                   |     | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | PEN             | 3 569      |                   | 1 038      |                    | 0   | (5)                   |     | (5)                                     | 0,00                |      |
|              | 10/2026           | HUF             | 72 891     | €                 | 198        |                    | 0   | (6)                   |     | (6)                                     | 0,00                |      |
|              | 12/2026           | PEN             | 1 837      | \$                | 532        |                    | 0   | (3)                   |     | (3)                                     | 0,00                |      |
|              | 01/2027           | ZAR             | 43 905     |                   | 2 670      |                    | 36  |                       | 0   |                                         | 36                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | BRL             | 2 653      |                   | 513        |                    | 2   | (2)                   |     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | CHF             | 682        |                   | 867        |                    | 22  |                       | 0   |                                         | 22                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | CNH             | 199 073    |                   | 29 418     |                    | 91  |                       | 0   |                                         | 91                  | 0,01 |
|              | 07/2026           | CNY             | 5 601      |                   | 822        |                    | 0   | (2)                   |     | (2)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | €               | 9 654      |                   | 10 967     |                    | 0   | (70)                  |     | (70)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | £               | 6 608      |                   | 8 778      |                    | 24  | (16)                  |     | 8                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | IDR             | 98 085 560 |                   | 5 473      |                    | 4   | (3)                   |     | 1                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 318      |                   | 1 126      |                    | 12  |                       | 0   |                                         | 12                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | INR             | 181 527    |                   | 1 890      |                    | 0   | (28)                  |     | (28)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | ¥               | 246 912    |                   | 1 553      |                    | 34  |                       | 0   |                                         | 34                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | KRW             | 423 771    |                   | 278        |                    | 4   |                       | 0   |                                         | 4                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | THB             | 26 045     |                   | 794        |                    | 10  | (1)                   |     | 9                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 343      | BRL               | 6 964      |                    | 5   | (3)                   |     | 2                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 171      | CNY               | 7 977      |                    | 1   |                       | 0   |                                         | 1                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 526        | CZK               | 10 941     |                    | 0   | (10)                  |     | (10)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 120      | £                 | 851        |                    | 9   |                       | 0   |                                         | 9                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 6 057      | INR               | 575 443    |                    | 23  | (10)                  |     | 13                                      | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 140      | ¥                 | 184 500    |                    | 0   | (5)                   |     | (5)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 299      | KRW               | 1 993 313  |                    | 0   | (12)                  |     | (12)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 183        | KWD               | 56         |                    | 0   | (3)                   |     | (3)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 662        | PLN               | 2 488      |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 271        | TWD               | 8 550      |                    | 0   | (3)                   |     | (3)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | ZAR             | 18 026     | \$                | 1 099      |                    | 1   |                       | 0   |                                         | 1                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | BRL             | 35         |                   | 7          |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | CZK             | 5 944      | €                 | 244        |                    | 0   | (1)                   |     | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 338        | \$                | 113        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           | TWD             | 340 325    |                   | 10 717     |                    | 57  |                       | 0   |                                         | 57                  | 0,01 |
|              | 08/2026           | \$              | 6 647      | INR               | 632 358    |                    | 6   |                       | 0   |                                         | 6                   | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 16         | TWD               | 503        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 09/2026           | COP             | 2 003 582  | \$                | 571        |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 09/2026           | IDR             | 11 445 242 |                   | 630        |                    | 0   | (4)                   |     | (4)                                     | 0,00                |      |
|              | 09/2026           | THB             | 23 171     |                   | 714        |                    | 12  |                       | 0   |                                         | 12                  | 0,00 |
|              | 09/2026           | \$              | 3 593      | IDR               | 63 681 160 |                    | 5   | (68)                  |     | (63)                                    | 0,00                |      |
|              | 09/2026           |                 | 20         | INR               | 1 892      |                    | 0   |                       | 0   |                                         | 0                   | 0,00 |
|              | 09/2026           |                 | 140        | THB               | 4 578      |                    | 0   | (1)                   |     | (1)                                     | 0,00                |      |
|              | 12/2026           |                 | 417        | IDR               | 7 583 262  |                    | 1   |                       | 0   |                                         | 1                   | 0,00 |
|              | 01/2027           |                 | 6 125      | TWD               | 192 362    |                    | 0   | (122)                 |     | (122)                                   | 0,00                |      |
|              | 02/2027           |                 | 13 501     |                   | 420 205    |                    | 0   | (396)                 |     | (396)                                   | 0,00                |      |
|              | 06/2027           |                 | 181        | KWD               | 55         |                    | 0   | (2)                   |     | (2)                                     | 0,00                |      |
|              | 05/2029           | KWD             | 630        | \$                | 2 167      |                    | 111 |                       | 0   |                                         | 111                 | 0,01 |
|              | 07/2029           |                 | 73         |                   | 250        |                    | 13  |                       | 0   |                                         | 13                  | 0,00 |
|              | 05/2030           |                 | 453        |                   | 1 560      |                    | 80  |                       | 0   |                                         | 80                  | 0,01 |
|              | 06/2031           |                 | 187        |                   | 629        |                    | 17  |                       | 0   |                                         | 17                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 364      |                   | 1 137      |                    | 7   |                       | 0   |                                         | 7                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | ¥               | 183 824    |                   | 1 137      |                    | 6   |                       | 0   |                                         | 6                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | MYR             | 62 740     |                   | 15 448     |                    | 89  |                       | 0   |                                         | 89                  | 0,01 |
|              | 07/2026           | NZD             | 9 591      |                   | 5 672      |                    | 216 |                       | 0   |                                         | 216                 | 0,02 |
|              | 07/2026           | TRY             | 55 449     |                   | 1 160      |                    | 0   | (15)                  |     | (15)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 153      | CNH               | 7 783      |                    | 0   | (6)                   |     | (6)                                     | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 789        | €                 | 680        |                    | 0   | (12)                  |     | (12)                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           |                 | 6 599      | TRY               | 317 081    |                    | 96  |                       | 0   |                                         | 96                  | 0,01 |
|              | 07/2026           | ZAR             | 97 077     | \$                | 5 936      |                    | 58  | (35)                  |     | 23                                      | 0,00                |      |
| 08/2026      | \$                | 1 137           | ¥          | 183 342           |            | 0                  | (6) |                       | (6) | 0,00                                    |                     |      |

# Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BSH          | 12/2026           | ZAR             | 5 482             | \$ 311             | \$ 0                  | \$ (18)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 308 432         | 8 229              | 179                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | PEN             | 5 624             | 1 591              | 0                     | (58)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 1 817             | 1 558              | 0                     | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 938             | NZD 10 510         | 40                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 10 510            | \$ 5 945           | 0                     | (40)                                    | 0,00                |
|              | 02/2027           | PEN             | 4 520             | 1 299              | 0                     | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 2 211             | 345                | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 420             | 7 486              | 146                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | HUF             | 7 395             | 24                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | ILS             | 3 700             | 1 274              | 31                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 122 449           | 1 298              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 3 100             | 334                | 21                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 7 026             | 2 035              | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 824             | CNH 12 339         | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 182               | CNY 1 250          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 415               | COP 1 431 594      | 2                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 336               | HUF 104 840        | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 049             | IDR 18 817 932     | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 264             | INR 122 449        | 30                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 138               | KRW 209 092        | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 987             | PEN 10 191         | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 601               | PLN 2 197          | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6 399             | SEK 59 120         | 0                     | (290)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 97                | TWD 3 062          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 3 856             | \$ 1 330           | 34                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 378 381           | 4 037              | 57                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | TWD             | 364 020           | 11 472             | 69                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 277               | ILS 822            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 33                | KZT 17 153         | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 42 610 091        | \$ 2 360           | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 12 634            | 132                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 10 217            | 2 986              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 327 978           | 10 162             | 230                   | (3)                                     | 0,02                |
|              | 09/2026           | \$              | 485               | COP 1 918 019      | 61                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 703               | IDR 12 542 545     | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 334               | MXN 5 966          | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 31                | PEN 105            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 1 259 748         | \$ 358             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           |                 | 206 843           | 57                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 7 866             | 2 298              | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 662               | COP 2 620 120      | 69                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 12/2026           |                 | 1 311             | IDR 23 842 245     | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN             | 11 331            | \$ 3 337           | 40                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 2 518 816         | 141                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 154 958           | 1 641              | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 1 741             | 515                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 502               | 393                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 421             | CNH 16 369         | 0                     | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 568               | CZK 11 823         | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 095             | INR 105 626        | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 218               | KZT 117 033        | 25                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 98                | NOK 908            | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 589               | PLN 2 186          | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 47 307            | \$ 2 891           | 35                    | (26)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR             | 246 232           | 2 618              | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 24 350 381        | 1 351              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 1 965             | 571                | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 501               | IDR 9 093 146      | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 641             | INR 156 009        | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 31 624            | \$ 9 109           | 0                     | (117)                                   | (0,01)              |
|              | 12/2026           | ZAR             | 9 426             | 535                | 0                     | (32)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 198 049           | 29 273             | 97                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | £               | 54 986            | 73 941             | 962                   | 0                                       | 0,09                |
|              | 07/2026           | INR             | 652               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 30 349            | 191                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 35 266            | 3 634              | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 20 077            | 15 738             | 215                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 94 313            | CNH 641 513        | 194                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 3 553             | € 3 115            | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 778             | HUF 1 475 897      | 0                     | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7                 | INR 652            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 34 366            | ¥ 5 560 453        | 0                     | (153)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 2 741             | PLN 10 061         | 0                     | (64)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 58 976            | \$ 3 574           | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 640 104           | 94 313             | 0                     | (187)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | €               | 3 115             | 3 557              | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 338             | 467                | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 5 545 902         | 34 366             | 154                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | PEN             | 3 893             | 1 151              | 11                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 3 634             | SEK 35 204         | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 2 740 790         | \$ 754             | 0                     | (27)                                    | 0,00                |
| FAR          |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 09/2026           | \$              | 3                 | INR 320            | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 271               | MXN 4 780          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN             | 3 970             | \$ 1 150           | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 119 449           | 23 201             | 123                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 405 414           | 263                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 22 300            | BRL 120 148        | 952                   | (39)                                    | 0,09                |
|              | 07/2026           |                 | 32 375            | CAD 46 070         | 97                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 3 085             | CNH 20 851         | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 141             | COP 3 945 070      | 3                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 010             | IDR 18 102 702     | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 263               | KRW 405 356        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 57                | \$ 11              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 46 004            | 32 375             | 0                     | (97)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 16                | INR 1 515          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | BRL             | 77                | \$ 15              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 3 353 502         | 961                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 18 208 713        | 1 010              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 387             | 79                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 99 575            | 3 086              | 69                    | 0                                       | 0,01                |
| IND JPM      | 09/2026           | \$              | 2 198             | IDR 39 477 762     | 5                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 56                | INR 5 360          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 406               | MXN 7 067          | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 23 196            | BRL 122 054        | 0                     | (123)                                   | (0,01)              |
|              | 11/2026           | COP             | 608 665           | \$ 168             | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 3 953             | 617                | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 56 622            | 40 365             | 1 138                 | 0                                       | 0,11                |
|              | 07/2026           | CNH             | 5 692             | 843                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF             | 18 565            | 61                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 9 202             | 3 082              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 38 229            | 405                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 125 276           | 81                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 5 035             | 509                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 384               | 227                | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 62                | CNH 419            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 104             | £ 823              | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 153               | IDR 2 754 685      | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 405               | INR 38 229         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 120               | KRW 185 027        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 759             | PLN 10 060         | 1                     | (83)                                    | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           |                 | 570               | THB 19 042         | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 7 000             | \$ 431             | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CZK             | 13 664            | € 560              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD             | 17 799            | \$ 2 275           | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 6 056             | 2 077              | 42                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 509               | NOK 5 037          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 2 769 993         | \$ 153             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 304 417           | 3 192              | 1                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 4 931             | 280                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 75 924            | 2 330              | 36                    | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 31                | INR 2 922          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 12 170            | MXN 211 544        | 0                     | (140)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 2 675             | THB 87 260         | 0                     | (32)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR             | 19 118            | \$ 1 091           | 0                     | (63)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | MXN             | 751               | 43                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 2 352             | MXN 41 517         | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 235               | 168                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 7 784             | 9 867              | 230                   | (12)                                    | 0,02                |
|              | 07/2026           | COP             | 2 158 660         | 570                | 0                     | (53)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | €               | 6 403             | 7 408              | 88                    | 0                                       | 0,01                |
| MYI          | 07/2026           | IDR             | 249 027           | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 155 571           | 1 647              | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 219 193         | 7 673              | 172                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | KRW             | 16 913 773        | 11 158             | 233                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 624             | 163                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 21 536            | 2 212              | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 35 216            | AUD 50 998         | 139                   | (23)                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 143               | CAD 200            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 221             | DKK 8 001          | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 540             | INR 244 828        | 43                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 233               | NOK 2 157          | 0                     | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 14                | SEK 130            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 47 843            | \$ 32 991          | 0                     | (135)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | DKK             | 7 987             | 1 221              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD             | 53 882            | 1 704              | 16                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 163               | NOK 1 624          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 212             | SEK 21 498         | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 16 215            | \$ 486             | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 724             | INR 164 000        | 1                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 01/2027           | TWD             | 427 733           | \$ 13 240          | 0                     | (109)                                   | (0,01)              |
| NSL          | 07/2026           | HUF             | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | \$              | 17 766            | TWD 556 274        | 0                     | (405)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           |                 | 940               | IDR 16 756 236     | 0                     | (3)                                     | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|--------|
| SCX          | 07/2026           | \$              | 2 569             | INR 247 102        | \$ 40                 | \$ 0                                    | \$ 40               | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 2 508             | TRY 118 072        | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | IDR             | 16 850 209        | \$ 940             | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | \$              | 430               | IDR 7 657 507      | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | COP             | 3 353 502         | \$ 871             | 0                     | (97)                                    | (97)                | (0,01) |        |
|              | 07/2026           | \$              | 1 877             | CNH 12 704         | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 816               | CNY 5 571          | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 1 797             | £ 1 340            | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 356               | IDR 6 389 353      | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 3 380             | INR 324 015        | 40                    | 0                                       | 40                  | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 1 551             | ¥ 246 400          | 0                     | (35)                                    | (35)                | 0,00   |        |
|              | 08/2026           | HKD             | 16 797            | \$ 2 148           | 2                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           | \$              | 39                | INR 3 762          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | IDR             | 19 122 635        | \$ 1 059           | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | THB             | 39 853            | \$ 1 230           | 24                    | (1)                                     | 23                  | 0,00   |        |
| SOG          | 09/2026           | \$              | 1 185             | IDR 21 291 940     | 2                     | (7)                                     | (5)                 | 0,00   |        |
|              | 09/2026           |                 | 220               | THB 7 198          | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |        |
|              | 11/2026           | NGN             | 404 375           | \$ 250             | 0                     | (28)                                    | (28)                | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | CNH             | 150 455           | 22 241             | 76                    | 0                                       | 76                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           | DKK             | 4 150             | 646                | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | €               | 262 874           | 306 654            | 6 109                 | 0                                       | 6 109               | 0,58   |        |
|              | 07/2026           | ¥               | 3 174 760         | 19 984             | 450                   | 0                                       | 450                 | 0,04   |        |
|              | 07/2026           | PEN             | 2 817             | 832                | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | SGD             | 31                | 24                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | \$              | 13 069            | AUD 18 941         | 53                    | 0                                       | 53                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           |                 | 15                | CAD 21             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 10                | CHF 8              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 316 475           | € 278 219          | 1 614                 | 0                                       | 1 614               | 0,15   |        |
|              | 07/2026           |                 | 16 246            | SGD 21 039         | 19                    | 0                                       | 19                  | 0,00   |        |
|              | SSB               | 08/2026         | AUD               | 18 941             | \$ 13 061             | 0                                       | (54)                | (54)   | (0,01) |
| 08/2026      |                   | CHF             | 8                 | 10                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
| 08/2026      |                   | €               | 278 219           | 316 904            | 0                     | (1 610)                                 | (1 610)             | (0,15) |        |
| 08/2026      |                   | SGD             | 20 992            | 16 246             | 0                     | (20)                                    | (20)                | 0,00   |        |
| 08/2026      |                   | \$              | 24                | SGD 31             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
| 07/2026      |                   | CAD             | 47 578            | \$ 34 503          | 968                   | 0                                       | 968                 | 0,09   |        |
| 07/2026      |                   | CHF             | 404               | 513                | 12                    | 0                                       | 12                  | 0,00   |        |
| 07/2026      |                   | \$              | 297               | CAD 422            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
| 07/2026      |                   |                 | 77 435            | £ 58 580           | 315                   | 0                                       | 315                 | 0,03   |        |
| 08/2026      |                   | CAD             | 421               | \$ 297             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
| 08/2026      |                   | COP             | 5 549 883         | 1 455              | 0                     | (137)                                   | (137)               | (0,01) |        |
| 08/2026      |                   | €               | 1 739             | 1 985              | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |        |
| 08/2026      |                   | £               | 58 580            | 77 433             | 0                     | (315)                                   | (315)               | (0,03) |        |
| UAG          |                   | 07/2026         | BRL               | 3 171              | 614                   | 1                                       | 0                   | 1      | 0,00   |
|              |                   | 07/2026         | \$                | 569                | CHF 450               | 0                                       | (11)                | (11)   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 46                | € 40               | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 600               | PLN 2 191          | 0                     | (17)                                    | (17)                | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | COP             | 39 699 296        | \$ 10 288          | 0                     | (1 027)                                 | (1 027)             | (0,10) |        |
| WST          | 09/2026           | MXN             | 2 085             | 119                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | THB             | 3 040             | 93                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |        |
|              | 10/2026           | HUF             | 8 252             | € 22               | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 11/2026           |                 | 343 230           | 952                | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | \$              | 10 417            | CHF 8 411          | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |        |
|              | 08/2026           | CHF             | 8 380             | \$ 10 417          | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |        |
|              |                   |                 |                   |                    | \$ 17 754             | \$ (7 333)                              | \$ 10 421           | 0,98   |        |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions (exposition au risque de change) de capitalisation, E en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en USD (exposition au risque de change) de capitalisation et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 419               | \$ 289             | \$ 0                  | \$ (1)                                  | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           | CAD             | 68                | 48                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 2 385             | AUD 3 349          | 0                     | (65)                                    | (65) (0,01)         |
|              | 07/2026           |                 | 2 609             | CNH 17 621         | 0                     | (13)                                    | (13) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 223               | NZD 382            | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 38                | SGD 48             | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 289               | AUD 419            | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 48                | CAD 68             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| BOA          | 07/2026           | CLP             | 26 138            | \$ 28              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CNY             | 473               | 70                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | €               | 131               | 152                | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 07/2026           | KRW             | 2 454 145         | 1 589              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | MXN             | 138               | 8                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | SGD             | 81                | 63                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 29                | CLP 26 138         | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 567               | ¥ 90 254           | 0                     | (12)                                    | (12) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 13                | NOK 117            | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 28                | CLP 26 138         | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |            | Plus-value latente |    | (Moins-value) latente |       | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|------------|--------------------|----|-----------------------|-------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| BPS          | 08/2026           | \$              | 1 589      | KRW               | 2 453 811  | \$                 | 0  | \$                    | (3)   | \$                                      | (3)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 8          | MXN               | 138        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 63         | SGD               | 81         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 798        | \$                | 117        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 225        |                   | 257        |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 190        |                   | 251        |                    | 0  |                       | (2)   |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | HUF             | 35 596     |                   | 115        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 99         | CAD               | 137        |                    | 0  |                       | (3)   |                                         | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 74         | CNH               | 503        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 25 038     | €                 | 21 495     |                    | 1  |                       | (465) |                                         | (464)               | (0,05) |
| BRC          | 07/2026           |                 | 6 758      | £                 | 5 043      |                    | 0  |                       | (65)  |                                         | (65)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 57         | ¥                 | 9 208      |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 779        | THB               | 25 244     |                    | 0  |                       | (19)  |                                         | (19)                | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 251        | £                 | 190        |                    | 2  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 115        | HUF               | 35 646     |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 464        | \$                | 69         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 9 460      |                   | 59         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | MXN             | 10 672     |                   | 608        |                    | 0  |                       | (3)   |                                         | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             | 1 713      |                   | 456        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 0          | MYR               | 2          |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
| BSH          | 07/2026           |                 | 16         | NZD               | 27         |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 59         | ¥                 | 9 435      |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 606        | MXN               | 10 672     |                    | 3  |                       | 0     |                                         | 3                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 456        | PLN               | 1 713      |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 910      | \$                | 1 327      |                    | 3  |                       | 0     |                                         | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 14 316     | €                 | 12 279     |                    | 0  |                       | (279) |                                         | (279)               | (0,03) |
|              | 07/2026           |                 | 5 854      | ¥                 | 930 715    |                    | 0  |                       | (127) |                                         | (127)               | (0,01) |
|              | 08/2026           |                 | 1 326      | AUD               | 1 910      |                    | 0  |                       | (3)   |                                         | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             | 365        | \$                | 107        |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 29         | CLP               | 26 138     |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           |                 | 309        | DKK               | 1 982      |                    | 0  |                       | (6)   |                                         | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 337        | €                 | 289        |                    | 0  |                       | (7)   |                                         | (7)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 606        | IDR               | 10 785 874 |                    | 0  |                       | (5)   |                                         | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 36         | PEN               | 122        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 588        | SEK               | 5 430      |                    | 0  |                       | (27)  |                                         | (27)                | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 106        | PEN               | 365        |                    | 1  |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 76         | CNH               | 514        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 63         | \$                | 48         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 16         | AUD               | 22         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 14 085     | CNY               | 95 568     |                    | 0  |                       | (33)  |                                         | (33)                | 0,00   |
| CIB DUB      | 07/2026           |                 | 31         | NOK               | 291        |                    | 0  |                       | (2)   |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 48         | SGD               | 63         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 883        | \$                | 613        |                    | 1  |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CLP             | 52 275     |                   | 57         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 25 473     |                   | 3 745      |                    | 0  |                       | (8)   |                                         | (8)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 6 918      |                   | 7 890      |                    | 0  |                       | (19)  |                                         | (19)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 2 033 671  |                   | 12 569     |                    | 57 |                       | 0     |                                         | 57                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | NZD             | 37         |                   | 21         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 3 232      |                   | 333        |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 205        |                   | 158        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
| FAR          | 07/2026           | \$              | 135        | AUD               | 189        |                    | 0  |                       | (4)   |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 119      | CNH               | 7 573      |                    | 0  |                       | (3)   |                                         | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 320        | ¥                 | 51 062     |                    | 0  |                       | (6)   |                                         | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 5          | MXN               | 79         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 36         | PEN               | 122        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 298        | SGD               | 381        |                    | 0  |                       | (4)   |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | CNH             | 798        | \$                | 118        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ¥               | 13 502     |                   | 84         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 613        | AUD               | 883        |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 57         | CLP               | 52 275     |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
| GLM          | 08/2026           |                 | 3 745      | CNH               | 25 417     |                    | 7  |                       | 0     |                                         | 7                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 7 901      | €                 | 6 918      |                    | 20 |                       | 0     |                                         | 20                  | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 12 569     | ¥                 | 2 028 350  |                    | 0  |                       | (56)  |                                         | (56)                | (0,01) |
|              | 08/2026           |                 | 21         | NZD               | 37         |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 333        | SEK               | 3 226      |                    | 1  |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 158        | SGD               | 204        |                    | 0  |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 6 514      | \$                | 4 578      |                    | 0  |                       | (14)  |                                         | (14)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 29         | CLP               | 26 138     |                    | 0  |                       | (1)   |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 4 578      | CAD               | 6 505      |                    | 14 |                       | 0     |                                         | 14                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 421        | \$                | 290        |                    | 0  |                       | (2)   |                                         | (2)                 | 0,00   |
| MBC          | 07/2026           | €               | 27 123     |                   | 30 809     |                    | 1  |                       | (202) |                                         | (201)               | (0,02) |
|              | 07/2026           | IDR             | 10 785 874 |                   | 600        |                    | 0  |                       | (2)   |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 369        |                   | 211        |                    | 1  |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 25 244     |                   | 756        |                    | 0  |                       | (3)   |                                         | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 52         | AUD               | 72         |                    | 0  |                       | (2)   |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 942        | CHF               | 738        |                    | 0  |                       | (27)  |                                         | (27)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 127        | €                 | 110        |                    | 0  |                       | (2)   |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 302        | ILS               | 850        |                    | 0  |                       | (17)  |                                         | (17)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 187      | ¥                 | 983 319    |                    | 0  |                       | (137) |                                         | (137)               | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 75         | NOK               | 691        |                    | 0  |                       | (5)   |                                         | (5)                 | 0,00   |
| 07/2026      |                   | 499             | PLN        | 1 815             |            | 0                  |    | (16)                  |       | (16)                                    | 0,00                |        |
| 08/2026      |                   | 290             | AUD        | 421               |            | 2                  |    | 0                     |       | 2                                       | 0,00                |        |
| 08/2026      |                   | 30 677          | €          | 26 973            |            | 203                |    | 0                     |       | 203                                     | 0,02                |        |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |        | Devise à recevoir |            | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |         | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|--------|-------------------|------------|--------------------|-----|-----------------------|---------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| MYI          | 08/2026           | \$              | 599    | IDR               | 10 785 874 | \$                 | 1   | \$                    | 0       | \$                                      | 1                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 211    | NZD               | 369        |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 757    | THB               | 25 244     |                    | 5   |                       | 0       |                                         | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CZK             | 5 091  | \$                | 239        |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 7 890  |                   | 49         |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
| NSL          | 07/2026           | \$              | 244    | CZK               | 5 089      |                    | 0   |                       | (4)     |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 239    |                   | 5 090      |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 39     | \$                | 51         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 44     |                   | 34         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 51     | £                 | 39         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
| RYL          | 08/2026           |                 | 34     | SGD               | 44         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 78     | CNH               | 525        |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 38     | PLN               | 138        |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           | CNH             | 421    | \$                | 62         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 4 812  |                   | 6 369      |                    | 0   |                       | (17)    |                                         | (17)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 0      | ¥                 | 17         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 36     | PEN               | 122        |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ¥               | 17     | \$                | 0          |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
| SSB          | 08/2026           | \$              | 6 368  | £                 | 4 812      | 18                 | 0   |                       | 0       | 18                                      | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | CAD             | 60     | \$                | 42         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 13 578 |                   | 84         |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | MYR             | 2 773  |                   | 678        |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 4 757  | CAD               | 6 559      |                    | 0   |                       | (133)   |                                         | (133)               | (0,01) |
| UAG          | 07/2026           |                 | 257    | €                 | 225        |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 703    | MYR               | 2 775      |                    | 0   |                       | (23)    |                                         | (23)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 225    | \$                | 257        |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 42     | CAD               | 60         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 678    | MYR               | 2 772      |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             | 240    | \$                | 64         |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 116    | HUF               | 35 602     |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 623  | KRW               | 2 453 573  |                    | 0   |                       | (38)    |                                         | (38)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 618    | MXN               | 10 731     |                    | 0   |                       | (4)     |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 64     | PLN               | 240        |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 737    | \$                | 913        |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 913    | CHF               | 734        |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              |                   |                 |        |                   |            | \$                 | 356 | \$                    | (1 913) | \$                                      | (1 557)             | (0,14) |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

Au 30 juin 2020, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la catégorie Institutions en LCR (sovereign) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$              | 12 283 €          | 10 543             | \$ 0                  | \$ (229)                                | (0,02)              |
| BSH          | 07/2026           |                 | 11 608            | 9 956              | 0                     | (226)                                   | (0,02)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 155               | 133                | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | 9 999 \$          | 11 404             | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$              | 11 419 €          | 9 999              | 28                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 10 835 \$         | 12 307             | 0                     | (81)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 574 €             | 495                | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | €               | 14 \$             | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 12 323 €          | 10 835             | 81                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 10 835 \$         | 12 325             | 0                     | (63)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 12 299 €          | 10 543             | 0                     | (245)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           |                 | 12 342            | 10 835             | 63                    | 0                                       | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 172             | \$ (883)              | \$ (711)                                | (0,07)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 10 150 0,96

| DESCRIPTION                        | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>    |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim         | \$ 1 400                      | \$ 494                     | 0,05                |
| Total des Autres actifs financiers |                               | \$ 494                     | 0,05                |

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

|                                                                |        |          |        |
|----------------------------------------------------------------|--------|----------|--------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |        |          |        |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |        |          |        |
| 2,000 % éch. 01/07/2041                                        |        | (14 031) | (1,32) |
| 2,000 % éch. 01/08/2056                                        | 83 250 | (66 470) | (6,26) |
| 2,500 % éch. 01/08/2056                                        | 5 200  | (4 344)  | (0,41) |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 8 500  | (7 408)  | (0,70) |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 8 500  | (7 707)  | (0,73) |
| 5,500 % éch. 01/09/2056                                        | 15 890 | (15 907) | (1,50) |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 10 375 | (10 564) | (0,99) |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 (i)                                    | 300    | (310)    | (0,03) |

Total des Titres vendus à découvert

\$ (126 741) (11,94)

Total des Investissements

\$ 1 292 402 121,71

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (230 511) (21,71)

Actif net

\$ 1 061 891 100,00



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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.  
 ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.  
 (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).  
 (b) Titre vendu avant l'émission.  
 (c) Titre à coupon zéro.  
 (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.  
 (e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.  
 (f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.  
 (g) Affilié au Fonds.  
 (h) Titre convertible conditionnel.  
 (i) Le titre vendu à découvert au 30 juin 2026 est couvert par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.  
 (j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,22 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| CIMA Luxembourg SARL                                | 4,979 % | 01/04/2027      | 08/05/2025   | \$ 2 143 | \$ 2 187     | 0,21                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804   | 20/04/2033      | 13/04/2026   | 2 800    | 2 795        | 0,26                |
|                                                     |         |                 |              | \$ 4 943 | \$ 4 982     | 0,47                |

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 45 464 \$ (31 décembre 2025 : 80 320 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 26 076 \$ (31 décembre 2025 : 18 695 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 3 240 \$ (31 décembre 2025 : 11 350 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 1 366 530                                         | \$ 15 309                                         | \$ 1 381 839        |
| Fonds d'investissement                        | 26 964                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 26 964              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 337                                                                             | 8 509                                                | 0                                                 | 9 846               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 494                                                  | 0                                                 | 494                 |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (126 741)                                            | 0                                                 | (126 741)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 28 301</b>                                                                  | <b>\$ 1 248 792</b>                                  | <b>\$ 15 309</b>                                  | <b>\$ 1 292 402</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 1 372 063                                         | \$ 12 902                                         | \$ 1 384 965        |
| Fonds d'investissement                        | 57 622                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 57 622              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 925                                                                               | (17 044)                                             | 28                                                | (16 091)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 413                                                  | 0                                                 | 413                 |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (126 155)                                            | 0                                                 | (126 155)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 58 547</b>                                                                  | <b>\$ 1 229 277</b>                                  | <b>\$ 12 930</b>                                  | <b>\$ 1 300 754</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| CIB                                           | 3,710 %        | 04/06/2026        | 16/07/2026      | \$ (10 262)      | \$ (10 290)                              | (0,97)              |
| DEU                                           | 3,680          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (1 176)          | (1 176)                                  | (0,11)              |
|                                               | 3,710          | 10/06/2026        | 01/07/2026      | (8 499)          | (8 517)                                  | (0,80)              |
|                                               | 3,750          | 29/06/2026        | 06/07/2026      | (836)            | (836)                                    | (0,08)              |
|                                               | 3,750          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (4 965)          | (4 965)                                  | (0,47)              |
| JPS                                           | 3,760          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (3 367)          | (3 367)                                  | (0,32)              |
|                                               | 3,720          | 22/06/2026        | 06/07/2026      | (12 562)         | (12 574)                                 | (1,18)              |
|                                               | 3,740          | 23/06/2026        | 07/07/2026      | (4 080)          | (4 084)                                  | (0,38)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (45 809)</b>                       | <b>(4,31)</b>       |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 485                                                     | \$ (570)                | \$ (85)                           | \$ 2                                                       | \$ 0                    | \$ 2                              |
| BOA          | (247)                                                      | 270                     | 23                                | 1                                                          | (60)                    | (59)                              |
| BPS          | (674)                                                      | 950                     | 276                               | (1 339)                                                    | 1 240                   | (99)                              |
| BRC          | 379                                                        | (440)                   | (61)                              | 322                                                        | (430)                   | (108)                             |
| BSH          | (561)                                                      | 560                     | (1)                               | (351)                                                      | 480                     | 129                               |
| CBK          | 830                                                        | (560)                   | 270                               | 267                                                        | 0                       | 267                               |
| DUB          | (129)                                                      | 0                       | (129)                             | (189)                                                      | 0                       | (189)                             |
| FAR          | 1 481                                                      | (1 480)                 | 1                                 | (2 197)                                                    | 2 480                   | 283                               |
| GLM          | 874                                                        | (900)                   | (26)                              | 198                                                        | (270)                   | (72)                              |
| GST          | 426                                                        | (450)                   | (24)                              | 28                                                         | 0                       | 28                                |
| IND          | 13                                                         | 0                       | 13                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 1 580                                                      | (1 820)                 | (240)                             | (175)                                                      | 0                       | (175)                             |
| MBC          | 359                                                        | (440)                   | (81)                              | (1 352)                                                    | 1 260                   | (92)                              |
| MYC          | (145)                                                      | 10                      | (135)                             | (162)                                                      | 10                      | (152)                             |
| MYI          | (408)                                                      | 420                     | 12                                | (2 349)                                                    | 2 570                   | 221                               |
| NSL          | 48                                                         | 0                       | 48                                | (43)                                                       | 0                       | (43)                              |
| RYL          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| SCX          | (111)                                                      | 0                       | (111)                             | (207)                                                      | 0                       | (207)                             |
| SOG          | 6 409                                                      | (6 520)                 | (111)                             | (3 117)                                                    | 3 310                   | 193                               |
| SSB          | 681                                                        | (560)                   | 121                               | 35                                                         | 0                       | 35                                |
| UAG          | (1 139)                                                    | 1 030                   | (109)                             | (127)                                                      | 0                       | (127)                             |

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

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 34,49            | 32,50                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 28,03            | 26,21                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,78             | 0,66                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,24             | 2,47                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,16             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,55             | 0,43                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,96             | 0,22                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,02             | 0,02                 |
| Autres actifs                                                    | 33,77            | 37,41                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 5,65             | 5,02                 |
| Belgique                          | 0,43             | 0,46                 |
| Bulgarie                          | 0,23             | 0,30                 |
| Canada                            | 5,35             | 5,98                 |
| Îles Caïmans                      | 2,04             | 1,76                 |
| Chili                             | 0,07             | 0,08                 |
| Chine                             | 7,70             | 7,63                 |
| Colombie                          | 1,22             | 1,04                 |
| Costa Rica                        | 0,20             | 0,18                 |
| République tchèque                | 0,45             | 0,22                 |
| Danemark                          | 0,46             | 0,38                 |
| Égypte                            | 0,20             | 0,21                 |
| Finlande                          | 0,54             | 0,31                 |
| France                            | 4,63             | 4,82                 |
| Allemagne                         | 0,69             | 0,57                 |
| Hongrie                           | 0,30             | 0,31                 |
| Irlande                           | 4,02             | 2,92                 |
| Israël                            | 1,20             | 1,28                 |
| Italie                            | 0,39             | 0,27                 |
| Japon                             | 4,22             | 5,05                 |
| Kazakhstan                        | 0,05             | 0,05                 |
| Koweït                            | 0,58             | 0,49                 |
| Luxembourg                        | 0,84             | 0,88                 |
| Malaisie                          | 1,56             | 1,63                 |
| Mexique                           | 0,03             | 0,03                 |
| Multinationales                   | 0,03             | 0,03                 |
| Pays-Bas                          | 1,00             | 0,86                 |
| Nouvelle-Zélande                  | 0,03             | 0,03                 |
| Norvège                           | 0,29             | 0,30                 |
| Pérou                             | 2,21             | 1,81                 |
| Pologne                           | 0,03             | 0,06                 |
| Portugal                          | 0,03             | 0,03                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Qatar                                                                                                    | 0,25             | 0,04                 |
| Roumanie                                                                                                 | 0,60             | 1,15                 |
| Arabie saoudite                                                                                          | 0,51             | 0,61                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,14             | 0,14                 |
| Singapour                                                                                                | 0,93             | 0,98                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 2,04             | 1,62                 |
| Corée du Sud                                                                                             | 1,92             | 1,89                 |
| Espagne                                                                                                  | 3,69             | 4,55                 |
| Supranationales                                                                                          | 1,74             | 1,14                 |
| Suède                                                                                                    | 0,07             | 0,08                 |
| Suisse                                                                                                   | 1,05             | 1,18                 |
| Thaïlande                                                                                                | 0,78             | 1,28                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,73             | 0,13                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 9,88             | 9,34                 |
| États-Unis                                                                                               | 57,19            | 63,52                |
| Instruments à court terme                                                                                | 1,94             | 2,08                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 2,54             | 5,61                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,22             | 0,07                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,08)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,18)           | (0,60)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,17             | 0,07                 |
| Swaps sur devises croisées                                                                               | 0,06             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,01             | (0,02)               |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | (0,03)           | (0,01)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,98             | (1,16)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,21)           | 0,06                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,05             | 0,04                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (11,94)          | (12,27)              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (21,71)          | (26,53)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Opportunities Fund

[illegible]

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                                 | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                                    | Garantie (reçue)  | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                          | 3,690 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 2 500             | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,875 % éch. 15/07/2035 | \$ (2 539)        | \$ 2 500                                 | \$ 2 500                                                           | 16,78               |
|                                              | 3,700        | 30/06/2026        | 01/07/2026      | 2 800                | Ginnie Mae 4,000 % éch. 20/01/2049                                             | (3 050)           | 2 800                                    | 2 800                                                              | 18,79               |
| <b>Total des Contrats de mise en pension</b> |              |                   |                 |                      |                                                                                | <b>\$ (5 589)</b> | <b>\$ 5 300</b>                          | <b>\$ 5 300</b>                                                    | <b>35,57</b>        |

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

**CONTRATS À TERME STANDARDISÉS**

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                       | Long  | 12/2026           | 15                 | \$ 5                                    | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre           | Court | 09/2026           | 3                  | 0                                       | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026           | 1                  | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026           | 6                  | (4)                                     | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 9                  | 7                                       | 0,05                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 10                 | (12)                                    | (0,08)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 9                  | (7)                                     | (0,05)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026           | 8                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026           | 3                  | 4                                       | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 2                  | 1                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 10                 | 3                                       | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 5                  | 2                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 1                  | 1                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026           | 4                  | 1                                       | 0,01                   |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ (1)                                  | (0,01)                 |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>                 |       |                   |                    | <b>\$ (1)</b>                           | <b>(0,01)</b>          |

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)**

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

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>**

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans            | (1,000) %              | 20/06/2036         | \$ 1 050                            | \$ 0                                    | 0,00                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | (1,000)                | 20/06/2031         | € 350                               | 0                                       | 0,00                   |
|                                            |                        |                    |                                     | \$ 0                                    | 0,00                   |

**SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>**

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 13 050                           | \$ 0                                    | 0,00                   |

**SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT**

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 16/09/2028         | £ 3 450              | \$ 6                                    | 0,04                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031         | 550                  | 1                                       | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036         | 600                  | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056         | 50                   | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                                | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 17/06/2028         | ¥ 454 350            | (1)                                     | 0,00                   |
| À payer                                                   | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 17/06/2031         | 71 400               | 0                                       | 0,00                   |
| À payer                                                   | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 17/06/2036         | 133 500              | (2)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir                                                | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,750     | 17/06/2056         | 25 350               | 2                                       | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031         | SGD 1 700            | (8)                                     | (0,05)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 16/09/2031         | THB 3 500            | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 16/09/2031         | 2 800                | 1                                       | 0,01                   |
| À recevoir                                                | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028         | \$ 150               | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 16/09/2028         | 550                  | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                                | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031         | 100                  | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 16/09/2031         | 150                  | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                                | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036         | 650                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036         | 1 700                | (4)                                     | (0,03)                 |
| À recevoir                                                | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056         | 250                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 16/09/2056         | 600                  | (1)                                     | 0,00                   |
| À payer                                                   | CDI BRL à un an                   | 12,970    | 02/01/2029         | BRL 4 200            | 10                                      | 0,07                   |
| À recevoir                                                | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031         | CAD 300              | (1)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 16/09/2031         | 400                  | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 16/09/2056         | 50                   | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois  | 0,250     | 16/09/2031         | CHF 380              | 1                                       | 0,01                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/12/2028         | NZD 1 150            | 1                                       | 0,01                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 16/09/2029         | 100                  | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR NZD à 3 mois                  | 4,000     | 16/12/2031         | 300                  | 1                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | STIBOR SEK à 3 mois               | 2,750     | 16/09/2031         | SEK 5 750            | 4                                       | 0,03                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 16/09/2031         | AUD 1 750            | 6                                       | 0,04                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2036         | 300                  | 2                                       | 0,01                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028         | € 2 200              | 3                                       | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031         | 150                  | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                                    | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036         | 925                  | 10                                      | 0,07                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                                 | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056         | 330                  | (6)                                     | (0,04)                 |
| À payer                                                   | NIBOR NOK à 6 mois                | 3,750     | 18/03/2031         | NOK 5 150            | 1                                       | 0,00                   |
|                                                           |                                   |           |                    | \$ 23                |                                         | 0,16                   |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés compensés</b> |                                   |           |                    | <b>\$ 23</b>         |                                         | <b>0,16</b>            |

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

## Tableau des investissements Fonds Global Bond Opportunities Fund (suite)

- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | KRW 3 033       | \$ 2              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 324 990     | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 11           | INR 1 033         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 1 221         | \$ 1 399          | 4                  | (1)                   | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | HUF 13 116      | 42                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 3 100         | 19                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 19          | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 197         | 152               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 43           | HUF 13 180        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9               | ¥ 1 500           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 133         | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 17          | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 1 742 089   | 502               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,04                |
|              | 09/2026           | IDR 91 611      | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 5            | IDR 92 234        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 24          | \$ 19             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 24           | HUF 7 311         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 34              | TRY 1 599         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ZAR 693         | \$ 42             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 202          | BRL 1 047         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 180             | NZD 318           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
| CBK          | 08/2026           | NZD 318         | \$ 180            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD 14          | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 15          | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 151           | 200               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 141          | BRL 718           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 7               | PLN 25            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 35              | SEK 330           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR 149         | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 483         | 62                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 55 947      | 16                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 331 252     | 18                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 58          | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 131          | MXN 2 286         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 12/2026           | 18              | IDR 333 474       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9               | PLN 35            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 14              | SGD 18            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 18          | \$ 14             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 691         | 203               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
| FAR          | 09/2026           | \$ 114          | INR 10 801        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 91            | \$ 122            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SEK 500         | 52                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 44           | € 39              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 86              | ¥ 13 898          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 11              | PLN 40            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 39            | \$ 45             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 13 862        | 86                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 52           | SEK 499           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 401         | \$ 118            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | BRL 1 885       | 364               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 160          | CAD 228           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 12              | PLN 44            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 227         | \$ 160            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 4            | IDR 62 902        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 15              | MXN 259           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | 364             | BRL 1 927         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 77          | \$ 54             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF 40          | 50                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 643           | 745               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,07                |
|              | 07/2026           | £ 53            | 71                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW 30 303      | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 99          | 58                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SEK 305         | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MYI          | 07/2026           | SGD 118         | \$ 92             | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 287          | AUD 416           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | 5               | HUF 1 454         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 26              | KRW 40 042        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5               | NOK 48            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8               | ZAR 138           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 2 460       | \$ 149            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | AUD 416         | 287               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | NOK 48          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 31           | SEK 305           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 400           | \$ 462            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | NOK 50          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 0           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 19           | £ 14              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 41              | ¥ 6 600           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 73              | PLN 271           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 53              | SEK 510           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 9               | INR 855           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 79              | TRY 3 727         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RBC          | 07/2026           | SGD 29          | \$ 22             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | CAD 141         | 100               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | NZD 176         | 101               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 78          | 56                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | NZD 24          | 14                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 100         | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 79          | 56                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF 39          | 48                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | \$ 233          | AUD 337           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | 98              | CHF 79            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 706           | € 2 379           | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,09                |
|              | 07/2026           | 262             | SGD 339           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 337         | \$ 233            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CHF 79          | 98                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 2 379         | 2 710             | 0                  | (15)                  | (15)                                    | (0,09)              |
|              | 08/2026           | SGD 339         | 262               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 49           | INR 4 689         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 74              | MXN 1 290         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD 202         | \$ 141            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW 66 490      | 43                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23           | BRL 115           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | CAD 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 469             | £ 355             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 2           | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | £ 355           | 469               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR 180 854     | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 49           | IDR 882 579       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 6               | INR 575           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 381         | \$ 267            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | € 154           | 176               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 90            | 120               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ¥ 18 900        | 117               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 21           | £ 16              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | PLN 35            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 66              | \$ (36)               | \$ 30                                   | 0,21                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BSH          | 07/2026           | \$ 82           | CHF 65            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | (0,01)              |
| MYI          | 07/2026           | 82              | 65                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 2               | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 67          | \$ 82             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 82           | CHF 66            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,01                |
| UAG          | 07/2026           | 82              | 65                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 0               | \$ (4)                | \$ (4)                                  | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | € 68            | \$ 78             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 82           | € 71              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 78              | 68                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | € 73            | \$ 83             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 83           | € 72              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
| SOG          | 08/2026           | 84              | 74                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 73            | \$ 83             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | \$ 83           | € 73              | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 82              | 71                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 2               | \$ (4)                | \$ (2)                                  | (0,02)              |



## Tableau des investissements Fonds Global Bond Opportunities Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | £ 52            | \$ 68             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 68              | 52                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 82              | 61                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £ 0             | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | \$ 0            | £ 0               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 84              | 63                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 82              | 61                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 12            | \$ 16             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           | \$ 16           | £ 12              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 60            | \$ 80             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 08/2026           | \$ 80           | £ 60              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 60            | \$ 80             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | \$ 80           | £ 60              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (3)                | \$ (2)                                  | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | NOK 763         | \$ 77             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 81           | NOK 768           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 78              | 780               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 81              | 768               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 81              | 768               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 0               | \$ (9)                | \$ (9)                                  | (0,06)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 07/2026           | \$ 82           | SEK 769           | \$ 0               | \$ (3)                | \$ (3)                                  | (0,02)              |
|              | 07/2026           | SEK 469         | \$ 48             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | \$ 48           | SEK 469           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 709         | \$ 73             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | \$ 73           | SEK 708           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | 82              | 769               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,02)              |
| MYI          | 07/2026           | 82              | 769               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 82              | 769               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (8)                | \$ (7)                                  | (0,05)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | SGD 47          | \$ 37             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | SGD 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 37              | 47                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SGD 58          | \$ 44             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 44           | SGD 57            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 58          | \$ 44             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 44           | SGD 57            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
| MBC          | 07/2026           | 82              | 106               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | SGD 11          | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           | \$ 9            | SGD 11            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 112         | \$ 86             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 82           | SGD 106           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 86              | 111               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 82              | 106               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (3)                | \$ (2)                                  | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 1            | RON 5             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15              | AUD 22            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 09/2026           | IDR 6 456       | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 0            | IDR 6 500         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 07/2026           | \$ 4            | MYR 17            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2               | SGD 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | AUD 12          | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 8            | AUD 12            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 29              | CAD 40            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 40              | £ 30              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | KRW 15 000        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | PLN 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 27 678      | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1            | CLP 565           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 2               | IDR 27 864        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 1               | PLN 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4               | THB 121           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD 5           | \$ 4              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 713         | 105               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 12 129        | 75                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 0           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 21          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | PLN 6             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 4               | AUD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 105             | CNH 711           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 75              | ¥ 12 097          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | NZD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | SEK 21            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GSC          | 07/2026           | CAD 39          | \$ 27             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 27           | CAD 39            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1               | PEN 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 4           | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 11          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 9           | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 3           | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 13          | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | CZK 34            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 234             | € 202             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 4               | SEK 36            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3               | AUD 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | DKK 11            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1               | NOK 9             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | NZD 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1               | SEK 13            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 76              | ¥ 12 130          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 1               | NOK 9             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | ILS 6             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 4               | MXN 68            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | 1               | HUF 284           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 29            | \$ 38             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2            | NZD 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 38              | £ 29              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD 1           | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 5           | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 202           | 230               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £ 1             | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 3           | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1            | AUD 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 6               | CHF 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 230             | € 202             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | 2               | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2               | SGD 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 0           | \$ 0              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 106          | CNH 713           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 2               | DKK 14            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | CAD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 4               | IDR 66 728        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | 6               | CHF 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | PLN 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (8)                | \$ (7)                                  | (0,05)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (3) (0,02)

## TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 2,000 % éch. 01/08/2056                                        | \$ 1 200                      | \$ (958)                   | (6,43)              |
| 6,000 % éch. 01/08/2056                                        | 150                           | (153)                      | (1,03)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | \$ (1 111)                 | (7,46)              |
| Total des Investissements                                      |                               | \$ 20 575                  | 138,08              |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | \$ (5 674)                 | (38,08)             |
| Actif net                                                      |                               | \$ 14 901                  | 100,00              |

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

Un montant en numéraire de 591 \$ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 16 367                                            | \$ 0                                              | \$ 16 367        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 5 300                                                | 0                                                 | 5 300            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (8)                                                                               | 27                                                   | 0                                                 | 19               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (1 111)                                              | 0                                                 | (1 111)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (8)</b>                                                                     | <b>\$ 20 583</b>                                     | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 20 575</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026<sup>(1)</sup> :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(2)</sup> |
| BPS          | \$ 9                                                       | \$ 0                    | \$ 9                              |
| BRC          | (5)                                                        | 0                       | (5)                               |
| CBK          | (8)                                                        | 0                       | (8)                               |
| DUB          | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| FAR          | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| MBC          | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| MYI          | (6)                                                        | 0                       | (6)                               |
| RYL          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               |
| SCX          | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| SOG          | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| SSB          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               |
| UAG          | 3                                                          | 0                       | 3                                 |

<sup>(1)</sup> Le Fonds Global Bond Opportunities Fund a été lancé le 10 juin 2026.

<sup>(2)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026<sup>(1)</sup> en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 29,75            |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 29,86            |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,14             |
| Contrats de mise en pension                                      | 19,35            |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,09             |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,18             |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,26             |
| Autres actifs                                                    | 20,37            |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

<sup>(1)</sup> Le Fonds Global Bond Opportunities Fund a été lancé le 10 juin 2026.

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>            |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>AUSTRALIE</b>                     |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Fortescue Treasury Pty. Ltd.         |                                     |                                  |                           | Lower Ferry Re Ltd.                  |                                     |                                  |                           | Northriver Midstream Finance LP                    |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 01/04/2031              | \$ 617                              | \$ 588                           | 0,02                      | 6,510 % éch. 08/07/2033              | \$ 500                              | \$ 500                           | 0,02                      | 6,750 % éch. 15/07/2032                            | \$ 1 800                            | \$ 1 824                         | 0,07                      |
| 4,500 % éch. 15/09/2027              | 3 507                               | 3 482                            | 0,14                      | Luca RE Ltd.                         |                                     |                                  |                           | NOVA Chemicals Corp.                               | 2 000                               | 2 003                            | 0,08                      |
| 5,875 % éch. 15/04/2030              | 662                                 | 671                              | 0,03                      | 10,800 % éch. 22/07/2031             | 250                                 | 260                              | 0,01                      | 5,250 % éch. 01/06/2027                            |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/04/2032              | 815                                 | 838                              | 0,04                      | MMIFS RE Ltd.                        |                                     |                                  |                           | Ontario Gaming GTA LP                              |                                     |                                  |                           |
| Mineral Resources Ltd.               |                                     |                                  |                           | 5,161 % éch. 10/01/2033              | CAD 250                             | 178                              | 0,01                      | 8,000 % éch. 01/08/2030                            | 675                                 | 669                              | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 01/05/2032              | 3 100                               | 3 069                            | 0,13                      | Nature Coast Re Ltd.                 |                                     |                                  |                           | Open Text Corp.                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 01/05/2034              | 2 775                               | 2 730                            | 0,11                      | 11,789 % éch. 26/02/2030             | \$ 250                              | 252                              | 0,01                      | 3,875 % éch. 15/02/2028                            | 1 875                               | 1 828                            | 0,08                      |
| 7,000 % éch. 01/04/2031              | 50                                  | 52                               | 0,00                      | NCL Corp. Ltd.                       |                                     |                                  |                           | Precision Drilling Corp.                           |                                     |                                  |                           |
| PLS Group Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 15/02/2029              | 500                                 | 522                              | 0,02                      | 6,875 % éch. 15/01/2029                            | 675                                 | 679                              | 0,03                      |
| 6,875 % éch. 01/05/2031              | 125                                 | 128                              | 0,01                      | Odfeil Rig Ltd.                      |                                     |                                  |                           | Rogers Communications, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| Total Australie                      |                                     | 11 558                           | 0,48                      | 7,250 % éch. 08/03/2031              | 4 025                               | 4 136                            | 0,17                      | 7,000 % éch. 15/04/2055                            | 450                                 | 461                              | 0,02                      |
| <b>AUTRICHE</b>                      |                                     |                                  |                           | Palm RE Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/04/2055                            | 650                                 | 668                              | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | 13,220 % éch. 09/06/2031             | 250                                 | 258                              | 0,01                      | Skeena Resources Ltd.                              |                                     |                                  |                           |
| ams-OSRAM AG                         |                                     |                                  |                           | Purple Re Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 01/04/2031                            | 1 000                               | 1 051                            | 0,04                      |
| 7,250 % éch. 31/05/2032              | € 12 870                            | 15 186                           | 0,63                      | 12,676 % éch. 06/06/2031             | 300                                 | 308                              | 0,01                      |                                                    |                                     | 49 602                           | 2,05                      |
| Constantia Flexibles GmbH            |                                     |                                  |                           | Seadrill Finance Ltd.                |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>             |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/07/2032 (a)          | 500                                 | 580                              | 0,02                      | 8,375 % éch. 01/08/2030              | 8 175                               | 8 576                            | 0,36                      | Bausch Health Cos., Inc.                           |                                     |                                  |                           |
| Total Autriche                       |                                     | 15 766                           | 0,65                      | Torrey Pines Re Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 9,894 % éch. 08/10/2030                            | 3 716                               | 3 612                            | 0,15                      |
| <b>BELGIQUE</b>                      |                                     |                                  |                           | 6,539 % éch. 07/06/2033              | 250                                 | 250                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | 6,789 % éch. 07/06/2034              | 250                                 | 252                              | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement canadien |                                     |                                  |                           |
| Manuchar Group SARL                  |                                     |                                  |                           | 7,536 % éch. 07/06/2034              | 250                                 | 251                              | 0,01                      | 2,750 % éch. 01/06/2033                            | CAD 16 275                          | 11 176                           | 0,46                      |
| 7,401 % éch. 07/07/2032              | 4 675                               | 5 329                            | 0,22                      | 9,586 % éch. 07/06/2032              | 250                                 | 257                              | 0,01                      | Total Canada                                       |                                     | 64 390                           | 2,66                      |
| <b>BERMUDES</b>                      |                                     |                                  |                           | 9,810 % éch. 07/06/2034              | 250                                 | 256                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | Transocean International Ltd.        |                                     |                                  |                           | <b>ÎLES CAIMANS</b>                                |                                     |                                  |                           |
| 123 Lights Re Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 15/10/2032              | 4 075                               | 4 256                            | 0,18                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                  |                                     |                                  |                           |
| 14,520 % éch. 14/09/2031             | \$ 250                              | 263                              | 0,01                      | 8,250 % éch. 15/05/2029              | 2 650                               | 2 738                            | 0,11                      | Atlantic Avenue Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
| Alamo Re Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/05/2031              | 1 150                               | 1 195                            | 0,05                      | 5,053 % éch. 15/10/2038                            | \$ 3 500                            | 3 512                            | 0,15                      |
| 9,039 % éch. 07/06/2029              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 8,750 % éch. 15/02/2030              | 1 435                               | 1 492                            | 0,06                      | <b>FINLANDE</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| Armor RE Ltd.                        |                                     |                                  |                           | Tremont Re Ltd.                      |                                     |                                  |                           | Ahlstrom Holding Oy                                |                                     |                                  |                           |
| 12,050 % éch. 07/01/2032             | 250                                 | 264                              | 0,01                      | 7,786 % éch. 22/03/2033              | 250                                 | 249                              | 0,01                      | 4,875 % éch. 04/02/2028                            | 9 100                               | 9 008                            | 0,37                      |
| 13,750 % éch. 07/05/2031             | 250                                 | 260                              | 0,01                      | Ursa Re Ltd.                         |                                     |                                  |                           | <b>FRANCE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| Bayou Re Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 8,510 % éch. 07/12/2029              | 250                                 | 253                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| 11,852 % éch. 30/04/2031             | 250                                 | 258                              | 0,01                      | 11,021 % éch. 22/02/2028             | 250                                 | 258                              | 0,01                      | Atos Group                                         |                                     |                                  |                           |
| 22,020 % éch. 30/04/2031             | 250                                 | 269                              | 0,01                      | 11,260 % éch. 07/06/2028             | 250                                 | 257                              | 0,01                      | 8,125 % éch. 21/05/2031                            | € 900                               | 1 019                            | 0,04                      |
| Blue Ridge Re Ltd.                   |                                     |                                  |                           | Valaris Ltd.                         |                                     |                                  |                           | CAB SELAS                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,020 % éch. 08/01/2029              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 8,375 % éch. 30/04/2030              | 7 300                               | 7 584                            | 0,32                      | 7,750 % éch. 09/08/2031                            | 6 350                               | 7 263                            | 0,30                      |
| 9,520 % éch. 08/01/2029              | 250                                 | 251                              | 0,01                      | Veraison Re Ltd.                     |                                     |                                  |                           | Électricité de France S.A.                         |                                     |                                  |                           |
| 11,520 % éch. 08/01/2029             | 250                                 | 247                              | 0,01                      | 6,421 % éch. 08/03/2034              | 250                                 | 253                              | 0,01                      | 3,375 % éch. 15/06/2030 (e)                        | 7 000                               | 7 751                            | 0,32                      |
| Cape Lookout Re Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 7,671 % éch. 08/03/2034              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Eramet S.A.                                        |                                     |                                  |                           |
| 8,770 % éch. 21/03/2033              | 300                                 | 297                              | 0,01                      | 8,521 % éch. 08/03/2033              | 250                                 | 253                              | 0,01                      | 7,250 % éch. 22/05/2028                            | 1 900                               | 2 206                            | 0,09                      |
| 9,520 % éch. 21/03/2033              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Viking Cruises Ltd.                  |                                     |                                  |                           | HomeVi SASU                                        |                                     |                                  |                           |
| 10,420 % éch. 13/03/2032             | 250                                 | 261                              | 0,01                      | 5,875 % éch. 15/10/2033              | 925                                 | 927                              | 0,04                      | 6,625 % éch. 31/10/2031                            | 4 975                               | 5 787                            | 0,24                      |
| Carnival Corp. Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/02/2029              | 975                                 | 979                              | 0,04                      | iliad S.A.                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 01/05/2029              | 2 875                               | 2 872                            | 0,12                      | 9,125 % éch. 15/07/2031              | 4 634                               | 4 858                            | 0,20                      | 4,250 % éch. 15/12/2029                            | 400                                 | 465                              | 0,02                      |
| 5,750 % éch. 01/08/2032              | 4 300                               | 4 347                            | 0,18                      | VOC Escrow Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 09/01/2032                            | 2 600                               | 2 999                            | 0,13                      |
| Charles River Re Ltd.                |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/02/2028              | 1 325                               | 1 324                            | 0,06                      | 5,375 % éch. 02/05/2031                            | 2 900                               | 3 532                            | 0,15                      |
| 11,152 % éch. 10/05/2031             | 250                                 | 253                              | 0,01                      | Weatherford International Ltd.       |                                     |                                  |                           | Kapla Holding S.A.S.                               |                                     |                                  |                           |
| Citrus Re Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/10/2033              | 8 950                               | 9 137                            | 0,38                      | 5,125 % éch. 30/04/2032                            | 1 100                               | 1 268                            | 0,05                      |
| 10,039 % éch. 07/06/2033             | 500                                 | 507                              | 0,02                      | Windrose Re Ltd.                     |                                     |                                  |                           | 5,199 % éch. 30/04/2033                            | 600                                 | 695                              | 0,03                      |
| Everglades Re Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 8,782 % éch. 11/02/2033              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | New Immo Holding S.A.                              |                                     |                                  |                           |
| 9,289 % éch. 22/05/2033              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Winston RE Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 23/04/2031                            | 5 600                               | 6 432                            | 0,27                      |
| 12,039 % éch. 22/05/2033             | 250                                 | 250                              | 0,01                      | 10,020 % éch. 21/02/2028             | 250                                 | 257                              | 0,01                      | 5,875 % éch. 17/04/2028                            | 4 200                               | 4 917                            | 0,20                      |
| Gateway Re Ltd.                      |                                     |                                  |                           | Total Bermudes                       |                                     | 68 706                           | 2,84                      | Viridien                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,550 % éch. 06/07/2029              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | <b>CANADA</b>                        |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 15/10/2030                           | \$ 1 655                            | 1 759                            | 0,07                      |
| Golar LNG Ltd.                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | Worldline S.A.                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 02/10/2030              | 1 875                               | 1 908                            | 0,08                      | B.C. Ltd.                            |                                     |                                  |                           | 0,875 % éch. 30/06/2027                            | € 1 200                             | 1 308                            | 0,05                      |
| Golden Bear Re Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 15/04/2032             | 8 525                               | 8 640                            | 0,36                      | 4,125 % éch. 12/09/2028                            | 1 300                               | 1 401                            | 0,06                      |
| 13,289 % éch. 08/03/2032             | 250                                 | 252                              | 0,01                      | B.C. Unlimited Liability Co.         |                                     |                                  |                           | Total France                                       |                                     | 48 802                           | 2,02                      |
| 13,300 % éch. 08/01/2029             | 250                                 | 257                              | 0,01                      | 4,000 % éch. 15/10/2030              | 10 950                              | 10 344                           | 0,43                      | <b>ALLEMAGNE</b>                                   |                                     |                                  |                           |
| Greengrove RE Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/01/2028              | 1 300                               | 1 286                            | 0,05                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| 11,270 % éch. 08/04/2032             | 250                                 | 255                              | 0,01                      | Bausch & Lomb Corp.                  |                                     |                                  |                           | Bayer AG                                           |                                     |                                  |                           |
| Herbie Re Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 01/10/2028              | 6 375                               | 6 558                            | 0,27                      | 5,375 % éch. 25/03/2082                            | 4 600                               | 5 431                            | 0,22                      |
| 7,760 % éch. 07/01/2030              | 250                                 | 250                              | 0,01                      | Bombardier, Inc.                     |                                     |                                  |                           | Birkenstock Group BV & Co. KG                      |                                     |                                  |                           |
| Locke Tavern Re Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/01/2035              | 875                                 | 879                              | 0,04                      | 4,500 % éch. 15/06/2033                            | 1 100                               | 1 272                            | 0,05                      |
| 6,800 % éch. 11/04/2033              | 250                                 | 249                              | 0,01                      | 8,750 % éch. 15/11/2030              | 5 175                               | 5 477                            | 0,23                      | Cerdia Finanz GmbH                                 |                                     |                                  |                           |
| 7,800 % éch. 11/04/2033              | 250                                 | 251                              | 0,01                      | Canada Cartage Corp.                 |                                     |                                  |                           | 9,375 % éch. 03/10/2031                            | \$ 1 250                            | 1 123                            | 0,05                      |
| Longleaf Pine Re Ltd.                |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 08/05/2031              | 1 625                               | 1 579                            | 0,06                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 21,453 % éch. 27/05/2031             | 400                                 | 409                              | 0,02                      | GFL Environmental, Inc.              |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/09/2028              | 1 425                               | 1 391                            | 0,06                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/08/2028              | 2 675                               | 2 614                            | 0,11                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | goeasly Ltd.                         |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/05/2030              | 75                                  | 67                               | 0,00                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 01/10/2030              | 1 400                               | 1 262                            | 0,05                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 01/12/2028              | 328                                 | 322                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Chepharm Arzneimittel GmbH<br>6,750 % éch. 15/02/2032                               | € 500                               | \$ 576                           | 0,02                      | Gruppo San Donato SpA<br>6,500 % éch. 31/10/2031 (i)              | € 5 425                             | \$ 6 152                         | 0,25                      | Essendi S.A.<br>5,375 % éch. 15/05/2030                                          | € 4 000                             | \$ 4 676                         | 0,19                      |
| 7,125 % éch. 15/06/2031                                                             | 3 000                               | 3 522                            | 0,15                      | IMA Industria Macchine Automatiche SpA<br>3,750 % éch. 15/01/2028 | 7 175                               | 8 232                            | 0,34                      | 5,500 % éch. 15/11/2031                                                          | 2 925                               | 3 399                            | 0,14                      |
| 7,500 % éch. 15/05/2030 (i)                                                         | 4 125                               | 4 894                            | 0,20                      | Infrastrutture Wireless Italiane SpA<br>3,625 % éch. 13/10/2032   | 4 150                               | 4 556                            | 0,19                      | 6,375 % éch. 15/10/2029                                                          | 800                                 | 951                              | 0,04                      |
| DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH<br>4,875 % éch. 21/08/2030     | 6 600                               | 7 708                            | 0,32                      | 3,750 % éch. 01/04/2030                                           | 5 050                               | 5 718                            | 0,24                      | Froneri Lux FinCo SARL<br>4,750 % éch. 01/08/2032                                | 8 975                               | 10 025                           | 0,41                      |
| IHO Verwaltungs GmbH<br>5,625 % éch. 15/05/2031                                     | 1 500                               | 1 786                            | 0,07                      | Italmatch Chemicals SpA<br>6,250 % éch. 05/02/2031                | 2 000                               | 2 334                            | 0,10                      | Intralot Capital Luxembourg S.A.<br>6,750 % éch. 15/10/2031 (i)                  | 6 125                               | 7 118                            | 0,29                      |
| 7,375 % éch. 15/05/2033                                                             | \$ 4 750                            | 4 942                            | 0,20                      | Kedron SpA<br>6,500 % éch. 01/09/2029                             | \$ 1 975                            | 1 951                            | 0,08                      | LHMC Finco 2 SARL (8,625 % en numéraire ou 9,375 % de<br>rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de<br>rémunération en nature) | 600                                 | 606                              | 0,03                      | Lottomatica Group SpA<br>4,625 % éch. 30/04/2032                  | € 1 200                             | 1 382                            | 0,06                      | 8,625 % éch. 15/05/2030 (b)                                                      | 524                                 | 618                              | 0,02                      |
| 6,375 % éch. 15/05/2029 (b)                                                         | 600                                 | 606                              | 0,03                      | Mundys SpA<br>4,500 % éch. 24/01/2030                             | 700                                 | 824                              | 0,03                      | Maxam Prill SARL<br>6,000 % éch. 15/07/2030                                      | 6 300                               | 7 359                            | 0,30                      |
| IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % en numéraire ou 7,500 % de<br>rémunération en nature) | € 3 825                             | 4 582                            | 0,19                      | Neopharmed Gentili SpA<br>5,543 % éch. 29/06/2033                 | 4 100                               | 4 746                            | 0,20                      | 7,750 % éch. 15/07/2030                                                          | \$ 750                              | 773                              | 0,03                      |
| 6,750 % éch. 15/11/2029 (b)                                                         | € 3 825                             | 4 582                            | 0,19                      | TeamSystem SpA<br>5,000 % éch. 01/07/2031                         | 700                                 | 773                              | 0,03                      | Millicom International Cellular S.A.<br>5,125 % éch. 15/01/2028                  | 1 620                               | 1 611                            | 0,07                      |
| Mahle GmbH<br>7,125 % éch. 15/07/2032 (h)                                           | 900                                 | 1 086                            | 0,05                      | 5,454 % éch. 01/07/2032 (i)                                       | 3 200                               | 3 602                            | 0,15                      | Motion Finco SARL<br>8,375 % éch. 15/02/2032                                     | 775                                 | 655                              | 0,03                      |
| Nidda Healthcare Holding GmbH<br>5,625 % éch. 21/02/2030                            | 6 555                               | 7 611                            | 0,32                      | 5,704 % éch. 31/07/2031                                           | 900                                 | 1 023                            | 0,04                      | NJJ Continental SA<br>4,500 % éch. 30/01/2030                                    | € 860                               | 1 001                            | 0,04                      |
| Schaeffler AG<br>4,125 % éch. 13/05/2029                                            | 5 200                               | 5 984                            | 0,25                      | Telecom Italia SpA<br>7,875 % éch. 31/07/2028                     | 925                                 | 1 144                            | 0,05                      | SK Invictus Intermediate SARL<br>5,000 % éch. 30/10/2029                         | \$ 950                              | 932                              | 0,04                      |
| 5,000 % éch. 13/05/2033                                                             | 4 900                               | 5 677                            | 0,23                      | Total Italie                                                      |                                     | 72 358                           | 2,99                      | Telecom Italia Capital S.A.<br>6,375 % éch. 15/11/2033                           | 1 600                               | 1 675                            | 0,07                      |
|                                                                                     |                                     | 56 800                           | 2,35                      |                                                                   |                                     |                                  |                           | Total Luxembourg                                                                 |                                     | 56 793                           | 2,35                      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS                                                     |                                     |                                  |                           | JAPON                                                             |                                     |                                  |                           | ÎLES MARSHALL                                                                    |                                     |                                  |                           |
| TK Elevator Midco GmbH<br>5,149 % éch. 30/04/2030                                   | 4 600                               | 5 292                            | 0,22                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                    |                                     |                                  |                           |
| Total Allemagne                                                                     |                                     | 62 092                           | 2,57                      | Nissan Motor Co. Ltd.<br>4,345 % éch. 17/09/2027                  | \$ 675                              | 664                              | 0,03                      | Danaos Corp.<br>6,875 % éch. 15/10/2032                                          | 600                                 | 620                              | 0,03                      |
| IRLANDE                                                                             |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 17/07/2029                                           | € 900                               | 1 046                            | 0,04                      | MEXIQUE                                                                          |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                       |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 17/07/2032                                           | \$ 1 225                            | 1 270                            | 0,05                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                    |                                     |                                  |                           |
| Jazz Securities DAC<br>4,375 % éch. 15/01/2029                                      | \$ 25                               | 24                               | 0,00                      | 8,125 % éch. 17/07/2035                                           | 325                                 | 344                              | 0,01                      | BBVA Bancomer S.A.<br>8,125 % éch. 08/01/2039 (g)                                | 2 475                               | 2 641                            | 0,11                      |
| Perrigo Finance Unlimited Co.<br>4,900 % éch. 15/12/2044                            | 775                                 | 570                              | 0,03                      | Rakuten Group, Inc.<br>8,125 % éch. 15/12/2029 (e)                | 1 625                               | 1 669                            | 0,07                      | MULTINATIONALES                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 15/06/2030                                                             | 1 950                               | 1 877                            | 0,08                      | 9,750 % éch. 15/04/2029                                           | 3 400                               | 3 697                            | 0,15                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 30/09/2032                                                             | 75                                  | 72                               | 0,00                      | 11,250 % éch. 15/02/2027                                          | 2 800                               | 2 894                            | 0,12                      | Allied Universal Holdco LLC<br>4,625 % éch. 01/06/2028                           | 5 725                               | 5 646                            | 0,23                      |
| Quercus Re DAC<br>10,149 % éch. 06/01/2031                                          | € 250                               | 290                              | 0,01                      | SoftBank Group Corp.<br>5,125 % éch. 19/09/2027                   | 2 000                               | 1 990                            | 0,08                      | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC<br>2,000 % éch. 01/09/2028                | € 11 812                            | 13 165                           | 0,55                      |
| 13,324 % éch. 07/01/2031                                                            | 250                                 | 290                              | 0,01                      | 5,375 % éch. 08/01/2029                                           | € 825                               | 960                              | 0,04                      | 3,250 % éch. 01/09/2028                                                          | \$ 1 525                            | 1 461                            | 0,06                      |
| Recoletos RE DAC<br>5,289 % éch. 06/07/2032                                         | \$ 250                              | 250                              | 0,01                      | 5,750 % éch. 08/07/2032                                           | 1 300                               | 1 483                            | 0,06                      | Borr IHC Ltd.<br>8,750 % éch. 15/01/2032                                         | 4 800                               | 4 691                            | 0,19                      |
| Windmill Re DAC<br>7,285 % éch. 05/07/2028                                          | € 250                               | 294                              | 0,01                      | 5,875 % éch. 10/07/2031                                           | 775                                 | 891                              | 0,04                      | 9,000 % éch. 15/01/2034                                                          | 2 050                               | 1 984                            | 0,08                      |
| Yardstick RE DAC<br>4,274 % éch. 08/07/2034                                         | 250                                 | 286                              | 0,01                      | 6,375 % éch. 10/07/2033                                           | 1 025                               | 1 178                            | 0,05                      | Connect Finco SARL<br>9,000 % éch. 15/09/2029                                    | 1 450                               | 1 528                            | 0,06                      |
| Total Irlande                                                                       |                                     | 3 953                            | 0,16                      | 6,750 % éch. 08/07/2029                                           | \$ 4 300                            | 4 313                            | 0,18                      | Cyprium Corp.<br>6,125 % éch. 15/04/2031                                         | 825                                 | 827                              | 0,03                      |
| ÎLE DE MAN                                                                          |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 08/07/2031 (i)                                       | 3 000                               | 2 998                            | 0,12                      | EF Holdco<br>7,375 % éch. 30/09/2030                                             | 2 325                               | 2 317                            | 0,10                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                       |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 22/04/2032                                           | € 2 925                             | 3 493                            | 0,15                      | JetBlue Airways Corp.<br>9,875 % éch. 20/09/2031                                 | 6 290                               | 5 705                            | 0,24                      |
| Entain PLC<br>4,875 % éch. 30/11/2031                                               | 5 425                               | 6 286                            | 0,26                      | 7,250 % éch. 10/07/2032                                           | \$ 3 650                            | 3 596                            | 0,15                      | Stonepeak Motion Holdco Ltd.<br>5,000 % éch. 15/07/2033 (a)                      | € 300                               | 346                              | 0,02                      |
| ISRAËL                                                                              |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 22/10/2031                                           | 5 400                               | 5 576                            | 0,23                      | 6,125 % éch. 15/07/2033 (a)                                                      | \$ 2 000                            | 2 004                            | 0,08                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                       |                                     |                                  |                           | Total Japon                                                       |                                     | 38 062                           | 1,57                      | Toucan FinCo Ltd.<br>8,250 % éch. 15/05/2030                                     | € 25                                | 26                               | 0,00                      |
| Energean Israel Finance Ltd.<br>5,375 % éch. 30/03/2028                             | \$ 1 875                            | 1 856                            | 0,08                      | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES                                      |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 15/05/2030                                                          | \$ 2 000                            | 1 887                            | 0,08                      |
| ITALIE                                                                              |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                     |                                  |                           | VistaJet Malta Finance PLC<br>8,750 % éch. 15/01/2032                            | 3 425                               | 3 396                            | 0,14                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                       |                                     |                                  |                           | A&K Travel Group Holdings Ltd.<br>7,500 % éch. 15/05/2033         | 2 800                               | 2 828                            | 0,12                      | 9,500 % éch. 01/06/2028                                                          | 6 650                               | 6 738                            | 0,28                      |
| Agrifarma SpA<br>4,500 % éch. 31/10/2028                                            | € 2 550                             | 2 938                            | 0,12                      | GSG Bidco Ltd.<br>4,700 % éch. 15/06/2031                         | € 1 650                             | 1 894                            | 0,08                      | Total Multinationales                                                            |                                     | 51 721                           | 2,14                      |
| Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC<br>7,500 % éch. 15/02/2032                         | \$ 4 675                            | 4 683                            | 0,19                      | 5,375 % éch. 15/06/2036                                           | 1 800                               | 2 043                            | 0,08                      | PAYS-BAS                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Fibercop SpA<br>1,625 % éch. 18/01/2029                                             | € 2 050                             | 2 238                            | 0,09                      | Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                                |                                     | 6 765                            | 0,28                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 30/06/2030                                                             | 1 550                               | 1 809                            | 0,08                      | LUXEMBOURG                                                        |                                     |                                  |                           | Axalta Coating Systems Dutch Holding BV<br>7,250 % éch. 15/02/2031               | 870                                 | 905                              | 0,04                      |
| 5,125 % éch. 30/06/2032                                                             | 1 325                               | 1 559                            | 0,06                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                     |                                  |                           | Boels Topholding BV<br>6,250 % éch. 15/02/2029                                   | € 600                               | 702                              | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 30/09/2034                                                             | \$ 125                              | 121                              | 0,01                      | Alexandrite Lake Lux Holdings SARL<br>6,750 % éch. 30/07/2030     | 600                                 | 687                              | 0,03                      | Citycon Treasury BV<br>5,000 % éch. 11/03/2030                                   | 4 175                               | 4 628                            | 0,19                      |
| 6,375 % éch. 15/11/2033                                                             | 875                                 | 878                              | 0,04                      | Arena Luxembourg Finance SARL<br>4,500 % éch. 30/06/2031          | 1 600                               | 1 845                            | 0,08                      | Flora Food Management BV<br>6,875 % éch. 02/07/2029                              | 11 625                              | 13 002                           | 0,54                      |
| 6,875 % éch. 15/02/2036                                                             | € 1 250                             | 1 498                            | 0,06                      | Cidron Aida Finco SARL<br>7,000 % éch. 27/10/2031                 | 650                                 | 721                              | 0,03                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 7,200 % éch. 18/07/2036                                                             | \$ 5 700                            | 5 859                            | 0,24                      | Consolidated Energy Finance S.A.<br>5,625 % éch. 15/10/2028       | \$ 675                              | 649                              | 0,03                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 31/07/2028                                                             | € 1 200                             | 1 480                            | 0,06                      | 12,000 % éch. 15/02/2031                                          | 400                                 | 414                              | 0,02                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Gg12 SpA<br>6,250 % éch. 28/04/2033                                                 | 5 850                               | 6 858                            | 0,28                      | ContourGlobal Power Holdings S.A.<br>5,000 % éch. 28/02/2030      | € 1 200                             | 1 393                            | 0,06                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                     |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 28/02/2030                                           | \$ 2 516                            | 2 557                            | 0,11                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                     |                                     |                                  |                           | CPI Property Group S.A.<br>1,750 % éch. 14/01/2030                | € 4 425                             | 4 439                            | 0,18                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/01/2028                                           | £ 2 550                             | 3 295                            | 0,14                      |                                                                                  |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| IPD BV                                     |                                     |                                  |                           | ROYAUME-UNI                                |                                     |                                  |                           | AES Corp.                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,776 % éch. 15/06/2031                    | € 4 350                             | \$ 4 946                         | 0,20                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 15/07/2055                                                                   | \$ 4 375                            | \$ 4 322                         | 0,18                      |
| Nouryon Finance BV                         |                                     |                                  |                           | Alexandrite Monnet UK Holdco PLC           |                                     |                                  |                           | 7,600 % éch. 15/01/2055                                                                   | 1 300                               | 1 335                            | 0,06                      |
| 6,125 % éch. 15/07/2031 (a)                | 2 700                               | 3 139                            | 0,13                      | 6,875 % éch. 31/05/2031                    | € 1 300                             | \$ 1 501                         | 0,06                      | Aethon United BR LP                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Stellantis NV                              |                                     |                                  |                           | Allwyn Entertainment Financing UK PLC      |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/10/2029                                                                   | 1 325                               | 1 379                            | 0,06                      |
| 6,250 % éch. 16/03/2031 (e)                | 2 650                               | 2 973                            | 0,12                      | 4,625 % éch. 15/08/2031                    | 2 200                               | 2 512                            | 0,10                      | Albertsons Cos., Inc.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 16/12/2033 (e)                | 3 450                               | 3 853                            | 0,16                      | Amber Finco PLC                            |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 31/03/2034                                                                   | 2 425                               | 2 312                            | 0,10                      |
| Telefonica Europe BV                       |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/07/2029                    | 1 200                               | 1 424                            | 0,06                      | Alliant Holdings Intermediate LLC                                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,752 % éch. 15/01/2032 (e)                | 4 200                               | 5 089                            | 0,21                      | Barclays PLC                               |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/10/2027                                                                   | 1 180                               | 1 167                            | 0,05                      |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 15/09/2031 (e)(g)             | £ 700                               | 991                              | 0,04                      | 6,750 % éch. 15/04/2028                                                                   | 12 475                              | 12 581                           | 0,52                      |
| 4,100 % éch. 01/10/2046                    | \$ 906                              | 700                              | 0,03                      | BCP Modular Services Finance PLC           |                                     |                                  |                           | Allied Universal Holdco LLC                                                               |                                     |                                  |                           |
| Veon Midco BV                              |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 30/11/2028                    | € 2 810                             | 3 050                            | 0,13                      | 7,875 % éch. 15/02/2031                                                                   | 2 350                               | 2 458                            | 0,10                      |
| 3,375 % éch. 25/11/2027                    | 517                                 | 505                              | 0,02                      | 6,500 % éch. 10/07/2031 (i)                | 700                                 | 696                              | 0,03                      | Allison Transmission, Inc.                                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,950 % éch. 01/06/2031                    | 2 900                               | 2 897                            | 0,12                      | Canary Wharf Group Investment Holdings PLC |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 30/01/2031                                                                   | 1 975                               | 1 848                            | 0,08                      |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                    | 3 275                               | 3 270                            | 0,13                      | 3,375 % éch. 23/04/2028                    | £ 500                               | 638                              | 0,03                      | 4,750 % éch. 01/10/2027                                                                   | 1 950                               | 1 946                            | 0,08                      |
| VZ Secured Financing BV                    |                                     |                                  |                           | Carnival UK Ltd.                           |                                     |                                  |                           | AMC Global Media, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 15/01/2032                    | 1 250                               | 1 095                            | 0,05                      | 4,125 % éch. 15/07/2031                    | € 5 400                             | 6 219                            | 0,26                      | 10,500 % éch. 15/07/2032                                                                  | 106                                 | 109                              | 0,00                      |
| 7,500 % éch. 15/01/2033                    | 14 075                              | 13 484                           | 0,56                      | CD&R Firefly Bidco PLC                     |                                     |                                  |                           | American Airlines Pass-Through Trust                                                      |                                     |                                  |                           |
| Wintershall Dea Finance BV                 |                                     |                                  |                           | 8,625 % éch. 30/04/2029                    | £ 2 025                             | 2 772                            | 0,11                      | 3,375 % éch. 01/11/2028                                                                   | 224                                 | 222                              | 0,01                      |
| 6,117 % éch. 08/05/2030 (e)                | € 4 550                             | 5 394                            | 0,22                      | EC Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | American Axle & Manufacturing, Inc.                                                       |                                     |                                  |                           |
| ZF Europe Finance BV                       |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/10/2026                    | € 1 900                             | 2 169                            | 0,09                      | 6,875 % éch. 01/07/2028                                                                   | 109                                 | 110                              | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 23/10/2029                    | 2 600                               | 2 845                            | 0,12                      | Heathrow Finance PLC                       |                                     |                                  |                           | American Builders & Contractors Supply Co., Inc.                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/02/2032                    | 400                                 | 453                              | 0,02                      | 3,875 % éch. 01/03/2027                    | £ 1 875                             | 2 468                            | 0,10                      | 3,875 % éch. 15/11/2029                                                                   | 5 450                               | 5 198                            | 0,21                      |
| 6,125 % éch. 13/03/2029                    | 8 800                               | 10 397                           | 0,43                      | 4,125 % éch. 01/09/2029                    | 2 933                               | 3 665                            | 0,15                      | AmWINS Group, Inc.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Ziggo BV                                   |                                     |                                  |                           | INEOS Finance PLC                          |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/02/2029                                                                   | 1 375                               | 1 383                            | 0,06                      |
| 4,875 % éch. 15/01/2030                    | \$ 875                              | 822                              | 0,03                      | 7,500 % éch. 15/04/2029                    | \$ 325                              | 316                              | 0,01                      | Antero Midstream Partners LP                                                              |                                     |                                  |                           |
| Total Pays-Bas                             |                                     | 81 099                           | 3,35                      | 7,875 % éch. 15/11/2031                    | € 1 125                             | 1 238                            | 0,05                      | 5,750 % éch. 15/01/2028                                                                   | 100                                 | 100                              | 0,00                      |
| NORVÈGE                                    |                                     |                                  |                           | INEOS Quattro Finance PLC                  |                                     |                                  |                           | API Group DE, Inc.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 15/03/2029                    | \$ 3 000                            | 2 820                            | 0,12                      | 4,125 % éch. 15/07/2029                                                                   | 3 430                               | 3 292                            | 0,14                      |
| TGS ASA                                    |                                     |                                  |                           | Miller Homes Group Finco PLC               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/10/2029                                                                   | 2 675                               | 2 624                            | 0,11                      |
| 8,500 % éch. 15/01/2030                    | 7 150                               | 7 519                            | 0,31                      | 6,533 % éch. 15/10/2030 (h)                | € 1 600                             | 1 833                            | 0,08                      | 5,750 % éch. 01/06/2034                                                                   | 125                                 | 124                              | 0,01                      |
| Var Energi ASA                             |                                     |                                  |                           | Mobico Group PLC                           |                                     |                                  |                           | APLD ComputeCo LLC                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 29/04/2086                    | € 9 225                             | 10 562                           | 0,44                      | 3,625 % éch. 20/11/2028                    | £ 400                               | 488                              | 0,02                      | 6,750 % éch. 15/03/2031                                                                   | 5 375                               | 5 398                            | 0,22                      |
| 7,862 % éch. 15/11/2083                    | 1 775                               | 2 197                            | 0,09                      | NatWest Group PLC                          |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/06/2031                                                                   | 1 550                               | 1 549                            | 0,06                      |
| Total Norvège                              |                                     | 20 278                           | 0,84                      | 7,625 % éch. 30/09/2035 (e)(g)(i)          | 400                                 | 547                              | 0,02                      | Aramark Services, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| POLOGNE                                    |                                     |                                  |                           | Pinnacle Bidco PLC                         |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/02/2028                                                                   | 5 350                               | 5 342                            | 0,22                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 11/10/2028                    | € 6 125                             | 7 257                            | 0,30                      | Arcosa, Inc.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Synthos S.A.                               |                                     |                                  |                           | Virgin Media Finance PLC                   |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/04/2029                                                                   | 1 875                               | 1 846                            | 0,08                      |
| 2,500 % éch. 07/06/2028 (i)                | 4 800                               | 5 322                            | 0,22                      | 5,000 % éch. 15/07/2030                    | \$ 2 750                            | 2 094                            | 0,09                      | Ascent Resources Utica Holdings LLC                                                       |                                     |                                  |                           |
| SINGAPOUR                                  |                                     |                                  |                           | Virgin Media Secured Finance PLC           |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/07/2033                                                                   | 400                                 | 405                              | 0,02                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/01/2030                    | £ 11 375                            | 13 328                           | 0,55                      | Asurion LLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| Seagate Data Storage Technology Pte Ltd.   |                                     |                                  |                           | Vmed O2 UK Financing PLC                   |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 31/12/2032                                                                   | 5 358                               | 5 403                            | 0,22                      |
| 8,250 % éch. 15/12/2029                    | \$ 5 000                            | 5 231                            | 0,22                      | 4,750 % éch. 15/07/2031                    | \$ 1 025                            | 843                              | 0,03                      | 8,375 % éch. 01/02/2034                                                                   | 4 435                               | 4 109                            | 0,17                      |
| ESPAGNE                                    |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/04/2032                    | € 9 750                             | 9 825                            | 0,41                      | ATI, Inc.                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 15/04/2032                    | \$ 225                              | 203                              | 0,01                      | 5,875 % éch. 15/06/2033                                                                   | 1 200                               | 1 217                            | 0,05                      |
| Celsa Opco S.A.                            |                                     |                                  |                           | Total Royaume-Uni                          |                                     | 68 897                           | 2,85                      | Avantor Funding, Inc.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/12/2030                    | € 3 982                             | 4 857                            | 0,20                      | ACTIONS                                    |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/07/2028                                                                   | 375                                 | 371                              | 0,02                      |
| Grifols S.A.                               |                                     |                                  |                           | ÉTATS-UNIS                                 |                                     |                                  |                           | Avis Budget Car Rental LLC                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/10/2028                    | \$ 2 070                            | 2 030                            | 0,08                      | ACTIONS ORDINAIRES                         |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 15/06/2032                                                                   | 5 725                               | 5 768                            | 0,24                      |
| Molins Finance S.A.                        |                                     |                                  |                           | INDUSTRIE                                  |                                     |                                  |                           | Axon Enterprise, Inc.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 15/06/2033                    | € 1 300                             | 1 555                            | 0,07                      | Spirit Aviation Holdings, Inc. (c)         | 311 100                             | 6                                | 0,00                      | 6,125 % éch. 15/03/2030                                                                   | 2 719                               | 2 780                            | 0,11                      |
|                                            |                                     | 8 442                            | 0,35                      |                                            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/03/2033                                                                   | 2 225                               | 2 282                            | 0,09                      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | B&G Foods, Inc.                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Subcalidora                                |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 15/09/2028                                                                   | 5 425                               | 5 437                            | 0,22                      |
| 8,041 % éch. 14/08/2029                    | 10 875                              | 12 367                           | 0,51                      |                                            |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 15/06/2031                                                                  | 1 475                               | 1 363                            | 0,06                      |
| Total Espagne                              |                                     | 20 809                           | 0,86                      |                                            |                                     |                                  |                           | Ball Corp.                                                                                |                                     |                                  |                           |
| SUÈDE                                      |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 15/09/2031                                                                   | 200                                 | 181                              | 0,01                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Bath & Body Works, Inc.                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Asmodee Group AB                           |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/07/2036                                                                   | 300                                 | 301                              | 0,01                      |
| 5,750 % éch. 15/12/2029                    | 160                                 | 190                              | 0,01                      |                                            |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/11/2035                                                                   | 2 300                               | 2 357                            | 0,10                      |
| Castellum AB                               |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Beach Acquisition Bidco LLC (10,000 % en numéraire ou 10,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 02/12/2026 (e)                | 8 225                               | 9 326                            | 0,39                      |                                            |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 15/07/2033 (b)                                                              | 4 159                               | 4 724                            | 0,20                      |
| Heimstaden AB                              |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Beacon Mobility Corp.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,361 % éch. 24/01/2031                    | 4 600                               | 5 364                            | 0,22                      |                                            |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 01/08/2030                                                                   | 4 000                               | 4 167                            | 0,17                      |
| Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB  |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Beazer Homes USA, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 14/11/2028                    | 12 250                              | 12 388                           | 0,51                      |                                            |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 15/01/2032                                                                   | 1 550                               | 1 558                            | 0,06                      |
| Verisure Holding AB                        |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 02/01/2032 (a)                | 900                                 | 1 038                            | 0,04                      |                                            |                                     |                                  |                           | 6,581 % éch. 30/05/2049                                                                   | 4 700                               | 4 797                            | 0,20                      |
| Total Suède                                |                                     | 28 306                           | 1,17                      |                                            |                                     |                                  |                           | BioMarin Pharmaceutical, Inc.                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/02/2034                                                                   | 200                                 | 197                              | 0,01                      |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | BKV Upstream Midstream LLC                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/10/2030                                                                   | 875                                 | 879                              | 0,04                      |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | Black Pearl Compute LLC                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                            |                                     |                                  |                           |                                            |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/02/2031                                                                   | 525                                 | 532                              | 0,02                      |



# Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Block, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Cleveland-Cliffs, Inc.                |                                     |                                  |                           | Discovery Global Holdings, Inc.                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 15/08/2030              | \$ 2 900                            | \$ 2 909                         | 0,12                      | 6,750 % éch. 15/04/2030               | \$ 2 130                            | \$ 2 133                         | 0,09                      | 4,054 % éch. 15/03/2029                                                    | \$ 1 125                            | \$ 1 115                         | 0,05                      |
| 6,000 % éch. 15/08/2033              | 1 500                               | 1 511                            | 0,06                      | 6,875 % éch. 01/11/2029               | 900                                 | 909                              | 0,04                      | 4,279 % éch. 15/03/2032                                                    | 4 149                               | 3 726                            | 0,15                      |
| 6,500 % éch. 15/05/2032              | 3 925                               | 4 009                            | 0,17                      | 7,500 % éch. 15/09/2031               | 2 050                               | 2 076                            | 0,09                      | 5,050 % éch. 15/03/2042                                                    | 6 225                               | 4 568                            | 0,19                      |
| Bond U.S. Bidco 1, Inc.              |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch. 15/01/2034               | 150                                 | 150                              | 0,01                      | 5,141 % éch. 15/03/2052                                                    | 425                                 | 286                              | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 15/06/2033              | € 475                               | 547                              | 0,02                      | Cloud Software Group, Inc.            |                                     |                                  |                           | DISH DBS Corp.                                                             |                                     |                                  |                           |
| Bond U.S. Bidco, Inc.                |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 31/03/2029               | 3 500                               | 3 399                            | 0,14                      | 5,250 % éch. 01/12/2026                                                    | 2 400                               | 2 376                            | 0,10                      |
| 7,125 % éch. 15/05/2033              | \$ 3 175                            | 3 208                            | 0,13                      | 6,625 % éch. 15/08/2033               | 8 250                               | 7 159                            | 0,30                      | DISH Network Corp.                                                         |                                     |                                  |                           |
| Boyne USA, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 30/06/2032               | 4 475                               | 4 197                            | 0,17                      | 11,750 % éch. 15/11/2027                                                   | 4 175                               | 4 293                            | 0,18                      |
| 4,750 % éch. 15/05/2029              | 3 148                               | 3 100                            | 0,13                      | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | Diversified Healthcare Trust                                               |                                     |                                  |                           |
| Brink's Co.                          |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/04/2032               | 4 025                               | 3 910                            | 0,16                      | 4,375 % éch. 01/03/2031                                                    | 4 025                               | 3 687                            | 0,15                      |
| 4,625 % éch. 15/10/2027              | 600                                 | 597                              | 0,02                      | 6,875 % éch. 15/01/2030               | 2 725                               | 2 718                            | 0,11                      | 7,250 % éch. 15/10/2030                                                    | 6 025                               | 6 209                            | 0,26                      |
| Brookfield Property REIT, Inc.       |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 15/04/2030               | 100                                 | 99                               | 0,00                      | Dorman Products, Inc.                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 01/04/2027              | 1 900                               | 1 880                            | 0,08                      | Cogent Communications Group LLC       |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/06/2034                                                    | 775                                 | 785                              | 0,03                      |
| Builders FirstSource, Inc.           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2032               | 6 875                               | 6 194                            | 0,26                      | EchoStar Corp.                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 01/02/2032              | 6 550                               | 6 106                            | 0,25                      | 7,000 % éch. 15/06/2027               | 2 800                               | 2 782                            | 0,12                      | 10,750 % éch. 30/11/2029                                                   | 5 200                               | 5 622                            | 0,23                      |
| 6,750 % éch. 15/05/2035              | 3 550                               | 3 624                            | 0,15                      | Coherent Corp.                        |                                     |                                  |                           | EchoStar Corp. (6,750 % en numéraire ou 6,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| Burford Capital Global Finance LLC   |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/12/2029               | 4 725                               | 4 655                            | 0,19                      | 6,750 % éch. 30/11/2030 (b)                                                | 2 325                               | 2 367                            | 0,10                      |
| 7,500 % éch. 15/07/2033              | 250                                 | 212                              | 0,01                      | Coinbase Global, Inc.                 |                                     |                                  |                           | Edison International                                                       |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/01/2034              | 1 575                               | 1 382                            | 0,06                      | 3,375 % éch. 01/10/2028               | 3 400                               | 3 230                            | 0,13                      | 8,125 % éch. 15/06/2053                                                    | 500                                 | 514                              | 0,02                      |
| 9,250 % éch. 01/07/2031              | 4 025                               | 3 922                            | 0,16                      | 3,625 % éch. 01/10/2031               | 1 250                               | 1 090                            | 0,05                      | ELK Grove Village Property LLC                                             |                                     |                                  |                           |
| BWX Technologies, Inc.               |                                     |                                  |                           | Columbus McKinnon Corp.               |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/06/2031                                                    | 1 350                               | 1 360                            | 0,06                      |
| 4,125 % éch. 30/06/2028              | 4 027                               | 3 954                            | 0,16                      | 7,125 % éch. 01/02/2033               | 4 275                               | 4 288                            | 0,18                      | Ellucian Holdings, Inc.                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 15/04/2029              | 2 025                               | 1 964                            | 0,08                      | Commercial Metals Co.                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/12/2029                                                    | 2 300                               | 2 229                            | 0,09                      |
| Caesars Entertainment, Inc.          |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/02/2031               | 25                                  | 23                               | 0,00                      | Emera U.S. Finance LLC                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/02/2032              | 2 575                               | 2 514                            | 0,10                      | 4,125 % éch. 15/01/2030               | 1 800                               | 1 746                            | 0,07                      | 6,650 % éch. 01/10/2056                                                    | 1 925                               | 1 950                            | 0,08                      |
| Carpenter Technology Corp.           |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/03/2032               | 650                                 | 616                              | 0,03                      | 6,850 % éch. 01/10/2056                                                    | 1 050                               | 1 075                            | 0,04                      |
| 5,625 % éch. 01/03/2034              | 975                                 | 975                              | 0,04                      | Community Health Systems, Inc.        |                                     |                                  |                           | Encompass Health Corp.                                                     |                                     |                                  |                           |
| Cars.com, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/02/2031               | 3 392                               | 3 123                            | 0,13                      | 5,875 % éch. 01/06/2034                                                    | 2 150                               | 2 147                            | 0,09                      |
| 6,375 % éch. 01/11/2028              | 100                                 | 99                               | 0,00                      | 5,250 % éch. 15/05/2030               | 2 725                               | 2 573                            | 0,11                      | Encore Capital Group, Inc.                                                 |                                     |                                  |                           |
| Carvana Co.                          |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/04/2030               | 2 100                               | 1 887                            | 0,08                      | 6,625 % éch. 01/06/2032                                                    | 400                                 | 401                              | 0,02                      |
| 9,000 % éch. 01/06/2030              | 1 775                               | 1 837                            | 0,08                      | 6,875 % éch. 15/04/2029               | 1 125                               | 1 107                            | 0,05                      | 8,500 % éch. 15/05/2030                                                    | 7 775                               | 8 262                            | 0,34                      |
| 9,000 % éch. 01/06/2031              | 2 276                               | 2 513                            | 0,10                      | 9,750 % éch. 15/01/2034               | 7 900                               | 8 258                            | 0,34                      | Energizer Holdings, Inc.                                                   |                                     |                                  |                           |
| Caturus Energy LLC                   |                                     |                                  |                           | 10,875 % éch. 15/01/2032              | 1 625                               | 1 752                            | 0,07                      | 4,750 % éch. 15/06/2028                                                    | 425                                 | 422                              | 0,02                      |
| 7,125 % éch. 15/05/2031              | 200                                 | 198                              | 0,01                      | Comstock Resources, Inc.              |                                     |                                  |                           | EquipmentShare.com, Inc.                                                   |                                     |                                  |                           |
| CBS Corp.                            |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/01/2030               | 1 650                               | 1 557                            | 0,06                      | 7,125 % éch. 01/07/2034 (a)                                                | 4 300                               | 4 230                            | 0,17                      |
| 4,850 % éch. 01/07/2042              | 950                                 | 643                              | 0,03                      | 6,750 % éch. 01/03/2029               | 4 400                               | 4 328                            | 0,18                      | 8,625 % éch. 15/05/2032                                                    | 50                                  | 52                               | 0,00                      |
| CCO Holdings LLC                     |                                     |                                  |                           | Connect Holding LLC                   |                                     |                                  |                           | Esab Corp.                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/08/2030              | 3 250                               | 3 023                            | 0,13                      | 10,500 % éch. 03/04/2031              | 5 650                               | 5 664                            | 0,23                      | 5,625 % éch. 01/04/2031                                                    | 1 200                               | 1 204                            | 0,05                      |
| 4,750 % éch. 01/02/2032              | 6 350                               | 5 668                            | 0,23                      | Cooper-Standard Automotive, Inc.      |                                     |                                  |                           | Excelsior Energy LP                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/02/2028              | 3 450                               | 3 409                            | 0,14                      | 9,250 % éch. 01/03/2031               | 1 525                               | 1 538                            | 0,06                      | 8,000 % éch. 15/05/2030                                                    | 4 025                               | 4 247                            | 0,18                      |
| 7,000 % éch. 01/02/2033              | 4 575                               | 4 490                            | 0,19                      | Core & Main LP                        |                                     |                                  |                           | Fair Isaac Corp.                                                           |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 01/02/2036              | 1 100                               | 1 080                            | 0,04                      | 6,000 % éch. 01/07/2034 (a)           | 2 000                               | 2 011                            | 0,08                      | 4,000 % éch. 15/06/2028                                                    | 2 550                               | 2 496                            | 0,10                      |
| Celanese U.S. Holdings LLC           |                                     |                                  |                           | Core Scientific Finance LLC           |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/09/2034                                                    | 4 075                               | 4 016                            | 0,17                      |
| 7,000 % éch. 15/02/2031              | 2 725                               | 2 807                            | 0,12                      | 7,750 % éch. 15/05/2031               | 5 675                               | 5 759                            | 0,24                      | Fiesta Purchaser, Inc.                                                     |                                     |                                  |                           |
| Centene Corp.                        |                                     |                                  |                           | CoreWeave, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 01/03/2031                                                    | 800                                 | 808                              | 0,03                      |
| 2,450 % éch. 15/07/2028              | 1 225                               | 1 165                            | 0,05                      | 8,500 % éch. 15/07/2032               | € 4 150                             | 4 680                            | 0,19                      | First Eagle Holdings, Inc.                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/10/2030              | 925                                 | 838                              | 0,03                      | 9,000 % éch. 01/02/2031               | \$ 5 900                            | 5 838                            | 0,24                      | 7,250 % éch. 15/08/2032                                                    | 875                                 | 882                              | 0,04                      |
| 3,375 % éch. 15/02/2030              | 1 950                               | 1 818                            | 0,08                      | 9,250 % éch. 01/06/2030               | 2 675                               | 2 694                            | 0,11                      | First Student Bidco, Inc.                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/12/2029              | 1 325                               | 1 286                            | 0,05                      | 9,750 % éch. 01/10/2031               | 5 250                               | 5 242                            | 0,22                      | 4,000 % éch. 31/07/2029                                                    | 5 225                               | 5 008                            | 0,21                      |
| Central Parent LLC                   |                                     |                                  |                           | CQP Holdco LP                         |                                     |                                  |                           | FMC Corp.                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 15/06/2029              | 1 475                               | 959                              | 0,04                      | 5,500 % éch. 15/06/2031               | 5 300                               | 5 204                            | 0,22                      | 8,000 % éch. 01/06/2031                                                    | 3 625                               | 3 775                            | 0,16                      |
| Central Parent, Inc.                 |                                     |                                  |                           | CRC Insurance Group LLC               |                                     |                                  |                           | Fortress Intermediate, Inc.                                                |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 15/06/2029              | 800                                 | 520                              | 0,02                      | 7,125 % éch. 01/06/2031               | 3 675                               | 3 665                            | 0,15                      | 7,500 % éch. 01/06/2031                                                    | 4 212                               | 4 287                            | 0,18                      |
| Champ Acquisition Corp.              |                                     |                                  |                           | Crescent Energy Finance LLC           |                                     |                                  |                           | Freedom Mortgage Corp.                                                     |                                     |                                  |                           |
| 8,375 % éch. 01/12/2031              | 850                                 | 892                              | 0,04                      | 7,375 % éch. 15/01/2033               | 3 000                               | 2 984                            | 0,12                      | 6,625 % éch. 15/01/2027                                                    | 4 200                               | 4 202                            | 0,17                      |
| Charlotte Buyer, Inc.                |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 15/01/2034               | 2 600                               | 2 680                            | 0,11                      | 12,250 % éch. 01/10/2030                                                   | 6 025                               | 6 505                            | 0,27                      |
| 8,000 % éch. 30/06/2031              | 1 475                               | 1 494                            | 0,06                      | Crocs, Inc.                           |                                     |                                  |                           | Freedom Mortgage Holdings LLC                                              |                                     |                                  |                           |
| Chobani LLC                          |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/08/2031               | 200                                 | 188                              | 0,01                      | 9,250 % éch. 01/02/2029                                                    | 3 656                               | 3 791                            | 0,16                      |
| 4,625 % éch. 15/11/2028              | 1 425                               | 1 412                            | 0,06                      | CrossCountry Intermediate HoldCo LLC  |                                     |                                  |                           | FS KKR Capital Corp.                                                       |                                     |                                  |                           |
| 7,625 % éch. 01/07/2029              | 1 975                               | 2 039                            | 0,08                      | 6,500 % éch. 01/10/2030               | 525                                 | 518                              | 0,02                      | 6,125 % éch. 15/01/2031                                                    | 425                                 | 409                              | 0,02                      |
| Chord Energy Corp.                   |                                     |                                  |                           | Crowdstrike Holdings, Inc.            |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/08/2031                                                    | 3 950                               | 3 936                            | 0,16                      |
| 6,000 % éch. 01/10/2030              | 1 675                               | 1 683                            | 0,07                      | 3,000 % éch. 15/02/2029               | 5 045                               | 4 815                            | 0,20                      | FTAI Aviation Investors LLC                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 15/03/2033              | 1 375                               | 1 396                            | 0,06                      | CVR Energy, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/05/2028                                                    | 1 200                               | 1 198                            | 0,05                      |
| Churchill Downs, Inc.                |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/02/2031               | 1 050                               | 1 046                            | 0,04                      | 5,875 % éch. 15/04/2033                                                    | 1 675                               | 1 677                            | 0,07                      |
| 5,500 % éch. 01/04/2027              | 1 975                               | 1 975                            | 0,08                      | 7,875 % éch. 15/02/2034               | 725                                 | 718                              | 0,03                      | 7,000 % éch. 01/05/2031                                                    | 3 475                               | 3 602                            | 0,15                      |
| 6,750 % éch. 01/05/2031              | 2 525                               | 2 572                            | 0,11                      | DaVita, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Full House Resorts, Inc.                                                   |                                     |                                  |                           |
| Cipher Compute LLC                   |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/09/2032               | 1 775                               | 1 832                            | 0,08                      | 8,250 % éch. 15/02/2028                                                    | 1 500                               | 1 470                            | 0,06                      |
| 7,125 % éch. 15/11/2030              | 350                                 | 364                              | 0,02                      | Delek Logistics Partners LP           |                                     |                                  |                           | Gaia Purchaser, Inc.                                                       |                                     |                                  |                           |
| Clarivate Science Holdings Corp.     |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/06/2034               | 2 915                               | 2 903                            | 0,12                      | 7,625 % éch. 15/07/2033 (a)                                                | 1 975                               | 1 999                            | 0,08                      |
| 3,875 % éch. 01/07/2028              | 1 675                               | 1 612                            | 0,07                      | Directv Financing LLC                 |                                     |                                  |                           | Gap, Inc.                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 01/02/2030               | 175                                 | 178                              | 0,01                      | 3,875 % éch. 01/10/2031                                                    | 2 800                               | 2 553                            | 0,11                      |
| 7,125 % éch. 15/02/2031              | 2 450                               | 2 538                            | 0,10                      | 9,250 % éch. 01/06/2032               | 2 300                               | 2 339                            | 0,10                      | GB AIT Buyer, Inc.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/03/2033              | 2 375                               | 2 502                            | 0,10                      | Discovery Communications LLC          |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 30/04/2034                                                    | 750                                 | 753                              | 0,03                      |
| Clearway Energy Operating LLC        |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 20/03/2028               | 4 275                               | 4 214                            | 0,17                      | Gen Digital, Inc.                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/03/2028              | 2 525                               | 2 503                            | 0,10                      | 6,350 % éch. 01/06/2040               | 300                                 | 250                              | 0,01                      | 6,250 % éch. 01/04/2033                                                    | 1 050                               | 1 036                            | 0,04                      |



| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Genesis Energy LP                                   |                                     |                                  |                           | Jefferies Finance LLC                           |                                     |                                  |                           | MPT Operating Partnership LP     |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 15/03/2034                             | \$ 3 900                            | \$ 3 872                         | 0,16                      | 5,000 % éch. 15/08/2028                         | \$ 675                              | \$ 652                           | 0,03                      | 8,500 % éch. 15/02/2032          | \$ 2 250                            | \$ 2 305                         | 0,10                      |
| 7,875 % éch. 15/05/2032                             | 2 650                               | 2 734                            | 0,11                      | Jefferson Capital Holdings LLC                  |                                     |                                  |                           | Murphy Oil Corp.                 |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 15/05/2033                             | 1 500                               | 1 561                            | 0,06                      | 9,500 % éch. 15/02/2029                         | 2 100                               | 2 201                            | 0,09                      | 5,875 % éch. 01/12/2042          | 525                                 | 468                              | 0,02                      |
| 8,250 % éch. 15/01/2029                             | 600                                 | 620                              | 0,03                      | KBR, Inc.                                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/02/2034          | 775                                 | 768                              | 0,03                      |
| 8,875 % éch. 15/04/2030                             | 600                                 | 628                              | 0,03                      | 4,750 % éch. 30/09/2028                         | 1 975                               | 1 951                            | 0,08                      | Murphy Oil USA, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| Global Infrastructure Solutions, Inc.               |                                     |                                  |                           | KeHE Distributors LLC                           |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/02/2031          | 1 850                               | 1 732                            | 0,07                      |
| 6,375 % éch. 15/07/2034 (a)                         | 3 225                               | 3 245                            | 0,13                      | 7,125 % éch. 30/04/2033                         | 550                                 | 561                              | 0,02                      | Nabors Industries, Inc.          |                                     |                                  |                           |
| Go Daddy Operating Co. LLC                          |                                     |                                  |                           | Kodiak Gas Services LLC                         |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch. 15/11/2032          | 7 100                               | 7 269                            | 0,30                      |
| 3,500 % éch. 01/03/2029                             | 1 875                               | 1 767                            | 0,07                      | 5,875 % éch. 01/04/2031                         | 1 350                               | 1 354                            | 0,06                      | National Mentor Holdings, Inc.   |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 01/12/2027                             | 5 545                               | 5 543                            | 0,23                      | Korn Ferry                                      |                                     |                                  |                           | 10,500 % éch. 15/12/2030         | 3 850                               | 4 061                            | 0,17                      |
| Goat Holdco LLC                                     |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/12/2027                         | 2 000                               | 1 991                            | 0,08                      | Navient Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 01/02/2032                             | 2 625                               | 2 692                            | 0,11                      | Kraken Oil & Gas Partners LLC                   |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/03/2027          | 875                                 | 869                              | 0,04                      |
| Goodyear Tire & Rubber Co.                          |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/05/2031                         | 3 300                               | 3 229                            | 0,13                      | 9,375 % éch. 15/10/2031          | 200                                 | 199                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 15/07/2029                             | 525                                 | 502                              | 0,02                      | 7,625 % éch. 15/08/2029                         | 880                                 | 889                              | 0,04                      | NCR Atleos Corp.                 |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 15/07/2032                             | 1 875                               | 1 893                            | 0,08                      | Lamar Media Corp.                               |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 01/04/2029          | 2 400                               | 2 560                            | 0,11                      |
| Graham Holdings Co.                                 |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/02/2028                         | 2 200                               | 2 160                            | 0,09                      | NCR Voyix Corp.                  |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 01/12/2033                             | 2 475                               | 2 460                            | 0,10                      | Lamb Weston Holdings, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/10/2028          | 1 664                               | 1 624                            | 0,07                      |
| Granite Construction, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/05/2028                         | 1 150                               | 1 143                            | 0,05                      | 5,250 % éch. 01/10/2030          | 500                                 | 455                              | 0,02                      |
| 6,375 % éch. 15/06/2034                             | 1 050                               | 1 070                            | 0,04                      | LBM Acquisition LLC                             |                                     |                                  |                           | Neptune Bidco U.S., Inc.         |                                     |                                  |                           |
| Graphic Packaging International LLC                 |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/01/2029                         | 8 925                               | 6 495                            | 0,27                      | 9,290 % éch. 15/04/2029          | 3 025                               | 3 087                            | 0,13                      |
| 4,750 % éch. 15/07/2027                             | 300                                 | 299                              | 0,01                      | Level 3 Financing, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 15/02/2033          | 2 200                               | 2 227                            | 0,09                      |
| Gray Media, Inc.                                    |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 30/06/2033                         | 2 775                               | 2 853                            | 0,12                      | 10,375 % éch. 15/05/2031         | 2 975                               | 3 086                            | 0,13                      |
| 4,750 % éch. 15/10/2030                             | 2 100                               | 1 510                            | 0,06                      | 7,000 % éch. 31/03/2034                         | 3 525                               | 3 637                            | 0,15                      | Newmark Group, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| 9,625 % éch. 15/07/2032                             | 4 900                               | 4 734                            | 0,20                      | 7,500 % éch. 15/02/2037                         | 3 625                               | 3 724                            | 0,15                      | 7,500 % éch. 12/01/2029          | 9 175                               | 9 617                            | 0,40                      |
| 10,500 % éch. 15/07/2029                            | 1 822                               | 1 924                            | 0,08                      | LifePoint Health, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Nexstar Media, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| Griffon Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 01/05/2034                         | 3 875                               | 3 717                            | 0,15                      | 6,500 % éch. 15/09/2033          | 3 700                               | 3 702                            | 0,15                      |
| 5,750 % éch. 01/03/2028                             | 3 925                               | 3 928                            | 0,16                      | 8,375 % éch. 15/02/2032                         | 1 000                               | 1 042                            | 0,04                      | 7,250 % éch. 15/04/2034          | 3 450                               | 3 445                            | 0,14                      |
| Gulfport Energy Operating Corp.                     |                                     |                                  |                           | 9,875 % éch. 15/08/2030                         | 1 250                               | 1 319                            | 0,05                      | NGL Energy Operating LLC         |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 01/09/2029                             | 825                                 | 842                              | 0,03                      | 10,000 % éch. 01/06/2032                        | 1 250                               | 1 249                            | 0,05                      | 8,125 % éch. 15/02/2029          | 2 200                               | 2 278                            | 0,09                      |
| HealthEquity, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | Light & Wonder International, Inc.              |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Acceptance Co. LLC  |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 01/10/2029                             | 2 250                               | 2 189                            | 0,09                      | 7,500 % éch. 01/09/2031                         | 1 570                               | 1 628                            | 0,07                      | 1,850 % éch. 16/09/2026          | 375                                 | 372                              | 0,02                      |
| Hertz Corp.                                         |                                     |                                  |                           | Lithia Motors, Inc.                             |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 13/09/2027          | 325                                 | 324                              | 0,01                      |
| 12,625 % éch. 15/07/2029                            | 1 150                               | 937                              | 0,04                      | 4,625 % éch. 15/12/2027                         | 1 825                               | 1 817                            | 0,08                      | 5,625 % éch. 29/09/2028          | 3 173                               | 3 168                            | 0,13                      |
| Hilcorp Energy LP                                   |                                     |                                  |                           | Live Nation Entertainment, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 30/09/2030          | 7 600                               | 7 477                            | 0,31                      |
| 6,250 % éch. 01/11/2028                             | 1 625                               | 1 630                            | 0,07                      | 3,750 % éch. 15/01/2028                         | 225                                 | 221                              | 0,01                      | Noble Finance LLC                |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/04/2032                             | 1 000                               | 969                              | 0,04                      | 4,750 % éch. 15/10/2027                         | 405                                 | 404                              | 0,02                      | 6,250 % éch. 15/06/2034          | 1 925                               | 1 888                            | 0,08                      |
| 6,875 % éch. 15/05/2034                             | 2 625                               | 2 556                            | 0,11                      | 6,500 % éch. 15/05/2027                         | 2 657                               | 2 658                            | 0,11                      | 8,000 % éch. 15/04/2030          | 7 896                               | 8 185                            | 0,34                      |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.                 |                                     |                                  |                           | Lsf12 Helix Parent LLC                          |                                     |                                  |                           | Novelis Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 01/05/2029                             | 509                                 | 492                              | 0,02                      | 7,125 % éch. 01/02/2033                         | 1 225                               | 1 189                            | 0,05                      | 4,750 % éch. 30/01/2030          | 2 025                               | 1 960                            | 0,08                      |
| 5,750 % éch. 15/09/2033                             | 5 525                               | 5 548                            | 0,23                      | LSF12 Pillar Investments US, Inc.               |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 30/01/2030          | 335                                 | 344                              | 0,01                      |
| Howard Midstream Energy Partners LLC                |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/05/2033                         | € 4 875                             | 5 547                            | 0,23                      | NRG Energy, Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 15/07/2032                             | 1 950                               | 2 021                            | 0,08                      | Madison IAQ LLC                                 |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/02/2029          | 2 400                               | 2 290                            | 0,09                      |
| HUB International Ltd.                              |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 30/06/2028                         | \$ 4 225                            | 4 160                            | 0,17                      | 3,625 % éch. 15/02/2031          | 2 200                               | 2 044                            | 0,08                      |
| 7,250 % éch. 15/06/2030                             | 4 350                               | 4 466                            | 0,18                      | Masterbrand, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/01/2028          | 1 233                               | 1 234                            | 0,05                      |
| 7,375 % éch. 31/01/2032                             | 1 300                               | 1 324                            | 0,05                      | 7,000 % éch. 15/07/2032                         | 875                                 | 888                              | 0,04                      | 5,750 % éch. 15/07/2029          | 3 575                               | 3 580                            | 0,15                      |
| Hybar LLC                                           |                                     |                                  |                           | Matador Resources Co.                           |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/05/2034          | 1 850                               | 1 841                            | 0,08                      |
| 7,375 % éch. 01/07/2034                             | 725                                 | 729                              | 0,03                      | 6,250 % éch. 15/04/2033                         | 1 550                               | 1 545                            | 0,06                      | 6,125 % éch. 15/05/2036          | 1 850                               | 1 852                            | 0,08                      |
| Icahn Enterprises LP                                |                                     |                                  |                           | Match Group Holdings LLC                        |                                     |                                  |                           | NuStar Logistics LP              |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/05/2027                             | 2 442                               | 2 415                            | 0,10                      | 4,625 % éch. 01/06/2028                         | 3 504                               | 3 458                            | 0,14                      | 6,375 % éch. 01/10/2030          | 3 000                               | 3 102                            | 0,13                      |
| 9,000 % éch. 15/06/2030                             | 1 400                               | 1 307                            | 0,05                      | 5,000 % éch. 15/12/2027                         | 3 735                               | 3 724                            | 0,15                      | OAK-Eagle Acquireco, Inc.        |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 15/01/2029                             | 1 350                               | 1 325                            | 0,05                      | Mauser Packaging Solutions Holding Co.          |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 01/07/2033          | € 575                               | 690                              | 0,03                      |
| 10,000 % éch. 15/11/2029                            | 1 600                               | 1 580                            | 0,07                      | 7,875 % éch. 15/04/2030                         | 3 550                               | 3 631                            | 0,15                      | 7,250 % éch. 01/07/2033          | \$ 4 625                            | 4 841                            | 0,20                      |
| Industrial F&B Investments, Inc.                    |                                     |                                  |                           | McGraw-Hill Education, Inc.                     |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 01/07/2034          | 4 150                               | 4 407                            | 0,18                      |
| 7,750 % éch. 11/02/2033                             | 4 125                               | 4 207                            | 0,17                      | 5,750 % éch. 01/08/2028                         | 2 550                               | 2 541                            | 0,11                      | Olin Corp.                       |                                     |                                  |                           |
| Ingevity Corp.                                      |                                     |                                  |                           | Meridian Arc Holdco LLC                         |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 01/04/2033          | 2 325                               | 2 299                            | 0,10                      |
| 3,875 % éch. 01/11/2028                             | 15 374                              | 14 903                           | 0,62                      | 6,250 % éch. 30/04/2031                         | 3 464                               | 3 474                            | 0,14                      | Olympus Water U.S. Holding Corp. |                                     |                                  |                           |
| Ingram Micro, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/02/2033          | € 3 725                             | 4 289                            | 0,18                      |
| 4,750 % éch. 15/05/2029                             | 2 300                               | 2 260                            | 0,09                      | 7,375 % éch. 15/02/2031                         | 1 600                               | 1 351                            | 0,06                      | 7,250 % éch. 15/02/2033          | \$ 9 125                            | 9 031                            | 0,37                      |
| Insulet Corp.                                       |                                     |                                  |                           | Michaels Cos., Inc.                             |                                     |                                  |                           | ON Semiconductor Corp.           |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/04/2033                             | 2 250                               | 2 284                            | 0,09                      | 8,500 % éch. 15/03/2033                         | 4 325                               | 4 286                            | 0,18                      | 3,875 % éch. 01/09/2028          | 4 550                               | 4 441                            | 0,18                      |
| ION Platform Finance U.S., Inc.                     |                                     |                                  |                           | Midwest Gaming Borrower LLC                     |                                     |                                  |                           | OneMain Finance Corp.            |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 30/09/2032                             | 8 225                               | 5 970                            | 0,25                      | 4,875 % éch. 01/05/2029                         | 3 020                               | 2 942                            | 0,12                      | 3,500 % éch. 15/01/2027          | 12 475                              | 12 375                           | 0,51                      |
| IQVIA, Inc.                                         |                                     |                                  |                           | Millrose Properties, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/09/2033          | 2 875                               | 2 850                            | 0,12                      |
| 2,250 % éch. 15/01/2028                             | € 4 425                             | 4 985                            | 0,21                      | 6,250 % éch. 15/09/2032                         | 3 050                               | 3 079                            | 0,13                      | Open Text Holdings, Inc.         |                                     |                                  |                           |
| 2,875 % éch. 15/06/2028                             | 3 100                               | 3 520                            | 0,15                      | 6,375 % éch. 01/08/2030                         | 2 125                               | 2 155                            | 0,09                      | 4,125 % éch. 15/02/2030 (i)      | 5 785                               | 5 304                            | 0,22                      |
| Iron Mountain Information Management Services, Inc. |                                     |                                  |                           | Miter Brands Acquisition Holdco, Inc.           |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 01/12/2031          | 600                                 | 527                              | 0,02                      |
| 5,000 % éch. 15/07/2032                             | \$ 3 100                            | 2 980                            | 0,12                      | 6,750 % éch. 01/04/2032                         | 760                                 | 754                              | 0,03                      | Option Care Health, Inc.         |                                     |                                  |                           |
| Iron Mountain, Inc.                                 |                                     |                                  |                           | MIWD Holdco LLC                                 |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 31/10/2029          | 775                                 | 745                              | 0,03                      |
| 4,875 % éch. 15/09/2027                             | 4 935                               | 4 929                            | 0,20                      | 5,500 % éch. 01/02/2030                         | 675                                 | 636                              | 0,03                      | Organon & Co.                    |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/03/2028                             | 450                                 | 450                              | 0,02                      | Molina Healthcare, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 30/04/2028          | € 2 900                             | 3 286                            | 0,14                      |
| 5,250 % éch. 15/07/2030                             | 800                                 | 789                              | 0,03                      | 3,875 % éch. 15/11/2030                         | 400                                 | 373                              | 0,02                      | 6,750 % éch. 15/05/2034          | \$ 1 475                            | 1 558                            | 0,06                      |
| 6,250 % éch. 15/01/2035                             | 2 925                               | 2 940                            | 0,12                      | 3,875 % éch. 15/05/2032                         | 375                                 | 339                              | 0,01                      | Outfront Media Capital LLC       |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 15/02/2029                             | 1 575                               | 1 606                            | 0,07                      | 4,375 % éch. 15/06/2028                         | 1 250                               | 1 229                            | 0,05                      | 6,000 % éch. 15/06/2034          | 2 725                               | 2 721                            | 0,11                      |
| Jane Street Group                                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/02/2031                         | 1 000                               | 1 019                            | 0,04                      | PacifiCorp                       |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 01/05/2033                             | 5 400                               | 5 556                            | 0,23                      |                                                 |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/08/2056          | 6 800                               | 6 757                            | 0,28                      |
| 7,125 % éch. 30/04/2031                             | 13 050                              | 13 500                           | 0,56                      |                                                 |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 15/09/2055          | 1 350                               | 1 365                            | 0,06                      |

## Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Par Petroleum LLC                                       | \$ 950                              | \$ 962                           | 0,04                      | Raven Acquisition Holdings LLC           | \$ 5 700                            | \$ 5 575                         | 0,23                      | Spirit Airlines Pass-Through Trust  | \$ 758                              | \$ 736                           | 0,03                      |
| 7,375 % éch. 01/06/2034                                 |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/11/2031                  |                                     |                                  |                           | 4,100 % éch. 01/10/2029             |                                     |                                  |                           |
| Paradigm Parent LLC and Paradigm Parent CO-Issuer, Inc. |                                     |                                  |                           | RB Global Holdings, Inc.                 |                                     |                                  |                           | SS&C Technologies, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| 8,750 % éch. 17/04/2032                                 | 825                                 | 739                              | 0,03                      | 7,750 % éch. 15/03/2031                  | 7 245                               | 7 520                            | 0,31                      | 5,500 % éch. 30/09/2027             | 10 100                              | 10 103                           | 0,42                      |
| Paramount Global                                        |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC           |                                     |                                  |                           | Stagwell Global LLC                 |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/02/2028                                 | 675                                 | 657                              | 0,03                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                  | 8 025                               | 8 003                            | 0,33                      | 5,625 % éch. 15/08/2029             | 7 850                               | 7 577                            | 0,31                      |
| 3,700 % éch. 01/06/2028                                 | 1 650                               | 1 601                            | 0,07                      | RFNA LP                                  |                                     |                                  |                           | Standard Industries, Inc.           |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 01/06/2029                                 | 1 150                               | 1 104                            | 0,05                      | 7,875 % éch. 15/02/2030                  | 850                                 | 857                              | 0,04                      | 4,750 % éch. 15/01/2028             | 6 150                               | 6 110                            | 0,25                      |
| 4,200 % éch. 19/05/2032                                 | 1 125                               | 977                              | 0,04                      | RHP Hotel Properties LP                  |                                     |                                  |                           | Staples, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 4,600 % éch. 15/01/2045                                 | 3 000                               | 1 912                            | 0,08                      | 5,750 % éch. 15/03/2034                  | 2 100                               | 2 082                            | 0,09                      | 10,750 % éch. 01/09/2029            | 1 850                               | 1 766                            | 0,07                      |
| 4,900 % éch. 15/08/2044                                 | 4 625                               | 3 059                            | 0,13                      | 6,500 % éch. 01/04/2032                  | 125                                 | 128                              | 0,01                      | Star Parent, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 15/01/2031                                 | 1 200                               | 1 116                            | 0,05                      | 7,250 % éch. 15/07/2028                  | 770                                 | 787                              | 0,03                      | 9,000 % éch. 01/10/2030             | 500                                 | 524                              | 0,02                      |
| 5,250 % éch. 01/04/2044                                 | 825                                 | 567                              | 0,02                      | Rivian Holdings LLC                      |                                     |                                  |                           | Starwood Property Trust, Inc.       |                                     |                                  |                           |
| 5,850 % éch. 01/09/2043                                 | 2 925                               | 2 192                            | 0,09                      | 10,000 % éch. 15/01/2031                 | 4 850                               | 4 835                            | 0,20                      | 4,375 % éch. 15/01/2027             | 350                                 | 350                              | 0,01                      |
| 6,250 % éch. 28/02/2057                                 | 375                                 | 306                              | 0,01                      | RLJ Lodging Trust LP                     |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/10/2028             | 1 575                               | 1 569                            | 0,06                      |
| 6,875 % éch. 30/04/2036                                 | 1 300                               | 1 220                            | 0,05                      | 3,750 % éch. 01/07/2026                  | 475                                 | 475                              | 0,02                      | 5,750 % éch. 15/01/2031             | 6 175                               | 6 144                            | 0,25                      |
| 7,875 % éch. 30/07/2030                                 | 750                                 | 788                              | 0,03                      | 4,000 % éch. 15/09/2029                  | 1 375                               | 1 310                            | 0,05                      | 6,000 % éch. 15/04/2030             | 275                                 | 276                              | 0,01                      |
| Park River Holdings, Inc.                               |                                     |                                  |                           | ROBLOX Corp.                             |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/06/2031             | 1 000                               | 1 006                            | 0,04                      |
| 8,000 % éch. 15/03/2031                                 | 750                                 | 757                              | 0,03                      | 3,875 % éch. 01/05/2030                  | 3 125                               | 2 955                            | 0,12                      | 6,500 % éch. 01/07/2030             | 2 000                               | 2 046                            | 0,08                      |
| Pattern Energy Operations LP                            |                                     |                                  |                           | Rocket Cos., Inc.                        |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/10/2030             | 1 600                               | 1 638                            | 0,07                      |
| 4,500 % éch. 15/08/2028                                 | 1 490                               | 1 460                            | 0,06                      | 6,125 % éch. 01/08/2030                  | 575                                 | 585                              | 0,02                      | Station Casinos LLC                 |                                     |                                  |                           |
| PBF Holding Co. LLC                                     |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/08/2031                  | 2 800                               | 2 862                            | 0,12                      | 4,500 % éch. 15/02/2028             | 3 673                               | 3 633                            | 0,15                      |
| 7,250 % éch. 01/06/2034                                 | 1 775                               | 1 758                            | 0,07                      | 6,375 % éch. 01/08/2033                  | 200                                 | 204                              | 0,01                      | 6,625 % éch. 15/03/2032             | 2 525                               | 2 566                            | 0,11                      |
| 7,875 % éch. 15/09/2030                                 | 1 500                               | 1 529                            | 0,06                      | 6,500 % éch. 01/08/2029                  | 5 100                               | 5 212                            | 0,22                      | Stingray Compute LLC                |                                     |                                  |                           |
| 9,875 % éch. 15/03/2030                                 | 2 825                               | 3 022                            | 0,13                      | 6,500 % éch. 15/06/2034                  | 1 125                               | 1 155                            | 0,05                      | 6,000 % éch. 15/06/2031             | 825                                 | 828                              | 0,03                      |
| Pebblebrook Hotel LP                                    |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 01/02/2032                  | 3 825                               | 3 972                            | 0,16                      | Stonepeak Nile Parent LLC           |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 15/10/2029                                 | 2 575                               | 2 620                            | 0,11                      | Rocket Mortgage LLC                      |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 15/03/2032             | 1 300                               | 1 347                            | 0,06                      |
| PennyMac Financial Services, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/03/2031                  | 1 000                               | 936                              | 0,04                      | Sunoco LP                           |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/02/2029                                 | 7 025                               | 6 712                            | 0,28                      | Rockies Express Pipeline LLC             |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/05/2029             | 25                                  | 24                               | 0,00                      |
| Performance Food Group, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 15/07/2029                  | 400                                 | 395                              | 0,02                      | 4,500 % éch. 01/10/2029             | 749                                 | 728                              | 0,03                      |
| 4,250 % éch. 01/08/2029                                 | 3 600                               | 3 496                            | 0,14                      | Roller Bearing Co. of America, Inc.      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/03/2031             | 4 325                               | 4 295                            | 0,18                      |
| 5,625 % éch. 01/03/2034                                 | 475                                 | 467                              | 0,02                      | 4,375 % éch. 15/10/2029                  | 2 750                               | 2 685                            | 0,11                      | 7,000 % éch. 01/05/2029             | 2 550                               | 2 622                            | 0,11                      |
| Permian Resources Operating LLC                         |                                     |                                  |                           | RR Donnelley & Sons Co.                  |                                     |                                  |                           | SV RNO Property Owner LLC           |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 01/07/2029                                 | 2 250                               | 2 251                            | 0,09                      | 9,500 % éch. 01/08/2029                  | 1 450                               | 1 505                            | 0,06                      | 5,875 % éch. 01/03/2031             | 1 700                               | 1 677                            | 0,07                      |
| PG&E Corp.                                              |                                     |                                  |                           | Sabre GLBL, Inc.                         |                                     |                                  |                           | Sword Purchaser LLC                 |                                     |                                  |                           |
| 6,850 % éch. 15/09/2056                                 | 2 700                               | 2 692                            | 0,11                      | 10,750 % éch. 15/11/2029                 | 1 165                               | 1 120                            | 0,05                      | 8,250 % éch. 15/04/2033             | 1 525                               | 1 579                            | 0,07                      |
| 7,375 % éch. 15/03/2055                                 | 1 925                               | 1 963                            | 0,08                      | 10,750 % éch. 15/03/2030                 | 810                                 | 773                              | 0,03                      | Synergy Infrastructure Holdings LLC |                                     |                                  |                           |
| Pioneer Opco LLC                                        |                                     |                                  |                           | Science Applications International Corp. |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/07/2034             | 675                                 | 685                              | 0,03                      |
| 7,000 % éch. 15/05/2033                                 | 900                                 | 917                              | 0,04                      | 5,875 % éch. 01/11/2033                  | 25                                  | 25                               | 0,00                      | 7,875 % éch. 01/12/2030             | 800                                 | 838                              | 0,03                      |
| Post Holdings, Inc.                                     |                                     |                                  |                           | SCIH Salt Holdings, Inc.                 |                                     |                                  |                           | Talen Energy Supply LLC             |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/09/2031                                 | 3 821                               | 3 586                            | 0,15                      | 4,875 % éch. 01/05/2028                  | 1 275                               | 1 258                            | 0,05                      | 6,250 % éch. 01/02/2034             | 4 500                               | 4 475                            | 0,19                      |
| 4,625 % éch. 15/04/2030                                 | 4 775                               | 4 616                            | 0,19                      | SCIL LLC                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/02/2036             | 900                                 | 908                              | 0,04                      |
| 6,500 % éch. 15/03/2036                                 | 3 950                               | 3 908                            | 0,16                      | 9,500 % éch. 15/07/2028                  | € 1 475                             | 1 744                            | 0,07                      | Tallgrass Energy Partners LP        |                                     |                                  |                           |
| PR RNO Property Owner LLC                               |                                     |                                  |                           | Service Properties Trust                 |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/09/2031             | 200                                 | 198                              | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 01/05/2031                                 | 5 625                               | 5 621                            | 0,23                      | 0,000 % éch. 30/09/2028 (d)              | \$ 1 965                            | 1 824                            | 0,08                      | 6,750 % éch. 15/03/2034             | 750                                 | 759                              | 0,03                      |
| PRA Group, Inc.                                         |                                     |                                  |                           | Sierra Pacific Power Co.                 |                                     |                                  |                           | Talos Production, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 31/01/2030                                 | 500                                 | 516                              | 0,02                      | 6,375 % éch. 15/09/2056                  | 2 475                               | 2 475                            | 0,10                      | 9,000 % éch. 01/02/2029             | 800                                 | 834                              | 0,03                      |
| Prime Healthcare Services, Inc.                         |                                     |                                  |                           | Simmons Foods, Inc.                      |                                     |                                  |                           | Teleflex, Inc.                      |                                     |                                  |                           |
| 9,375 % éch. 01/09/2029                                 | 2 125                               | 2 221                            | 0,09                      | 4,625 % éch. 01/03/2029                  | 3 475                               | 3 359                            | 0,14                      | 5,875 % éch. 15/01/2032             | 600                                 | 605                              | 0,03                      |
| Primo Water Holdings, Inc.                              |                                     |                                  |                           | Sirius XM Radio LLC                      |                                     |                                  |                           | Tenet Healthcare Corp.              |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 31/10/2028                                 | € 1 775                             | 2 031                            | 0,08                      | 3,125 % éch. 01/09/2026                  | 2 875                               | 2 867                            | 0,12                      | 5,125 % éch. 01/11/2027             | 1 246                               | 1 247                            | 0,05                      |
| 4,375 % éch. 30/04/2029                                 | \$ 4 575                            | 4 469                            | 0,18                      | 3,875 % éch. 01/09/2031                  | 8 225                               | 7 475                            | 0,31                      | 5,500 % éch. 15/11/2032             | 450                                 | 448                              | 0,02                      |
| 6,250 % éch. 01/04/2029                                 | 1 675                               | 1 682                            | 0,07                      | 4,125 % éch. 01/07/2030                  | 475                                 | 447                              | 0,02                      | 6,000 % éch. 15/11/2033             | 300                                 | 303                              | 0,01                      |
| PTC, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/08/2027                  | 1 996                               | 1 994                            | 0,08                      | 6,750 % éch. 15/05/2031             | 225                                 | 231                              | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 15/02/2028                                 | 1 250                               | 1 225                            | 0,05                      | 5,875 % éch. 15/04/2032                  | 6 875                               | 6 799                            | 0,28                      | TerraForm Power Operating LLC       |                                     |                                  |                           |
| Puget Energy, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | Six Flags Entertainment Corp.            |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/01/2030             | 1 300                               | 1 258                            | 0,05                      |
| 7,000 % éch. 15/09/2056                                 | 2 675                               | 2 707                            | 0,11                      | 7,250 % éch. 15/05/2031                  | 125                                 | 124                              | 0,01                      | Tidewater, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 15/09/2056                                 | 1 375                               | 1 404                            | 0,06                      | SLM Corp.                                |                                     |                                  |                           | 9,125 % éch. 15/07/2030             | 1 350                               | 1 446                            | 0,06                      |
| Qnity Electronics, Inc.                                 |                                     |                                  |                           | 6,495 % éch. 15/05/2032                  | 3 100                               | 3 100                            | 0,13                      | TK Elevator U.S. Newco, Inc.        |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/08/2032                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 31/01/2030                  | 400                                 | 406                              | 0,02                      | 5,250 % éch. 15/07/2027             | 200                                 | 200                              | 0,01                      |
| 6,250 % éch. 15/08/2033                                 | 25                                  | 25                               | 0,00                      | SM Energy Co.                            |                                     |                                  |                           | TopBuild Corp.                      |                                     |                                  |                           |
| Quikrete Holdings, Inc.                                 |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/01/2027                  | 1 500                               | 1 503                            | 0,06                      | 3,625 % éch. 15/03/2029             | 7 350                               | 7 350                            | 0,30                      |
| 6,375 % éch. 01/03/2032                                 | 5 100                               | 5 210                            | 0,22                      | 6,625 % éch. 15/04/2034                  | 1 100                               | 1 083                            | 0,04                      | 4,125 % éch. 15/02/2032             | 9 125                               | 9 241                            | 0,38                      |
| 6,750 % éch. 01/03/2033                                 | 2 150                               | 2 193                            | 0,09                      | 6,750 % éch. 01/08/2029                  | 625                                 | 637                              | 0,03                      | TransDigm, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| QXO Building Products, Inc.                             |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 01/07/2031                  | 1 200                               | 1 254                            | 0,05                      | 6,000 % éch. 15/01/2033             | 1 930                               | 1 950                            | 0,08                      |
| 6,500 % éch. 15/07/2031                                 | 1 250                               | 1 275                            | 0,05                      | 9,625 % éch. 15/06/2033                  | 2 850                               | 3 126                            | 0,13                      | 6,250 % éch. 31/01/2034             | 1 575                               | 1 608                            | 0,07                      |
| 6,750 % éch. 30/04/2032                                 | 5 550                               | 5 734                            | 0,24                      | Smyrna Ready Mix Concrete LLC            |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 01/12/2031             | 370                                 | 384                              | 0,02                      |
| 6,875 % éch. 15/07/2034                                 | 1 550                               | 1 592                            | 0,07                      | 6,000 % éch. 01/11/2028                  | 2 225                               | 2 231                            | 0,09                      | Travel & Leisure Co.                |                                     |                                  |                           |
| Radiology Partners, Inc.                                |                                     |                                  |                           | Snap, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/09/2033             | 657                                 | 651                              | 0,03                      |
| 8,500 % éch. 15/07/2032                                 | 250                                 | 261                              | 0,01                      | 6,875 % éch. 01/03/2033                  | 5 100                               | 4 974                            | 0,21                      | 6,250 % éch. 01/06/2031             | 4 000                               | 4 027                            | 0,17                      |
| Rain Carbon, Inc.                                       |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/03/2034                  | 3 975                               | 3 851                            | 0,16                      | TriNet Group, Inc.                  |                                     |                                  |                           |
| 12,250 % éch. 01/09/2029                                | 800                                 | 854                              | 0,04                      | Solaris Energy Infrastructure LLC        |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/03/2029             | 1 506                               | 1 422                            | 0,06                      |
| Rand Parent LLC                                         |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/05/2031                  | 700                                 | 708                              | 0,03                      | Tutor Perini Corp.                  |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/02/2030                                 | 1 275                               | 1 322                            | 0,05                      | Sotheby's                                |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/07/2033 (a)         | 7 007                               | 7 056                            | 0,29                      |
| Range Resources Corp.                                   |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 15/04/2031                  | 1 350                               | 1 344                            | 0,06                      | TXNM Energy, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/02/2030                                 | 900                                 | 882                              | 0,04                      | Speedway Motorsports LLC                 |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 31/07/2056             | 3 025                               | 3 059                            | 0,13                      |
|                                                         |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 01/11/2027                  | 3 932                               | 3 899                            | 0,16                      |                                     |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| U.S. Acute Care Solutions LLC<br>9,750 % éch. 15/05/2029      | \$ 5 800                            | \$ 5 476                         | 0,23                      | VoltaGrid LLC<br>7,375 % éch. 01/11/2030                                                                                | \$ 325                              | \$ 338                           | 0,01                      | Renaissance Holding Corp.<br>7,663 % éch. 05/04/2030                                                 | \$ 4 420                            | \$ 3 524                         | 0,15                      |
| U.S. Foods, Inc.<br>6,875 % éch. 15/09/2028                   | 476                                 | 487                              | 0,02                      | Vornado Realty LP<br>5,750 % éch. 01/02/2033                                                                            | 2 525                               | 2 535                            | 0,10                      | Spirit Airlines, Inc.<br>0,000 % éch. 14/07/2026                                                     | 1 610                               | 948                              | 0,04                      |
| 7,250 % éch. 15/01/2032                                       | 1 100                               | 1 143                            | 0,05                      | Voyager Parent LLC<br>9,250 % éch. 01/07/2032                                                                           | 3 351                               | 3 546                            | 0,15                      | Stepstone Group Midco GmbH<br>8,176 % - 8,179 % éch.<br>19/12/2031                                   | 3 663                               | 2 969                            | 0,12                      |
| UGI International LLC<br>2,500 % éch. 01/12/2029              | € 2 780                             | 3 014                            | 0,12                      | Wayfair LLC<br>7,125 % éch. 31/05/2034                                                                                  | 325                                 | 334                              | 0,01                      | TransDigim, Inc.<br>5,894 % éch. 22/03/2030                                                          | 185                                 | 185                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 01/06/2031                                       | 2 750                               | 3 216                            | 0,13                      | 7,250 % éch. 31/10/2029                                                                                                 | 1 175                               | 1 214                            | 0,05                      | 6,144 % éch. 28/02/2031                                                                              | 15 234                              | 15 254                           | 0,63                      |
| UKG, Inc.<br>6,875 % éch. 01/02/2031                          | \$ 5 650                            | 5 493                            | 0,23                      | 7,750 % éch. 15/09/2030                                                                                                 | 4 200                               | 4 418                            | 0,18                      | 6,144 % éch. 19/01/2032                                                                              | 1 053                               | 1 054                            | 0,04                      |
| United Rentals North America, Inc.<br>3,875 % éch. 15/02/2031 | 2 675                               | 2 529                            | 0,10                      | WBI Operating LLC<br>6,250 % éch. 15/10/2030                                                                            | 1 825                               | 1 836                            | 0,08                      | 6,144 % éch. 19/08/2032                                                                              | 3 035                               | 3 039                            | 0,13                      |
| 3,875 % éch. 15/11/2033                                       | 1 300                               | 1 281                            | 0,05                      | WEX, Inc.<br>6,500 % éch. 15/03/2033                                                                                    | 825                                 | 822                              | 0,03                      | 6,144 % éch. 13/02/2033                                                                              | 925                                 | 926                              | 0,04                      |
| 6,125 % éch. 15/03/2034                                       | 2 125                               | 2 181                            | 0,09                      | Whirlpool Corp.<br>6,125 % éch. 15/06/2030                                                                              | 475                                 | 439                              | 0,02                      | U.S. Renal Care, Inc.<br>8,758 % éch. 28/06/2028                                                     | 2 013                               | 1 984                            | 0,08                      |
| United Wholesale Mortgage LLC<br>5,750 % éch. 15/06/2027      | 1 615                               | 1 600                            | 0,07                      | 6,500 % éch. 15/06/2033                                                                                                 | 1 575                               | 1 367                            | 0,06                      |                                                                                                      |                                     | 43 697                           | 1,81                      |
| Uniti Group LP<br>4,750 % éch. 15/04/2028                     | 1 375                               | 1 372                            | 0,06                      | Windstream Services LLC<br>8,250 % éch. 01/10/2031                                                                      | 3 505                               | 3 698                            | 0,15                      | Obligations du Trésor américain<br>4,875 % éch. 15/08/2045                                           | 775                                 | 770                              | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 15/01/2030                                       | 425                                 | 416                              | 0,02                      | WR Grace Holdings LLC<br>5,625 % éch. 15/08/2029                                                                        | 375                                 | 353                              | 0,01                      | Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 31/03/2028                                               | 19 225                              | 19 133                           | 0,79                      |
| 8,625 % éch. 15/06/2032                                       | 2 350                               | 2 454                            | 0,10                      | 6,625 % éch. 15/08/2032                                                                                                 | 1 825                               | 1 771                            | 0,07                      | 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                              | 635                                 | 619                              | 0,03                      |
| Uniti Services LLC<br>7,500 % éch. 15/10/2033                 | 3 100                               | 3 264                            | 0,14                      | 7,000 % éch. 01/08/2033                                                                                                 | 1 625                               | 1 584                            | 0,07                      |                                                                                                      |                                     | 20 522                           | 0,85                      |
| Univision Communications, Inc.<br>4,500 % éch. 01/05/2029     | 1 175                               | 1 123                            | 0,05                      | WS Escrow LLC<br>7,750 % éch. 01/06/2033                                                                                | 1 475                               | 1 516                            | 0,06                      | ACTIONS                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 31/07/2031                                       | 2 600                               | 2 613                            | 0,11                      | WULF Compute LLC<br>7,750 % éch. 15/10/2030                                                                             | 2 075                               | 2 181                            | 0,09                      | Spirit Aviation Holdings, Inc.<br>- Exp.11/03/2035                                                   | 94 392                              | 3                                | 0,00                      |
| 8,875 % éch. 15/04/2033                                       | 1 275                               | 1 256                            | 0,05                      | Wyndham Hotels & Resorts, Inc.<br>4,375 % éch. 15/08/2028                                                               | 3 866                               | 3 812                            | 0,16                      | Total États-Unis                                                                                     |                                     | 1 430 058                        | 59,15                     |
| 9,375 % éch. 01/08/2032                                       | 3 975                               | 4 042                            | 0,17                      | Wynn Las Vegas LLC<br>5,250 % éch. 15/05/2027                                                                           | 9 875                               | 9 876                            | 0,41                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| USA Compression Partners LP<br>7,125 % éch. 15/03/2029        | 100                                 | 102                              | 0,00                      | Wynn Resorts Finance LLC<br>7,125 % éch. 15/02/2031 (i)                                                                 | 5 650                               | 5 974                            | 0,25                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                                                  |                                     |                                  |                           |
| UWM Holdings LLC<br>6,250 % éch. 15/03/2031                   | 600                                 | 535                              | 0,02                      | XPLR Infrastructure Operating Partners LP<br>8,625 % éch. 15/03/2033                                                    | 650                                 | 697                              | 0,03                      | Discovery Global Holdings, Inc.<br>3,755 % éch. 15/03/2027                                           | \$ 1 700                            | 1 689                            | 0,07                      |
| Valvoline, Inc.<br>3,625 % éch. 15/06/2031                    | 925                                 | 854                              | 0,04                      | Yum! Brands, Inc.<br>3,625 % éch. 15/03/2031                                                                            | 2 575                               | 2 398                            | 0,10                      | Kona Spc Ltd.<br>5,718 % éch. 15/09/2026                                                             | € 1 000                             | 1 144                            | 0,05                      |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>3,875 % éch. 01/11/2033  | 4 500                               | 4 014                            | 0,17                      | 6,875 % éch. 15/11/2037                                                                                                 | 100                                 | 109                              | 0,00                      | Total des Instruments à court terme                                                                  |                                     | 2 833                            | 0,12                      |
| 3,875 % éch. 15/12/2034                                       | 1 025                               | 963                              | 0,04                      | Zayo Group Holdings, Inc. (5,750 % en numéraire et 3,500 % de<br>rémunération en nature)<br>9,250 % éch. 09/03/2030 (b) | 721                                 | 720                              | 0,03                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 15/08/2031                                       | 1 025                               | 963                              | 0,04                      | ZF North America Capital, Inc.<br>6,750 % éch. 23/04/2030                                                               | 1 250                               | 1 241                            | 0,05                      | Total des Valeurs mobilières                                                                         | \$ 2 193 051                        | 90,71                            |                           |
| 6,000 % éch. 01/05/2036                                       | 2 550                               | 2 579                            | 0,11                      | 7,125 % éch. 14/04/2030                                                                                                 | 275                                 | 278                              | 0,01                      | ACTIONS                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Venture Global LNG, Inc.<br>6,375 % éch. 15/12/2034           | 6 025                               | 5 925                            | 0,25                      | 7,500 % éch. 24/03/2031                                                                                                 | 3 430                               | 3 456                            | 0,14                      | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series plc -<br>Fonds PIMCO<br>European High Yield<br>Bond Fund (f) | 5 305 278                           | 80 975                           | 3,35                      |
| 6,625 % éch. 15/06/2036                                       | 1 975                               | 1 948                            | 0,08                      | ZipRecruiter, Inc.<br>5,000 % éch. 15/01/2030                                                                           | 965                                 | 750                              | 0,03                      | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series plc -<br>Fonds Global High<br>Yield Bond ESG<br>Fund (f)     | 452 848                             | 5 240                            | 0,22                      |
| 7,000 % éch. 15/01/2030                                       | 11 175                              | 11 403                           | 0,47                      | ZoomInfo Technologies LLC<br>3,875 % éch. 01/02/2029                                                                    | 850                                 | 692                              | 0,03                      | PIMCO Select Funds plc -<br>Fonds PIMCO<br>US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (f)             | 5 028 574                           | 50 146                           | 2,07                      |
| 9,500 % éch. 01/02/2029                                       | 3 550                               | 3 823                            | 0,16                      |                                                                                                                         |                                     | 1 365 830                        | 56,49                     | Total des Fonds d'investissement                                                                     |                                     | \$136 361                        | 5,64                      |
| Venture Global Plaquemines LNG LLC<br>6,125 % éch. 15/12/2030 | 5 325                               | 5 451                            | 0,23                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/01/2034                                       | 2 775                               | 2 893                            | 0,12                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/06/2034                                       | 4 025                               | 4 195                            | 0,17                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 15/01/2036                                       | 3 575                               | 3 792                            | 0,16                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 01/05/2033                                       | 850                                 | 933                              | 0,04                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Veritiv Operating Co.<br>10,500 % éch. 30/11/2030             | 1 600                               | 1 638                            | 0,07                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Versant Media Group, Inc.<br>7,250 % éch. 30/01/2031          | 2 575                               | 2 666                            | 0,11                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| VF Corp.<br>0,250 % éch. 25/02/2028                           | € 4 600                             | 4 981                            | 0,21                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| VFH Parent LLC<br>7,500 % éch. 15/06/2031                     | \$ 2 175                            | 2 276                            | 0,09                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Viacom, Inc.<br>4,375 % éch. 15/03/2043                       | 450                                 | 291                              | 0,01                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Victra Holdings LLC<br>8,750 % éch. 15/09/2029                | 1 500                               | 1 548                            | 0,06                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| VM Consolidated, Inc.<br>5,500 % éch. 15/04/2029              | 2 000                               | 1 766                            | 0,07                      |                                                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                            | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                   | 3,660 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 72 800            | Billets du Trésor américain 0,375 %<br>éch. 30/09/2027 | \$ (74 304)      | \$ 72 800                                | \$ 72 807                                                          | 3,01                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                        | \$ (74 304)      | \$ 72 800                                | \$ 72 807                                                          | 3,01                |

(1) Comprend les intérêts courus.

## Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026           | 505                | \$ (296)                          | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 103                | (158)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026           | 683                | 64                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 72                 | (11)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 1 754              | 375                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 1 802              | 1 498                             | 0,06                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 318                | 26                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 58                 | (103)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 118                | 400                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 19                 | 41                                | 0,00                |
|                                                                                               |       |                   |                    | <b>\$ 1 836</b>                   | <b>0,08</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | <b>\$ 1 836</b>                   | <b>0,08</b>         |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 1 325                         | \$ 7                              | 0,00                |
| Newell Brands, Inc.             | 1,000                | 20/06/2028      | 950                              | 103                               | 0,00                |
| Worldline S.A.                  | 5,000                | 20/12/2030      | € 4 800                          | 107                               | 0,01                |
|                                 |                      |                 |                                  | <b>\$ 217</b>                     | <b>0,01</b>         |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | \$ 19 919                        | \$ 594                            | 0,03                |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                | 20/06/2031      | 81 725                           | 707                               | 0,03                |
|                                |                      |                 |                                  | <b>\$ 1 301</b>                   | <b>0,06</b>         |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 %   | 18/06/2055      | \$ 5 150          | \$ 256                            | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,325     | 31/08/2030      | 10 310            | 183                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2026      | 31 500            | (212)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 34 000            | 1 692                             | 0,07                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 15/05/2032      | 37 049            | 476                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2033      | 19 375            | 241                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,916     | 15/11/2053      | 24 700            | 1 193                             | 0,05                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 553               | 19                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 3 440             | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,083     | 15/11/2053      | 750               | 16                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,500     | 16/09/2031      | € 64 700          | (873)                             | (0,04)              |
|                                                    |                               |           |                 |                   | <b>\$ 2 978</b>                   | <b>0,12</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | <b>\$ 4 496</b>                   | <b>0,19</b>         |

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

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

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 124         | \$ 89             | \$ 3               | \$ 0                  | \$ 3                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 108          | CAD 153           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 702             | SGD 896           | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 153         | \$ 108            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | € 506           | 589               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 22 225       | € 19 095          | 0                  | (394)                 | (394)                                   | (0,02)              |
| BPS          | 07/2026           | € 4 052         | \$ 4 622          | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 876        | £ 2 140           | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD 4           | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 284           | 326               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 26 965        | 36 258            | 469                | (1)                   | 468                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | SGD 231         | 181               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 102        | € 1 843           | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 843         | \$ 2 105          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 218          | £ 165             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | 10 382          | CAD 14 774        | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 14 753      | \$ 10 382         | 0                  | (31)                  | (31)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 538         | 383               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 481         | 377               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 2           | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 25 958        | 30 165            | 487                | 0                     | 487                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 253          | AUD 367           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 77              | CHF 60            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 26 965          | € 23 362          | 0                  | (255)                 | (255)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | AUD 367         | \$ 253            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 840           | 959               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £ 102           | 135               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 4           | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 344          | € 301             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 626           | £ 2 744           | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 175             | SGD 226           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 4 993           | £ 3 736           | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 472 711       | \$ 551 436        | 10 985             | 0                     | 10 985                                  | 0,45                |
|              | 07/2026           | £ 174           | 230               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 184         | 142               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 205          | AUD 297           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 521 014         | € 458 031         | 2 656              | (4)                   | 2 652                                   | 0,11                |
|              | 08/2026           | AUD 297         | \$ 205            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 457 870       | 521 534           | 0                  | (2 650)               | (2 650)                                 | (0,11)              |
|              | 08/2026           | \$ 230          | £ 174             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 142             | SGD 184           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 15 187      | \$ 11 013         | 309                | 0                     | 309                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 1 843         | 2 091             | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 95           | CAD 135           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 27 660          | £ 20 925          | 113                | 0                     | 113                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 135         | \$ 95             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 3 052         | 3 484             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 20 925        | 27 659            | 0                  | (113)                 | (113)                                   | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 60          | 74                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 74           | CHF 60            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 15 109          | \$ (3 576)            | \$ 11 533                               | 0,48                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et Institutions en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | \$ 9 203        | CHF 7 193         | \$ 0               | \$ (285)              | \$ (285)                                | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF 43          | \$ 53             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$10 199        | CHF 7 987         | 0                  | (297)                 | (297)                                   | (0,02)              |
| SOG          | 07/2026           | CHF 7 822       | \$ 9 669          | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9 669        | CHF 7 794         | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 9 930           | 7 806             | 0                  | (253)                 | (253)                                   | (0,01)              |
| WST          | 07/2026           | CHF 7 799       | \$ 9 659          | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9 659        | CHF 7 771         | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 37              | \$ (872)              | \$ (835)                                | (0,04)              |



## Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 64           | € 55              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 17 177        | \$ 19 579         | 0                  | (59)                  | (59)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 380 175      | € 326 418         | 10                 | (6 992)               | (6 982)                                 | (0,29)              |
| BSH          | 07/2026           | € 260           | \$ 302            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 356 038      | € 305 367         | 0                  | (6 911)               | (6 911)                                 | (0,29)              |
| CBK          | 07/2026           | € 328           | \$ 382            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 670        | € 4 861           | 0                  | (112)                 | (112)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 308 224       | \$ 351 529        | 0                  | (864)                 | (864)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | \$ 352 003      | € 308 224         | 862                | 0                     | 862                                     | 0,04                |
| MBC          | 07/2026           | € 331 145       | \$ 376 226        | 79                 | (2 451)               | (2 372)                                 | (0,10)              |
|              | 07/2026           | \$ 11 398       | € 9 905           | 0                  | (73)                  | (73)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 10 669        | \$ 12 183         | 0                  | (31)                  | (31)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 371 750      | € 326 861         | 2 453              | 0                     | 2 453                                   | 0,10                |
| SOG          | 07/2026           | € 326 861       | \$ 371 805        | 0                  | (1 896)               | (1 896)                                 | (0,08)              |
|              | 07/2026           | \$ 375 561      | € 321 944         | 0                  | (7 484)               | (7 484)                                 | (0,31)              |
|              | 08/2026           | 372 309         | 326 861           | 1 893              | 0                     | 1 893                                   | 0,08                |
| SSB          | 07/2026           | 17 607          | 15 444            | 50                 | 0                     | 50                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 15 444        | \$ 17 631         | 0                  | (49)                  | (49)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 5 359           | \$ 26 923)            | \$ (21 564)                             | (0,89)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 171 518      | £ 127 758         | \$ 0               | \$ (1 951)            | \$ (1 951)                              | (0,08)              |
| BOA          | 07/2026           | 147             | 110               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 54 675        | \$ 72 115         | 0                  | (453)                 | (453)                                   | (0,02)              |
|              | 07/2026           | \$ 188 474      | £ 140 647         | 0                  | (1 800)               | (1 800)                                 | (0,07)              |
|              | 08/2026           | £ 1 185         | \$ 1 567          | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 65 126       | £ 49 384          | 417                | 0                     | 417                                     | 0,02                |
| BRC          | 07/2026           | £ 1 593         | \$ 2 105          | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 18 918          | 25 405            | 297                | 0                     | 297                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 156          | £ 116             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 99 884        | \$ 134 206        | 1 636              | 0                     | 1 636                                   | 0,07                |
|              | 07/2026           | \$ 760          | £ 575             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 575           | \$ 760            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 185 343      | £ 138 125         | 0                  | (2 017)               | (2 017)                                 | (0,08)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 2 227         | \$ 2 955          | 8                  | (9)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 391          | £ 291             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 224             | 167               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 11 292        | \$ 14 861         | 0                  | (127)                 | (127)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 14 861       | £ 11 292          | 127                | 0                     | 127                                     | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | £ 110 927       | \$ 147 498        | 481                | (212)                 | 269                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 276          | £ 205             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 76 925          | 58 120            | 213                | 0                     | 213                                     | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | £ 111 752       | \$ 148 880        | 919                | (362)                 | 557                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 162          | £ 123             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 123           | \$ 162            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 76 438       | £ 57 865          | 362                | 0                     | 362                                     | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | 2 923           | 2 211             | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 2 211         | \$ 2 923          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 476           | \$ (6 975)            | \$ (2 499)                              | (0,10)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 1 155        | SGD 1 473         | \$ 0               | \$ (16)               | \$ (16)                                 | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD 6 806       | \$ 5 259          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 048        | SGD 3 892         | 0                  | (38)                  | (38)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 5 259           | 6 791             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 637             | 823               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD 69          | \$ 53             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 180          | SGD 232           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SGD 10 361      | \$ 8 009          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 116        | SGD 2 699         | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 8 009           | 10 337            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 7 196       | \$ 5 549          | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 554        | SGD 4 534         | 0                  | (49)                  | (49)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 5 549           | 7 179             | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SGD 15          | \$ 12             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 123        | SGD 6 631         | 4                  | (1)                   | 3                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 1 640           | 2 127             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| NSL                                                | 07/2026           | SGD 422         | \$ 326            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 326          | SGD 421           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RBC                                                | 07/2026           | 644             | 833               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL                                                | 07/2026           | 4 972           | 6 437             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | SGD 9 681       | \$ 7 473          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 4            | SGD 6             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 7 466           | 9 650             | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | 12 417          | 16 104            | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 1 732           | 2 236             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 77              | \$ (164)              | \$ (87)                                 | (0,01)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (13 452)                             | (0,56)              |

| DESCRIPTION                            | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>        |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim             | \$ 4 900                      | \$ 1 727                   | 0,07                |
| Total des Autres actifs financiers     |                               | \$ 1 727                   | 0,07                |
| Total des Investissements              |                               | \$ 2 396 819               | 99,14               |
| Autres actifs et passifs à court terme |                               | \$ 20 838                  | 0,86                |
| Actif net                              |                               | \$ 2 417 657               | 100,00              |

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

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- μ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.
- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (d) Titre à coupon zéro.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,30 %) :

| Description de l'émetteur    | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|------------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Mahle GmbH                   | 7,125 % | 15/07/2032      | 10/06/2026   | \$ 1 086 | \$ 1 086     | 0,05                |
| Miller Homes Group Finco PLC | 6,533   | 15/10/2030      | 02/04/2025   | 1 739    | 1 833        | 0,08                |
|                              |         |                 |              | \$ 2 825 | \$ 2 919     | 0,13                |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 16 486 \$ (31 décembre 2025 : 48 539 \$) et un montant en numéraire de 3 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 460 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2025 : 72 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 27 288 \$ (31 décembre 2025 : 37 403 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 22 470 \$ (31 décembre 2025 : 1 020 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 6                                                                              | \$ 2 179 246                                         | \$ 13 799                                         | \$ 2 193 051        |
| Fonds d'investissement                        | 136 361                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 136 361             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 72 800                                               | 0                                                 | 72 800              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (350)                                                                             | (6 770)                                              | 0                                                 | (7 120)             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 1 727                                                | 0                                                 | 1 727               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 136 017</b>                                                                 | <b>\$ 2 247 003</b>                                  | <b>\$ 13 799</b>                                  | <b>\$ 2 396 819</b> |



## Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 4                                                                              | \$ 2 424 278                                         | \$ 15 346                                         | \$ 2 439 628        |
| Fonds d'investissement                        | 144 933                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 144 933             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 257 000                                              | 0                                                 | 257 000             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (31)                                                                              | 19 267                                               | 15                                                | 19 251              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 1 446                                                | 0                                                 | 1 446               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 144 906</b>                                                                 | <b>\$ 2 701 991</b>                                  | <b>\$ 15 361</b>                                  | <b>\$ 2 862 258</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,500 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (2 244)       | \$ (2 245)                               | (0,09)              |
|                                               | 3,550          | 24/06/2026        | 08/09/2026         | (752)            | (753)                                    | (0,03)              |
| BPS                                           | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 839)        | (2 104)                                  | (0,09)              |
|                                               | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 023)          | (1 170)                                  | (0,05)              |
| BRC                                           | 1,600          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (596)            | (682)                                    | (0,03)              |
|                                               | 1,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 539)          | (4 049)                                  | (0,17)              |
|                                               | 2,650          | 01/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | £ (207)          | (276)                                    | (0,01)              |
| JML                                           | (1,000)        | 20/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (506)         | (505)                                    | (0,02)              |
|                                               | (0,750)        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (533)          | (609)                                    | (0,03)              |
| MYI                                           | 0,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (495)            | (566)                                    | (0,02)              |
|                                               | 1,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 156)          | (2 466)                                  | (0,10)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (15 425)</b>                       | <b>(0,64)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (1 974)                                                 | \$ 2 680                | \$ 706                            | \$ 4 483                                                   | \$ (5 210)              | \$ (727)                          |
| BOA          | (423)                                                      | 350                     | (73)                              | (65)                                                       | 0                       | (65)                              |
| BPS          | (8 930)                                                    | 9 710                   | 780                               | 136                                                        | 0                       | 136                               |
| BRC          | (9)                                                        | 0                       | (9)                               | 9 175                                                      | (9 980)                 | (805)                             |
| BSH          | (6 906)                                                    | 7 220                   | 314                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| CBK          | 191                                                        | (260)                   | (69)                              | 197                                                        | 0                       | 197                               |
| DUB          | (29)                                                       | 0                       | (29)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| FAR          | 2 057                                                      | (2 300)                 | (243)                             | (1 017)                                                    | 1 020                   | 3                                 |
| GLM          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 147                                                        | (170)                   | (23)                              |
| GST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 15                                                         | (20)                    | (5)                               |
| JPM          | (2 286)                                                    | 2 510                   | 224                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| MBC          | (94)                                                       | 0                       | (94)                              | 4 111                                                      | (4 500)                 | (389)                             |
| MYI          | 19                                                         | 0                       | 19                                | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| RYL          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 444                                                        | (590)                   | (146)                             | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SOG          | 4 419                                                      | (4 600)                 | (181)                             | 1 973                                                      | (2 260)                 | (287)                             |
| SSB          | 31                                                         | 0                       | 31                                | 395                                                        | (290)                   | 105                               |
| UAG          | 33                                                         | 0                       | 33                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 25,50            | 25,17                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 60,26            | 56,35                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,32             | 0,04                 |
| Fonds d'investissement                                           | 5,35             | 4,85                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 2,86             | 8,59                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,09             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,22             | 0,07                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,98             | 1,00                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,07             | 0,05                 |
| Autres actifs                                                    | 4,35             | 3,87                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                                | 0,48             | 0,17                 |
| Autriche                                                                                                 | 0,65             | 0,34                 |
| Belgique                                                                                                 | 0,22             | 0,29                 |
| Bermudes                                                                                                 | 2,84             | 2,61                 |
| Canada                                                                                                   | 2,66             | 3,02                 |
| Îles Caïmans                                                                                             | 0,15             | 0,33                 |
| Finlande                                                                                                 | 0,37             | 0,35                 |
| France                                                                                                   | 2,02             | 2,28                 |
| Allemagne                                                                                                | 2,57             | 2,80                 |
| Irlande                                                                                                  | 0,16             | 0,12                 |
| Île de Man                                                                                               | 0,26             | 0,25                 |
| Israël                                                                                                   | 0,08             | 0,07                 |
| Italie                                                                                                   | 2,99             | 2,15                 |
| Japon                                                                                                    | 1,57             | 1,16                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                             | 0,28             | 0,35                 |
| Luxembourg                                                                                               | 2,35             | 3,10                 |
| Îles Marshall                                                                                            | 0,03             | 0,10                 |
| Mexique                                                                                                  | 0,11             | 0,10                 |
| Multinationales                                                                                          | 2,14             | 1,93                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 3,35             | 3,17                 |
| Norvège                                                                                                  | 0,84             | 0,36                 |
| Panama                                                                                                   | S/O              | 0,40                 |
| Pologne                                                                                                  | 0,22             | 0,06                 |
| Singapour                                                                                                | 0,22             | 0,25                 |
| Slovénie                                                                                                 | S/O              | 0,19                 |
| Espagne                                                                                                  | 0,86             | 0,52                 |
| Suède                                                                                                    | 1,17             | 1,11                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 2,85             | 4,52                 |
| États-Unis                                                                                               | 59,15            | 52,95                |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,12             | 0,04                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 5,64             | 5,05                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 3,01             | 8,96                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,08             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01             | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,06             | 0,03                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,12             | (0,01)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O              | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,48             | (0,35)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,04)           | 1,03                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,07             | 0,05                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 0,86             | 0,18                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                          |                                     |                                  |                           |
| <b>AUSTRALIE</b>                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Fortescue Treasury Pty. Ltd.                       |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 01/04/2031                            | \$ 6                                | \$ 6                             | 0,02                      |
| 5,875 % éch. 15/04/2030                            | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| 6,125 % éch. 15/04/2032                            | 17                                  | 17                               | 0,06                      |
| PLS Group Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 01/05/2031                            | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
| Total Australie                                    |                                     | 74                               | 0,27                      |
| <b>AUTRICHE</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| ams-OSRAM AG                                       |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 31/05/2032                            | € 200                               | 236                              | 0,87                      |
| <b>BERMUDES</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Carnival Corp.                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/02/2033                            | \$ 25                               | 25                               | 0,09                      |
| Carnival Corp. Ltd.                                |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 01/05/2029                            | 150                                 | 150                              | 0,56                      |
| 5,875 % éch. 15/06/2031                            | 50                                  | 51                               | 0,19                      |
| NCL Corp. Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 01/02/2032                            | 120                                 | 120                              | 0,44                      |
| Viking Cruises Ltd.                                |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/10/2028                            | 10                                  | 10                               | 0,04                      |
| 9,125 % éch. 15/07/2031                            | 85                                  | 89                               | 0,33                      |
| VOC Escrow Ltd.                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 15/02/2028                            | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| Total Bermudes                                     |                                     | 470                              | 1,74                      |
| <b>CANADA</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| B.C. Unlimited Liability Co.                       |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/01/2028                            | 125                                 | 123                              | 0,45                      |
| 4,000 % éch. 15/10/2030                            | 70                                  | 66                               | 0,24                      |
| Bombardier, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 01/07/2031                            | 10                                  | 10                               | 0,04                      |
| Brookfield Property Finance ULC                    |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 13/02/2028                            | CAD 75                              | 55                               | 0,20                      |
| GFL Environmental, Inc.                            |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 15/01/2031                            | \$ 135                              | 139                              | 0,51                      |
| goeasy Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 01/10/2030                            | 50                                  | 45                               | 0,17                      |
| Rogers Communications, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| 7,125 % éch. 15/04/2055                            | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
|                                                    |                                     | 464                              | 1,71                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement canadien |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 01/06/2033                            | CAD 50                              | 34                               | 0,13                      |
| Total Canada                                       |                                     | 498                              | 1,84                      |
| <b>DANEMARK</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| TDC Net A/S                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/06/2031                            | € 100                               | 126                              | 0,47                      |
| <b>FINLANDE</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Ahlstrom Holding Oy                                |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 04/02/2028                            | \$ 100                              | 99                               | 0,37                      |
| <b>FRANCE</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           |
| CAB SELAS                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 09/08/2031                            | € 100                               | 115                              | 0,43                      |
| Électricité de France S.A.                         |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 29/11/2033                            | 100                                 | 95                               | 0,35                      |
| Total France                                       |                                     | 210                              | 0,78                      |

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ALLEMAGNE</b>                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH          |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/05/2030                | € 100                               | \$ 118                           | 0,44                      |
| Novelis Sheet Ingot GmbH               |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/04/2029                | 30                                  | 34                               | 0,12                      |
| Schaeffler AG                          |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 13/05/2033                | 200                                 | 232                              | 0,86                      |
| Total Allemagne                        |                                     | 384                              | 1,42                      |
| <b>IRLANDE</b>                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Perrigo Finance Unlimited Co.          |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 15/06/2030                | \$ 25                               | 24                               | 0,09                      |
| 6,125 % éch. 30/09/2032                | 55                                  | 53                               | 0,19                      |
| Total Irlande                          |                                     | 77                               | 0,28                      |
| <b>ITALIE</b>                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA    |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/03/2029                | € 100                               | 117                              | 0,43                      |
| Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC       |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/02/2032                | \$ 60                               | 60                               | 0,22                      |
| Fibercop SpA                           |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 30/06/2030                | € 100                               | 117                              | 0,43                      |
| 6,375 % éch. 15/11/2033                | \$ 50                               | 50                               | 0,19                      |
| 7,200 % éch. 18/07/2036                | 75                                  | 77                               | 0,28                      |
| Gruppo San Donato SpA                  |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 31/10/2031                | € 100                               | 113                              | 0,42                      |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA   |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 13/10/2032                | 100                                 | 110                              | 0,41                      |
| Kedrion SpA                            |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/09/2029                | \$ 25                               | 25                               | 0,09                      |
| Webuild SpA                            |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 03/07/2031                | € 100                               | 115                              | 0,43                      |
| Total Italie                           |                                     | 784                              | 2,90                      |
| <b>JAPON</b>                           |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Nissan Motor Co. Ltd.                  |                                     |                                  |                           |
| 4,345 % éch. 17/09/2027                | \$ 25                               | 25                               | 0,09                      |
| 7,500 % éch. 17/07/2030                | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
| Rakuten Group, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| 8,125 % éch. 15/12/2029 (d)            | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
| 9,750 % éch. 15/04/2029                | 80                                  | 87                               | 0,32                      |
| 11,250 % éch. 15/02/2027               | 70                                  | 72                               | 0,27                      |
| SoftBank Group Corp.                   |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 08/01/2029                | € 175                               | 204                              | 0,75                      |
| 7,000 % éch. 22/04/2032                | 150                                 | 179                              | 0,66                      |
| 8,250 % éch. 22/10/2031                | \$ 200                              | 206                              | 0,76                      |
| Total Japon                            |                                     | 825                              | 3,05                      |
| <b>LUXEMBOURG</b>                      |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Alexandrite Lake Lux Holdings SARL     |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 30/07/2030                | € 100                               | 114                              | 0,42                      |
| ContourGlobal Power Holdings S.A.      |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 28/02/2030                | \$ 50                               | 51                               | 0,19                      |
| CPI Property Group S.A.                |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 27/01/2032                | € 50                                | 56                               | 0,21                      |
| 7,500 % éch. 26/03/2031 (d)            | 100                                 | 107                              | 0,39                      |
| Essendi S.A.                           |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 15/11/2031                | 125                                 | 145                              | 0,54                      |
| Maxam Prill SARL                       |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 15/07/2030                | 100                                 | 117                              | 0,43                      |
| Total Luxembourg                       |                                     | 590                              | 2,18                      |
| <b>MULTINATIONALES</b>                 |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Allied Universal Holdco LLC            |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 01/06/2028                | \$ 150                              | 148                              | 0,55                      |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/09/2028                | € 100                               | 111                              | 0,41                      |

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| JetBlue Airways Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 9,875 % éch. 20/09/2031                  | \$ 25                               | \$ 23                            | 0,08                      |
| Total Multinationales                    |                                     | 282                              | 1,04                      |
| <b>PAYS-BAS</b>                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |                                     |                                  |                           |
| Axalta Coating Systems Dutch Holding BV  |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 15/02/2031                  | 50                                  | 52                               | 0,19                      |
| Citycon Treasury BV                      |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 11/03/2030                  | € 100                               | 111                              | 0,41                      |
| Flora Food Management BV                 |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 02/07/2029                  | 100                                 | 112                              | 0,42                      |
| Stellantis NV                            |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 16/03/2031 (d)              | 100                                 | 112                              | 0,41                      |
| 6,875 % éch. 16/12/2033 (d)              | 100                                 | 112                              | 0,41                      |
| Sunrise FinCo BV                         |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 15/07/2031                  | \$ 50                               | 47                               | 0,17                      |
| Telefonica Europe BV                     |                                     |                                  |                           |
| 5,752 % éch. 15/01/2032 (d)              | € 100                               | 121                              | 0,45                      |
| VZ Secured Financing BV                  |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 15/01/2032                  | 50                                  | 54                               | 0,20                      |
| 5,000 % éch. 15/01/2032                  | \$ 180                              | 158                              | 0,59                      |
| ZF Europe Finance BV                     |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/02/2032                  | € 100                               | 113                              | 0,42                      |
| Total Pays-Bas                           |                                     | 992                              | 3,67                      |
| <b>PORTUGAL</b>                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |                                     |                                  |                           |
| EDP S.A.                                 |                                     |                                  |                           |
| 1,875 % éch. 02/08/2081                  | 100                                 | 114                              | 0,42                      |
| <b>SINGAPOUR</b>                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |                                     |                                  |                           |
| Seagate Data Storage Technology Pte Ltd. |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/12/2029                  | \$ 175                              | 183                              | 0,68                      |
| <b>ESPAGNE</b>                           |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |                                     |                                  |                           |
| Celsa Opco S.A.                          |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/12/2030                  | € 100                               | 122                              | 0,45                      |
| Grifols S.A.                             |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/10/2028                  | 100                                 | 114                              | 0,43                      |
| 4,750 % éch. 15/10/2028                  | \$ 70                               | 68                               | 0,25                      |
| Total Espagne                            |                                     | 304                              | 1,13                      |
| <b>SUÈDE</b>                             |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |                                     |                                  |                           |
| Castellum AB                             |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 02/12/2026 (d)              | € 100                               | 114                              | 0,42                      |
| <b>ROYAUME-UNI</b>                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>     |                                     |                                  |                           |
| Belron UK Finance PLC                    |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/10/2029                  | \$ 60                               | 60                               | 0,22                      |
| Carnival UK Ltd.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 15/07/2031                  | € 100                               | 115                              | 0,43                      |
| INEOS Finance PLC                        |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/04/2029                  | \$ 25                               | 24                               | 0,09                      |
| INEOS Quattro Finance PLC                |                                     |                                  |                           |
| 9,625 % éch. 15/03/2029                  | 50                                  | 47                               | 0,17                      |
| Ocado Group PLC                          |                                     |                                  |                           |
| 10,500 % éch. 08/08/2029                 | £ 50                                | 69                               | 0,26                      |
| Virgin Media Finance PLC                 |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 15/07/2030                  | \$ 75                               | 57                               | 0,21                      |
| Vmed O2 UK Financing PLC                 |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/07/2031                  | 30                                  | 25                               | 0,09                      |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                  | € 100                               | 101                              | 0,37                      |
| 7,750 % éch. 15/04/2032                  | \$ 25                               | 23                               | 0,09                      |
| Vodafone Group PLC                       |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 27/08/2080                  | € 100                               | 110                              | 0,41                      |
| 5,125 % éch. 04/06/2081                  | \$ 50                               | 39                               | 0,14                      |
| Total Royaume-Uni                        |                                     | 670                              | 2,48                      |

| DESCRIPTION                        | ACTIONS                          | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION                           | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION                         | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|---------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|-------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| ÉTATS-UNIS                         |                                  |                               |                     | Carvana Co.                           |                                  |                               |                     | DISH DBS Corp.                      |                                  |                               |                     |
| ACTIONS ORDINAIRES                 |                                  |                               |                     | 9,000 % éch. 01/06/2030               | \$ 80                            | \$ 83                         | 0,31                | 5,250 % éch. 01/12/2026             | \$ 50                            | \$ 49                         | 0,18                |
| INDUSTRIE                          |                                  |                               |                     | 9,000 % éch. 01/06/2031               | 50                               | 55                            | 0,20                | DISH Network Corp.                  |                                  |                               |                     |
| Spirit Aviation Holdings, Inc. (a) | 1 700                            | 0                             | 0,00                | CCO Holdings LLC                      |                                  |                               |                     | 11,750 % éch. 15/11/2027            | 11                               | 11                            | 0,04                |
|                                    | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                               |                     | 4,250 % éch. 01/02/2031               | 70                               | 63                            | 0,23                | Diversified Healthcare Trust        |                                  |                               |                     |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS      |                                  |                               |                     | 4,500 % éch. 01/05/2032               | 75                               | 66                            | 0,24                | 4,375 % éch. 01/03/2031             | 25                               | 23                            | 0,09                |
| Acadia Healthcare Co., Inc.        |                                  |                               |                     | 4,750 % éch. 01/03/2030               | 130                              | 123                           | 0,46                | 7,250 % éch. 15/10/2030             | 60                               | 62                            | 0,23                |
| 5,500 % éch. 01/07/2028            | \$ 25                            | 25                            | 0,09                | 5,000 % éch. 01/02/2028               | 34                               | 34                            | 0,13                | Dorman Products, Inc.               |                                  |                               |                     |
| ADI Escrow Issuer LLC              |                                  |                               |                     | 7,000 % éch. 01/02/2033               | 50                               | 49                            | 0,18                | 6,250 % éch. 15/06/2034             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| 7,125 % éch. 15/07/2034            | 25                               | 26                            | 0,10                | Centene Corp.                         |                                  |                               |                     | Edison International                |                                  |                               |                     |
| ADT Security Corp.                 |                                  |                               |                     | 3,000 % éch. 15/10/2030               | 225                              | 204                           | 0,75                | 7,875 % éch. 15/06/2054             | 50                               | 51                            | 0,19                |
| 4,125 % éch. 01/08/2029            | 85                               | 82                            | 0,30                | 4,625 % éch. 15/12/2029               | 25                               | 24                            | 0,09                | Elanco Animal Health, Inc.          |                                  |                               |                     |
| 4,875 % éch. 15/07/2032            | 60                               | 57                            | 0,21                | Charlotte Buyer, Inc.                 |                                  |                               |                     | 6,400 % éch. 28/08/2028             | 50                               | 51                            | 0,19                |
| 5,875 % éch. 15/10/2033            | 55                               | 54                            | 0,20                | 8,000 % éch. 30/06/2031               | 20                               | 20                            | 0,07                | Ellucian Holdings, Inc.             |                                  |                               |                     |
| Advance Auto Parts, Inc.           |                                  |                               |                     | Clarivate Science Holdings Corp.      | 25                               | 22                            | 0,08                | 6,500 % éch. 01/12/2029             | 25                               | 24                            | 0,09                |
| 3,500 % éch. 15/03/2032            | 25                               | 22                            | 0,08                | Clean Harbors, Inc.                   |                                  |                               |                     | Encompass Health Corp.              |                                  |                               |                     |
| 7,000 % éch. 01/08/2030            | 70                               | 72                            | 0,27                | 5,125 % éch. 15/07/2029               | 50                               | 50                            | 0,19                | 4,750 % éch. 01/02/2030             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| AES Corp.                          |                                  |                               |                     | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.  |                                  |                               |                     | 5,875 % éch. 01/06/2034             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| 7,600 % éch. 15/01/2055            | 50                               | 51                            | 0,19                | 7,125 % éch. 15/02/2031               | 25                               | 26                            | 0,10                | Encore Capital Group, Inc.          |                                  |                               |                     |
| Albertsons Cos., Inc.              |                                  |                               |                     | 7,500 % éch. 15/03/2033               | 25                               | 26                            | 0,10                | 6,625 % éch. 15/04/2031             | 75                               | 76                            | 0,28                |
| 5,750 % éch. 31/03/2034            | 25                               | 24                            | 0,09                | Clearway Energy Operating LLC         |                                  |                               |                     | 8,500 % éch. 15/05/2030             | 50                               | 53                            | 0,20                |
| Alliant Holdings Intermediate LLC  |                                  |                               |                     | 3,750 % éch. 15/02/2031               | 50                               | 46                            | 0,17                | Fair Isaac Corp.                    |                                  |                               |                     |
| 4,250 % éch. 15/10/2027            | 70                               | 69                            | 0,26                | 3,750 % éch. 15/01/2032               | 70                               | 64                            | 0,24                | 4,000 % éch. 15/06/2028             | 115                              | 113                           | 0,42                |
| AmWINS Group, Inc.                 |                                  |                               |                     | 4,750 % éch. 15/03/2028               | 50                               | 50                            | 0,19                | 6,000 % éch. 15/05/2033             | 20                               | 20                            | 0,07                |
| 6,375 % éch. 15/02/2029            | 50                               | 50                            | 0,19                | Cleveland-Cliffs, Inc.                |                                  |                               |                     | Freedom Mortgage Holdings LLC       |                                  |                               |                     |
| APLD ComputeCo LLC                 |                                  |                               |                     | 6,750 % éch. 15/04/2030               | 25                               | 25                            | 0,09                | 9,250 % éch. 01/02/2029             | 60                               | 62                            | 0,23                |
| 6,750 % éch. 15/03/2031            | 80                               | 80                            | 0,30                | 7,500 % éch. 15/09/2031               | 25                               | 25                            | 0,09                | FS KKR Capital Corp.                |                                  |                               |                     |
| 7,000 % éch. 15/06/2031            | 25                               | 25                            | 0,09                | Cloud Software Group, Inc.            |                                  |                               |                     | 7,500 % éch. 01/08/2031             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| Aramark Services, Inc.             |                                  |                               |                     | 6,500 % éch. 31/03/2029               | 140                              | 136                           | 0,50                | FTAI Aviation Investors LLC         |                                  |                               |                     |
| 5,000 % éch. 01/02/2028            | 95                               | 95                            | 0,35                | 8,250 % éch. 30/06/2032               | 50                               | 47                            | 0,17                | 5,875 % éch. 15/04/2033             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| Asbury Automotive Group, Inc.      |                                  |                               |                     | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. |                                  |                               |                     | 7,000 % éch. 01/05/2031             | 108                              | 112                           | 0,41                |
| 4,625 % éch. 15/11/2029            | 100                              | 97                            | 0,36                | 6,750 % éch. 15/04/2032               | 115                              | 112                           | 0,41                | Gap, Inc.                           |                                  |                               |                     |
| Asurion LLC                        |                                  |                               |                     | Cogent Communications Group LLC       |                                  |                               |                     | 3,625 % éch. 01/10/2029             | 60                               | 57                            | 0,21                |
| 8,000 % éch. 31/12/2032            | 50                               | 50                            | 0,19                | 6,500 % éch. 01/07/2032               | 70                               | 63                            | 0,23                | 3,875 % éch. 01/10/2031             | 60                               | 55                            | 0,20                |
| 8,375 % éch. 01/02/2034            | 25                               | 23                            | 0,09                | 7,000 % éch. 15/06/2027               | 25                               | 25                            | 0,09                | Gates Corp.                         |                                  |                               |                     |
| Avantor Funding, Inc.              |                                  |                               |                     | Columbus McKinnon Corp.               |                                  |                               |                     | 6,875 % éch. 01/07/2029             | 25                               | 26                            | 0,10                |
| 3,875 % éch. 01/11/2029            | 35                               | 33                            | 0,12                | 7,125 % éch. 01/02/2033               | 50                               | 50                            | 0,18                | Gen Digital, Inc.                   |                                  |                               |                     |
| 4,625 % éch. 15/07/2028            | 100                              | 99                            | 0,37                | Commercial Metals Co.                 |                                  |                               |                     | 6,250 % éch. 01/04/2033             | 50                               | 49                            | 0,18                |
| Avis Budget Car Rental LLC         |                                  |                               |                     | 4,125 % éch. 15/01/2030               | 25                               | 24                            | 0,09                | 7,125 % éch. 30/09/2030             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| 8,375 % éch. 15/06/2032            | 125                              | 126                           | 0,47                | Community Health Systems, Inc.        |                                  |                               |                     | GFL Environmental Holdings US, Inc. |                                  |                               |                     |
| Axalta Coating Systems LLC         |                                  |                               |                     | 4,750 % éch. 15/02/2031               | 16                               | 15                            | 0,06                | 5,500 % éch. 01/02/2034             | 25                               | 24                            | 0,09                |
| 3,375 % éch. 15/02/2029            | 35                               | 34                            | 0,13                | 6,125 % éch. 01/04/2030               | 25                               | 22                            | 0,08                | Global Atlantic Fin Co.             |                                  |                               |                     |
| Axon Enterprise, Inc.              |                                  |                               |                     | 9,750 % éch. 15/01/2034               | 50                               | 52                            | 0,19                | 7,950 % éch. 15/10/2054             | 50                               | 50                            | 0,18                |
| 6,125 % éch. 15/03/2030            | 40                               | 41                            | 0,15                | CompoSecure Holdings LLC              |                                  |                               |                     | Go Daddy Operating Co. LLC          |                                  |                               |                     |
| 6,250 % éch. 15/03/2033            | 90                               | 92                            | 0,34                | 5,625 % éch. 01/02/2033               | 25                               | 24                            | 0,09                | 3,500 % éch. 01/03/2029             | 35                               | 33                            | 0,12                |
| B&G Foods, Inc.                    |                                  |                               |                     | Connect Holding LLC                   |                                  |                               |                     | 5,250 % éch. 01/12/2027             | 75                               | 75                            | 0,28                |
| 8,000 % éch. 15/09/2028            | 100                              | 100                           | 0,37                | 10,500 % éch. 03/04/2031              | 50                               | 50                            | 0,18                | Goodyear Tire & Rubber Co.          |                                  |                               |                     |
| 11,000 % éch. 15/06/2031           | 25                               | 23                            | 0,09                | Cooper-Standard Automotive, Inc.      |                                  |                               |                     | 5,000 % éch. 15/07/2029             | 50                               | 48                            | 0,18                |
| Ball Corp.                         |                                  |                               |                     | 9,250 % éch. 01/03/2031               | 25                               | 25                            | 0,09                | Gray Media, Inc.                    |                                  |                               |                     |
| 5,500 % éch. 15/09/2033            | 75                               | 76                            | 0,28                | Core Scientific Finance LLC           |                                  |                               |                     | 5,375 % éch. 15/11/2031             | 25                               | 17                            | 0,06                |
| Bath & Body Works, Inc.            |                                  |                               |                     | 7,750 % éch. 15/05/2031               | 70                               | 71                            | 0,26                | 9,625 % éch. 15/07/2032             | 50                               | 48                            | 0,18                |
| 6,875 % éch. 01/11/2035            | 50                               | 51                            | 0,19                | CoreWeave, Inc.                       |                                  |                               |                     | 10,500 % éch. 15/07/2029            | 32                               | 34                            | 0,13                |
| 7,500 % éch. 15/06/2029            | 40                               | 40                            | 0,15                | 9,750 % éch. 01/10/2031               | 75                               | 75                            | 0,28                | Griffon Corp.                       |                                  |                               |                     |
| Beacon Mobility Corp.              |                                  |                               |                     | CRC Insurance Group LLC               |                                  |                               |                     | 5,750 % éch. 01/03/2028             | 120                              | 120                           | 0,44                |
| 7,250 % éch. 01/08/2030            | 25                               | 26                            | 0,10                | 7,125 % éch. 01/06/2031               | 50                               | 50                            | 0,18                | HealthEquity, Inc.                  |                                  |                               |                     |
| Beazer Homes USA, Inc.             |                                  |                               |                     | Crocs, Inc.                           |                                  |                               |                     | 4,500 % éch. 01/10/2029             | 110                              | 107                           | 0,40                |
| 8,000 % éch. 15/01/2032            | 25                               | 25                            | 0,09                | 4,125 % éch. 15/08/2031               | 125                              | 117                           | 0,43                | Herc Holdings, Inc.                 |                                  |                               |                     |
| Beignet Investor LLC               |                                  |                               |                     | 3,000 % éch. 15/02/2029               | 60                               | 57                            | 0,21                | 7,000 % éch. 15/06/2030             | 55                               | 57                            | 0,21                |
| 6,581 % éch. 30/05/2049            | 50                               | 51                            | 0,19                | Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC |                                  |                               |                     | 7,250 % éch. 15/06/2033             | 50                               | 52                            | 0,19                |
| Block, Inc.                        |                                  |                               |                     | 6,750 % éch. 15/05/2028               | 6                                | 6                             | 0,02                | Hilton Domestic Operating Co., Inc. |                                  |                               |                     |
| 6,000 % éch. 15/08/2033            | 50                               | 50                            | 0,19                | 8,875 % éch. 01/09/2031               | 50                               | 53                            | 0,20                | 3,625 % éch. 15/02/2032             | 220                              | 201                           | 0,74                |
| 6,500 % éch. 15/05/2032            | 125                              | 128                           | 0,47                | DaVita, Inc.                          |                                  |                               |                     | 5,750 % éch. 15/09/2033             | 70                               | 70                            | 0,26                |
| Boise Cascade Co.                  |                                  |                               |                     | 4,625 % éch. 01/06/2030               | 50                               | 48                            | 0,18                | 5,875 % éch. 01/04/2029             | 60                               | 61                            | 0,23                |
| 4,875 % éch. 01/07/2030            | 50                               | 49                            | 0,18                | Deluxe Corp.                          |                                  |                               |                     | Hilton Grand Vacations Borrower LLC |                                  |                               |                     |
| Brink's Co.                        |                                  |                               |                     | 8,125 % éch. 15/09/2029               | 35                               | 36                            | 0,13                | 4,875 % éch. 01/07/2031             | 60                               | 56                            | 0,21                |
| 4,625 % éch. 15/10/2027            | 50                               | 50                            | 0,19                | Directv Financing LLC                 |                                  |                               |                     | Howard Hughes Corp.                 |                                  |                               |                     |
| Builders FirstSource, Inc.         |                                  |                               |                     | 8,875 % éch. 01/02/2030               | 25                               | 25                            | 0,09                | 5,875 % éch. 01/03/2032             | 25                               | 25                            | 0,09                |
| 4,250 % éch. 01/02/2032            | 140                              | 131                           | 0,48                | 9,250 % éch. 01/06/2032               | 25                               | 25                            | 0,09                | Hudson Pacific Properties LP        |                                  |                               |                     |
| Burford Capital Global Finance LLC |                                  |                               |                     | Discovery Communications LLC          |                                  |                               |                     | 3,250 % éch. 15/01/2030             | 25                               | 22                            | 0,08                |
| 6,875 % éch. 15/04/2030            | 5                                | 5                             | 0,02                | 3,625 % éch. 15/05/2030               | 5                                | 5                             | 0,02                | 5,950 % éch. 15/02/2028             | 50                               | 50                            | 0,18                |
| 7,500 % éch. 15/07/2033            | 15                               | 13                            | 0,05                | 3,950 % éch. 20/03/2028               | 15                               | 15                            | 0,06                | Industrial F&B Investments, Inc.    |                                  |                               |                     |
| 9,250 % éch. 01/07/2031            | 25                               | 24                            | 0,09                | Discovery Global Holdings, Inc.       |                                  |                               |                     | 7,750 % éch. 11/02/2033             | 25                               | 25                            | 0,09                |
|                                    |                                  |                               |                     | 4,054 % éch. 15/03/2029               | 70                               | 69                            | 0,26                | Ingevity Corp.                      |                                  |                               |                     |
|                                    |                                  |                               |                     | 4,279 % éch. 15/03/2032               | 85                               | 76                            | 0,28                | 3,875 % éch. 01/11/2028             | 150                              | 145                           | 0,54                |
|                                    |                                  |                               |                     | 5,050 % éch. 15/03/2042               | 110                              | 81                            | 0,30                | Ingram Micro, Inc.                  |                                  |                               |                     |
|                                    |                                  |                               |                     |                                       |                                  |                               |                     | 4,750 % éch. 15/05/2029             | 25                               | 25                            | 0,09                |

# Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Insulet Corp.<br>6,500 % éch. 01/04/2033                          | \$ 90                               | \$ 91                            | 0,34                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>5,625 % éch. 29/09/2028   | \$ 12                               | \$ 12                            | 0,04                      | SBA Communications Corp.<br>3,125 % éch. 01/02/2029                 | \$ 115                              | \$ 110                           | 0,41                      |
| IQVIA, Inc.<br>2,250 % éch. 15/03/2029                            | € 125                               | 139                              | 0,51                      | 7,050 % éch. 15/09/2028                                      | 205                                 | 210                              | 0,78                      | 3,875 % éch. 15/02/2027                                             | 12                                  | 12                               | 0,04                      |
| 6,500 % éch. 15/05/2030                                           | \$ 50                               | 51                               | 0,19                      | Olympus Water U.S. Holding Corp.<br>4,250 % éch. 01/10/2028  | 50                                  | 49                               | 0,18                      | Service Corp. International<br>3,375 % éch. 15/08/2030              | 25                                  | 23                               | 0,09                      |
| Iron Mountain, Inc.<br>4,875 % éch. 15/09/2027                    | 200                                 | 200                              | 0,74                      | OneMain Finance Corp.<br>3,500 % éch. 15/01/2027             | 50                                  | 50                               | 0,18                      | 4,000 % éch. 15/05/2031                                             | 35                                  | 33                               | 0,12                      |
| 5,000 % éch. 15/07/2028                                           | 50                                  | 50                               | 0,18                      | 7,125 % éch. 15/11/2031                                      | 125                                 | 128                              | 0,47                      | Service Properties Trust<br>0,000 % éch.                            |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/03/2028                                           | 25                                  | 25                               | 0,09                      | 7,875 % éch. 15/03/2030                                      | 25                                  | 26                               | 0,10                      | 30/09/2028 (b)                                                      | 25                                  | 23                               | 0,09                      |
| 6,250 % éch. 15/01/2033                                           | 60                                  | 61                               | 0,23                      | Open Text Holdings, Inc.<br>4,125 % éch. 15/02/2030          | 135                                 | 124                              | 0,46                      | Silgan Holdings, Inc.<br>4,125 % éch. 01/02/2028                    | 40                                  | 39                               | 0,14                      |
| 7,000 % éch. 15/02/2029                                           | 50                                  | 51                               | 0,19                      | Option Care Health, Inc.<br>4,375 % éch. 31/10/2029          | 90                                  | 87                               | 0,32                      | Simmons Foods, Inc.<br>4,625 % éch. 01/03/2029                      | 120                                 | 116                              | 0,43                      |
| Jane Street Group<br>6,750 % éch. 01/05/2033                      | 50                                  | 51                               | 0,19                      | Organon & Co.<br>4,125 % éch. 30/04/2028                     | 35                                  | 35                               | 0,13                      | Sirius XM Radio LLC<br>3,125 % éch. 01/09/2026                      | 90                                  | 90                               | 0,33                      |
| 7,125 % éch. 30/04/2031                                           | 25                                  | 26                               | 0,10                      | Outfront Media Capital LLC<br>4,250 % éch. 15/01/2029        | 75                                  | 73                               | 0,27                      | 3,875 % éch. 01/09/2031                                             | 100                                 | 91                               | 0,34                      |
| KBR, Inc.<br>4,750 % éch. 30/09/2028                              | 25                                  | 25                               | 0,09                      | Pacific Gas & Electric Co.<br>6,700 % éch. 01/04/2053        | 50                                  | 52                               | 0,19                      | 5,000 % éch. 01/08/2027                                             | 83                                  | 83                               | 0,31                      |
| Lamar Media Corp.<br>3,625 % éch. 15/01/2031                      | 20                                  | 19                               | 0,07                      | Paramount Global<br>3,700 % éch. 01/06/2028                  | 50                                  | 49                               | 0,18                      | 5,875 % éch. 15/04/2032                                             | 85                                  | 84                               | 0,31                      |
| 4,000 % éch. 15/02/2030                                           | 120                                 | 115                              | 0,43                      | 4,200 % éch. 01/06/2029                                      | 25                                  | 24                               | 0,09                      | SLM Corp.<br>6,495 % éch. 15/05/2032                                | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| 5,375 % éch. 01/11/2033                                           | 25                                  | 25                               | 0,09                      | 4,200 % éch. 19/05/2032                                      | 25                                  | 22                               | 0,08                      | Smyrna Ready Mix Concrete LLC<br>6,000 % éch. 01/11/2028            | 11                                  | 11                               | 0,04                      |
| Lamb Weston Holdings, Inc.<br>4,125 % éch. 31/01/2030             | 30                                  | 29                               | 0,11                      | 4,600 % éch. 15/01/2045                                      | 25                                  | 16                               | 0,06                      | Snap, Inc.<br>6,875 % éch. 01/03/2033                               | 75                                  | 73                               | 0,27                      |
| 4,375 % éch. 31/01/2032                                           | 40                                  | 38                               | 0,14                      | 4,900 % éch. 15/08/2044                                      | 50                                  | 33                               | 0,12                      | 6,875 % éch. 15/03/2034                                             | 35                                  | 34                               | 0,13                      |
| LBM Acquisition LLC<br>6,250 % éch. 15/01/2029                    | 95                                  | 69                               | 0,26                      | 4,950 % éch. 15/01/2031                                      | 35                                  | 33                               | 0,12                      | Specialty Building Products Holdings LLC<br>7,750 % éch. 15/10/2029 | 50                                  | 46                               | 0,17                      |
| Level 3 Financing, Inc.<br>6,875 % éch. 30/06/2033                | 85                                  | 87                               | 0,32                      | 5,250 % éch. 01/04/2044                                      | 10                                  | 7                                | 0,03                      | SS&C Technologies, Inc.<br>5,500 % éch. 30/09/2027                  | 40                                  | 40                               | 0,15                      |
| 7,500 % éch. 15/02/2037                                           | 50                                  | 51                               | 0,19                      | 5,850 % éch. 01/09/2043                                      | 125                                 | 94                               | 0,35                      | 6,500 % éch. 01/06/2032                                             | 10                                  | 10                               | 0,04                      |
| Levi Strauss & Co.<br>3,500 % éch. 01/03/2031                     | 85                                  | 79                               | 0,29                      | 7,875 % éch. 30/07/2030                                      | 10                                  | 11                               | 0,04                      | Stagwell Global LLC<br>5,625 % éch. 15/08/2029                      | 70                                  | 68                               | 0,25                      |
| Life Time, Inc.<br>6,000 % éch. 15/11/2031                        | 50                                  | 51                               | 0,19                      | Park Intermediate Holdings LLC<br>4,875 % éch. 15/05/2029    | 25                                  | 24                               | 0,09                      | Standard Industries, Inc.<br>4,750 % éch. 15/01/2028                | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| LifePoint Health, Inc.<br>7,000 % éch. 01/05/2034                 | 25                                  | 24                               | 0,09                      | 5,875 % éch. 01/10/2028                                      | 50                                  | 50                               | 0,18                      | Staples, Inc.<br>10,750 % éch. 01/09/2029                           | 25                                  | 24                               | 0,09                      |
| 9,875 % éch. 15/08/2030                                           | 12                                  | 13                               | 0,05                      | Pebblebrook Hotel LP<br>6,375 % éch. 15/10/2029              | 115                                 | 117                              | 0,43                      | Starwood Property Trust, Inc.<br>5,250 % éch. 15/10/2028            | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| 10,000 % éch. 01/06/2032                                          | 15                                  | 15                               | 0,06                      | PennyMac Financial Services, Inc.<br>5,750 % éch. 15/09/2031 | 50                                  | 47                               | 0,17                      | 5,750 % éch. 15/01/2031                                             | 125                                 | 124                              | 0,46                      |
| Lithia Motors, Inc.<br>4,625 % éch. 15/12/2027                    | 55                                  | 55                               | 0,20                      | 7,875 % éch. 15/12/2029                                      | 35                                  | 36                               | 0,13                      | 6,125 % éch. 01/06/2031                                             | 20                                  | 20                               | 0,07                      |
| Live Nation Entertainment, Inc.<br>4,750 % éch. 15/10/2027        | 175                                 | 175                              | 0,65                      | PG&E Corp.<br>6,850 % éch. 15/09/2056                        | 60                                  | 60                               | 0,22                      | 6,500 % éch. 15/10/2030                                             | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
| Madison IAQ LLC<br>4,125 % éch. 30/06/2028                        | 85                                  | 84                               | 0,31                      | Post Holdings, Inc.<br>4,625 % éch. 15/04/2030               | 95                                  | 92                               | 0,34                      | Taylor Morrison Communities, Inc.<br>5,125 % éch. 01/08/2030        | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| Marriott Ownership Resorts, Inc.<br>6,500 % éch. 01/10/2033       | 25                                  | 25                               | 0,09                      | 6,375 % éch. 01/03/2033                                      | 20                                  | 20                               | 0,07                      | 5,750 % éch. 15/11/2032                                             | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
| Match Group Holdings LLC<br>3,625 % éch. 01/10/2031               | 60                                  | 54                               | 0,20                      | PRA Group, Inc.<br>8,875 % éch. 31/01/2030                   | 15                                  | 15                               | 0,06                      | Teleflex, Inc.<br>4,250 % éch. 01/06/2028                           | 40                                  | 39                               | 0,14                      |
| 4,125 % éch. 01/08/2030                                           | 45                                  | 42                               | 0,16                      | Primo Water Holdings, Inc.<br>4,375 % éch. 30/04/2029        | 185                                 | 181                              | 0,67                      | Tenet Healthcare Corp.<br>4,625 % éch. 15/06/2028                   | 100                                 | 99                               | 0,37                      |
| 5,000 % éch. 15/12/2027                                           | 125                                 | 125                              | 0,46                      | PTC, Inc.<br>4,000 % éch. 15/02/2028                         | 50                                  | 49                               | 0,18                      | 6,750 % éch. 15/05/2031                                             | 30                                  | 31                               | 0,11                      |
| Mauser Packaging Solutions Holding Co.<br>7,875 % éch. 15/04/2030 | 75                                  | 77                               | 0,28                      | Qnity Electronics, Inc.<br>5,750 % éch. 15/08/2032           | 115                                 | 116                              | 0,43                      | TerraForm Power Operating LLC<br>4,750 % éch. 15/01/2030            | 50                                  | 48                               | 0,18                      |
| Michaels Cos., Inc.<br>8,500 % éch. 15/03/2033                    | 50                                  | 50                               | 0,18                      | QXO Building Products, Inc.<br>6,750 % éch. 30/04/2032       | 75                                  | 77                               | 0,28                      | TopBuild Corp.<br>3,625 % éch. 15/03/2029                           | 85                                  | 85                               | 0,31                      |
| MIWD Holdco LLC<br>5,500 % éch. 01/02/2030                        | 25                                  | 24                               | 0,09                      | Raven Acquisition Holdings LLC<br>6,875 % éch. 15/11/2031    | 55                                  | 54                               | 0,20                      | 4,125 % éch. 15/02/2032                                             | 95                                  | 96                               | 0,36                      |
| Molina Healthcare, Inc.<br>3,875 % éch. 15/11/2030                | 10                                  | 9                                | 0,03                      | RB Global Holdings, Inc.<br>7,750 % éch. 15/03/2031          | 225                                 | 234                              | 0,87                      | Travel & Leisure Co.<br>4,500 % éch. 01/12/2029                     | 25                                  | 24                               | 0,09                      |
| 4,375 % éch. 15/06/2028                                           | 15                                  | 15                               | 0,06                      | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045    | 90                                  | 90                               | 0,33                      | 6,250 % éch. 01/06/2031                                             | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| 6,500 % éch. 15/02/2031                                           | 15                                  | 15                               | 0,06                      | RHP Hotel Properties LP<br>7,250 % éch. 15/07/2028           | 185                                 | 189                              | 0,70                      | TriNet Group, Inc.<br>3,500 % éch. 01/03/2029                       | 20                                  | 19                               | 0,07                      |
| MPT Operating Partnership LP<br>8,500 % éch. 15/02/2032           | 50                                  | 51                               | 0,19                      | Rivian Holdings LLC<br>10,000 % éch. 15/01/2031              | 49                                  | 49                               | 0,18                      | 7,125 % éch. 15/08/2031                                             | 50                                  | 50                               | 0,18                      |
| Mueller Water Products, Inc.<br>4,000 % éch. 15/06/2029           | 25                                  | 24                               | 0,09                      | RLJ Lodging Trust LP<br>3,750 % éch. 01/07/2026              | 25                                  | 25                               | 0,09                      | U.S. Acute Care Solutions LLC<br>9,750 % éch. 15/05/2029            | 60                                  | 57                               | 0,21                      |
| National Mentor Holdings, Inc.<br>10,500 % éch. 15/12/2030        | 50                                  | 53                               | 0,20                      | ROBLOX Corp.<br>3,875 % éch. 01/05/2030                      | 105                                 | 99                               | 0,37                      | U.S. Foods, Inc.<br>5,750 % éch. 15/04/2033                         | 75                                  | 75                               | 0,28                      |
| NCR Voyix Corp.<br>5,000 % éch. 01/10/2028                        | 50                                  | 49                               | 0,18                      | Rocket Cos., Inc.<br>6,375 % éch. 01/08/2033                 | 20                                  | 20                               | 0,07                      | 7,250 % éch. 15/01/2032                                             | 20                                  | 21                               | 0,08                      |
| Neptune Bidco U.S., Inc.<br>9,500 % éch. 15/02/2033               | 25                                  | 25                               | 0,09                      | 7,125 % éch. 01/02/2032                                      | 50                                  | 52                               | 0,19                      | UKG, Inc.<br>6,875 % éch. 01/02/2031                                | 75                                  | 73                               | 0,27                      |
| NESCO Holdings, Inc.<br>5,500 % éch. 15/04/2029                   | 40                                  | 40                               | 0,15                      | Rocket Mortgage LLC<br>3,625 % éch. 01/03/2029               | 50                                  | 48                               | 0,18                      | Unisys Corp.<br>10,625 % éch. 15/01/2031                            | 10                                  | 9                                | 0,03                      |
| Newell Brands, Inc.<br>8,500 % éch. 01/06/2028                    | 50                                  | 52                               | 0,19                      | 4,000 % éch. 15/10/2033                                      | 90                                  | 81                               | 0,30                      | United Rentals North America, Inc.<br>3,750 % éch. 15/01/2032       | 135                                 | 125                              | 0,46                      |
| Newmark Group, Inc.<br>7,500 % éch. 12/01/2029                    | 50                                  | 52                               | 0,19                      | Ryan Specialty LLC<br>5,875 % éch. 01/08/2032                | 55                                  | 54                               | 0,20                      | 3,875 % éch. 15/02/2031                                             | 35                                  | 33                               | 0,12                      |
| Nexstar Media, Inc.<br>6,500 % éch. 15/09/2033                    | 75                                  | 75                               | 0,28                      | Sabre GLBL, Inc.<br>10,750 % éch. 15/11/2029                 | 25                                  | 24                               | 0,09                      | 5,250 % éch. 15/01/2030                                             | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
| 7,250 % éch. 15/04/2034                                           | 50                                  | 50                               | 0,18                      | 10,750 % éch. 15/03/2030                                     | 9                                   | 9                                | 0,03                      | 5,375 % éch. 15/11/2033                                             | 25                                  | 25                               | 0,09                      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/03/2034                                             | 25                                  | 26                               | 0,10                      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           | Uniti Group LP<br>8,625 % éch. 15/06/2032                           | 25                                  | 26                               | 0,10                      |

| DESCRIPTION                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Uniti Services LLC             |                                     |                                  |                           | Windstream Services LLC                |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>       |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/10/2033        | \$ 25                               | \$ 26                            | 0,10                      | 8,250 % éch. 01/10/2031                | \$ 60                               | \$ 63                            | 0,23                      | Billets du Trésor américain                  |                                     |                                  |                           |
| Univision Communications, Inc. |                                     |                                  |                           | WULF Compute LLC                       |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/02/2036                      | \$ 10                               | \$10                             | 0,04                      |
| 8,500 % éch. 31/07/2031        | 85                                  | 85                               | 0,31                      | 7,750 % éch. 15/10/2030                | 50                                  | 53                               | 0,20                      | <b>ACTIONS</b>                               |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 15/04/2033        | 125                                 | 123                              | 0,46                      | Wyndham Hotels & Resorts, Inc.         |                                     |                                  |                           | <b>BONS DE SOUSCRIPTION</b>                  |                                     |                                  |                           |
| Valvoline, Inc.                |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/08/2028                | 95                                  | 94                               | 0,35                      | Spirit Aviation Holdings, Inc. -             |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/06/2031        | 25                                  | 23                               | 0,09                      | 5,625 % éch. 01/03/2033                | 25                                  | 25                               | 0,09                      | Exp. 11/03/2035                              | 595                                 | 0                                | 0,00                      |
| Versant Media Group, Inc.      |                                     |                                  |                           | XHR LP                                 |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                             |                                     | 16 645                           | 61,58                     |
| 7,250 % éch. 30/01/2031        | 25                                  | 26                               | 0,10                      | 4,875 % éch. 01/06/2029                | 15                                  | 15                               | 0,06                      | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                                     |                                  |                           |
| Vertiv Group Corp.             |                                     |                                  |                           | Yum! Brands, Inc.                      |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>             |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 15/11/2028        | 100                                 | 99                               | 0,37                      | 4,625 % éch. 23/04/2030                | 100                                 | 96                               | 0,36                      | <b>BILLETS À COURT TERME</b>                 |                                     |                                  |                           |
| VF Corp.                       |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/11/2037                | 60                                  | 65                               | 0,24                      | Federal Home Loan Bank                       |                                     |                                  |                           |
| 2,800 % éch. 23/04/2027        | 25                                  | 25                               | 0,09                      | Zebra Technologies Corp.               |                                     |                                  |                           | 3,615 % éch. 29/07/2026 (b)(c)               | \$ 400                              | 399                              | 1,47                      |
| 2,950 % éch. 23/04/2030        | 70                                  | 64                               | 0,24                      | 6,500 % éch. 01/06/2032                | 75                                  | 76                               | 0,28                      | 3,620 % éch. 29/07/2026 (b)(c)               | 300                                 | 299                              | 1,11                      |
| Viacom, Inc.                   |                                     |                                  |                           | ZF North America Capital, Inc.         |                                     |                                  |                           | 3,620 % éch. 31/07/2026 (b)(c)               | 100                                 | 99                               | 0,37                      |
| 4,375 % éch. 15/03/2043        | 5                                   | 3                                | 0,01                      | 6,750 % éch. 23/04/2030                | 30                                  | 30                               | 0,11                      | 3,645 % éch. 07/08/2026 (b)(c)               | 300                                 | 299                              | 1,11                      |
| Vornado Realty LP              |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 24/03/2031                | 100                                 | 101                              | 0,37                      |                                              |                                     | 1 096                            | 4,06                      |
| 3,400 % éch. 01/06/2031        | 50                                  | 46                               | 0,17                      | ZoomInfo Technologies LLC              |                                     |                                  |                           | 3,680 % éch. 30/07/2026 (b)(c)               | 100                                 | 100                              | 0,37                      |
| Wayfair LLC                    |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/02/2029                | 10                                  | 8                                | 0,03                      | Total des Instruments à court terme          |                                     | 1 196                            | 4,43                      |
| 7,125 % éch. 31/05/2034        | 25                                  | 26                               | 0,10                      |                                        |                                     | 16 514                           | 61,09                     | Total des Valeurs mobilières                 | \$                                  | 24 873                           | 92,02                     |
| 7,250 % éch. 31/10/2029        | 30                                  | 31                               | 0,11                      | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 15/09/2030        | 25                                  | 26                               | 0,10                      | Finastra USA, Inc.                     |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |
| WESCO Distribution, Inc.       |                                     |                                  |                           | 7,746 % éch. 15/09/2032                | 25                                  | 23                               | 0,08                      |                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 15/03/2029        | 65                                  | 66                               | 0,24                      | INEOS U.S. Finance LLC                 |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 15/03/2033        | 75                                  | 77                               | 0,28                      | 6,894 % éch. 18/02/2030                | 76                                  | 70                               | 0,26                      |                                              |                                     |                                  |                           |
| WEX, Inc.                      |                                     |                                  |                           | Spirit Airlines, Inc.                  |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/03/2033        | 30                                  | 30                               | 0,11                      | 0,000 % éch. 14/07/2026                | 23                                  | 13                               | 0,05                      |                                              |                                     |                                  |                           |
| Whirlpool Corp.                |                                     |                                  |                           | U.S. Renal Care, Inc.                  |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 26/02/2029        | 25                                  | 23                               | 0,09                      | 8,758 % éch. 28/06/2028                | 15                                  | 15                               | 0,06                      |                                              |                                     |                                  |                           |
| Williams Scotsman, Inc.        |                                     |                                  |                           |                                        |                                     | 121                              | 0,45                      |                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,625 % éch. 15/04/2030        | 50                                  | 52                               | 0,19                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Long  | 09/2026              | 7                     | \$ 4                                    | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Long  | 09/2026              | 1                     | 1                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026              | 8                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 11                    | 5                                       | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 14                    | 1                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 3                     | 3                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026              | 1                     | (3)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 1                     | 4                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 1                     | 3                                       | 0,01                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 19                                   | 0,07                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                      |                       | \$ 19                                   | 0,07                   |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

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

| Entité de référence                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Faurecia Automotive Holdings, Inc. | 5,000 %                 | 20/12/2029         | € 40                                | \$ 0                                    | 0,00                   |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 2 628                            | \$ 99                                   | 0,37                   |



## Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond ESG Fund (suite)

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,325 %   | 31/08/2030      | \$ 95             | \$ 2                              | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      | 350               | 5                                 | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 200               | 8                                 | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 15/05/2032      | 99                | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2033      | 25                | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,916     | 15/11/2053      | 225               | 11                                | 0,04                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 5                 | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 32                | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 150               | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2056      | 100               | 0                                 | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ 30                             | 0,11                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ 129                            | 0,48                |

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

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

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

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

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 164           | \$ 191            | \$ 3               | \$ 0                  | \$ 3                                    | 0,01                |
| BSH          | 07/2026           | \$ 13           | € 11              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 152           | \$ 176            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
| FAR          | 07/2026           | £ 61            | 82                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | \$ 82           | CAD 117           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 117         | \$ 82             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 8           | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | € 93            | 108               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 3            | AUD 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 4           | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 3 352         | 3 910             | 79                 | 0                     | 79                                      | 0,29                |
|              | 07/2026           | \$ 3            | AUD 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 266           | € 3 750           | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,08                |
|              | 08/2026           | AUD 4           | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 3 750         | 4 271             | 0                  | (23)                  | (23)                                    | (0,08)              |
| SSB          | 07/2026           | CAD 121         | 87                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 81           | £ 61              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 61            | \$ 81             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 112             | \$ (23)               | \$ 89                                   | 0,33                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$ 105          | € 90              | \$ 0               | \$ (2)                | \$ (2)                                  | (0,01)              |
| BSH          | 07/2026           | 98              | 84                | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
| CBK          | 07/2026           | 1               | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 85            | \$ 97             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 97           | € 85              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | € 90            | \$ 102            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 102          | € 90              | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | € 90            | \$ 102            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 105          | € 90              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 103             | 90                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2               | \$ (8)                | \$ (6)                                  | (0,02)              |



Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et E en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | £ 66            | \$ 87             | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 107          | £ 80              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 87              | 66                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 103             | 76                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
| JPM          | 07/2026           | 105             | 78                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
| NSL          | 07/2026           | £ 16            | \$ 21             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 21           | £ 16              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 77            | \$ 101            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 101          | £ 77              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 76            | \$ 101            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 101          | £ 76              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (4)                | \$ (3)                                  | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 100          | SEK 926           | \$ 0               | \$ (5)                | \$ (5)                                  | (0,02)              |
| CBK          | 07/2026           | 108             | 998               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | (0,02)              |
| FAR          | 07/2026           | SEK 591         | \$ 61             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 61           | SEK 590           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 892         | \$ 92             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 107          | SEK 990           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 92              | 891               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (15)               | \$ (14)                                 | (0,05)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 66 0,24

Total des Investissements

\$ 25 087 92,81

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 1 944 7,19

Actif net

\$ 27 031 100,00

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

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

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

Un montant en numéraire de 387 \$ (31 décembre 2025 : 265 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 24 873                                            | \$ 0                                              | \$ 24 873        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 9                                                                                 | 205                                                  | 0                                                 | 214              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 9</b>                                                                       | <b>\$ 25 078</b>                                     | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 25 087</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 25 036                                            | \$ 0                                              | \$ 25 036        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (8)                                                                               | (35)                                                 | 0                                                 | (43)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (8)</b>                                                                     | <b>\$ 25 001</b>                                     | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 24 993</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | \$ (2)                                                     | \$ 0                    | \$ (2)                            | \$ S/O                                                     | \$ S/O                  | \$ S/O                            |
| BPS          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| BRC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| BSH          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| CBK          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| FAR          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (5)                                                        | 0                       | (5)                               |
| JPM          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| MBC          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| NSL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| SOG          | 76                                                         | 0                       | 76                                | (58)                                                       | 0                       | (58)                              |
| SSB          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | 3                                                          | 0                       | 3                                 |

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

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 27,03            | 34,38                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 64,07            | 58,16                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,08             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,48             | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,42             | 0,08                 |
| Autres actifs                                                    | 7,92             | 7,31                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                                | 0,27             | 0,15                 |
| Autriche                                                                                                 | 0,87             | 0,56                 |
| Bermudes                                                                                                 | 1,74             | 0,79                 |
| Canada                                                                                                   | 1,84             | 2,83                 |
| Danemark                                                                                                 | 0,47             | 0,49                 |
| Finlande                                                                                                 | 0,37             | 0,37                 |
| France                                                                                                   | 0,78             | 2,12                 |
| Allemagne                                                                                                | 1,42             | 0,70                 |
| Irlande                                                                                                  | 0,28             | 0,20                 |
| Italie                                                                                                   | 2,90             | 2,08                 |
| Japon                                                                                                    | 3,05             | 1,27                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                             | S/O              | 0,46                 |
| Liberia                                                                                                  | S/O              | 0,21                 |
| Luxembourg                                                                                               | 2,18             | 2,65                 |
| Multinationales                                                                                          | 1,04             | 1,11                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 3,67             | 2,54                 |
| Panama                                                                                                   | S/O              | 0,25                 |
| Portugal                                                                                                 | 0,42             | 0,44                 |
| Singapour                                                                                                | 0,68             | 0,29                 |
| Espagne                                                                                                  | 1,13             | 0,69                 |
| Suède                                                                                                    | 0,42             | 0,43                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 2,48             | 3,62                 |
| États-Unis                                                                                               | 61,58            | 64,23                |
| Instruments à court terme                                                                                | 4,43             | 5,16                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,07             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,37             | 0,04                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,11             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,33             | (0,27)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,09)           | 0,08                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 7,19             | 6,52                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                             |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| AUSTRALIE                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           | BELGIQUE                                            |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                  |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           |
| APA Infrastructure Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 13/03/2029                                                                | \$ 23 303                           | \$ 23 464                        | 0,32                      | Sofina S.A.                                         |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 15/03/2029                        | € 10 504                            | \$ 11 262                        | 0,15                      | 6,875 % éch. 19/09/2033                                                                | 4 800                               | 5 218                            | 0,07                      | 1,000 % éch. 23/09/2028                             | € 9 200                             | \$ 9 992                         | 0,13                      |
| APPF Commercial Finance Pty. Ltd.              |                                     |                                  |                           | Scentre Group Trust                                                                    | AUD 7 000                           | 4 617                            | 0,06                      | 3,707 % éch. 13/11/2033                             | 2 500                               | 2 832                            | 0,04                      |
| 3,600 % éch. 11/11/2031                        | AUD 500                             | 306                              | 0,00                      | 5,350 % éch. 18/09/2035                                                                | 7 100                               | 4 920                            | 0,07                      | UCB S.A.                                            |                                     |                                  |                           |
| Aurizon Network Pty. Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 5,900 % éch. 27/11/2034                                                                |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 20/03/2030                             | 2 600                               | 3 043                            | 0,04                      |
| 2,900 % éch. 02/09/2030                        | 6 400                               | 3 984                            | 0,05                      | Scentre Group Trust 2                                                                  | 6 300                               | 4 405                            | 0,06                      | Total Belgique                                      |                                     | 15 867                           | 0,21                      |
| 6,100 % éch. 12/09/2031                        | 12 350                              | 8 684                            | 0,12                      | 5,850 % éch. 22/04/2032                                                                |                                     |                                  |                           | BERMUDES                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 05/12/2033                        | 5 200                               | 3 656                            | 0,05                      | SGSP Australia Assets Pty. Ltd.                                                        |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                          |                                     |                                  |                           |
| 6,560 % éch. 21/12/2034 (i)                    | 500                                 | 353                              | 0,00                      | 3,250 % éch. 29/07/2026                                                                | \$ 1 200                            | 1 200                            | 0,02                      | START Ltd.                                          |                                     |                                  |                           |
| Ausgrid Finance Pty. Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 08/10/2032                                                                | € 4 000                             | 4 506                            | 0,06                      | 4,089 % éch. 15/03/2044                             | \$ 1 455                            | 1 460                            | 0,02                      |
| 5,408 % éch. 28/03/2031                        | 15 700                              | 10 840                           | 0,15                      | Stockland Trust                                                                        |                                     |                                  |                           | Symphony CLO Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,946 % éch. 10/12/2035                        | 7 000                               | 4 838                            | 0,06                      | 5,346 % éch. 24/10/2035                                                                | AUD 5 200                           | 3 408                            | 0,05                      | 4,816 % éch. 23/10/2035                             | 3 700                               | 3 705                            | 0,05                      |
| Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd. |                                     |                                  |                           | 5,420 % éch. 25/03/2032                                                                | 7 200                               | 4 939                            | 0,07                      | Trinitas CLO Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,598 % éch. 01/11/2032                        | 1 000                               | 692                              | 0,01                      | 6,120 % éch. 21/10/2033                                                                | 4 400                               | 3 089                            | 0,04                      | 4,715 % éch. 20/07/2035                             | 1 700                               | 1 700                            | 0,02                      |
| Bank of Queensland Ltd.                        |                                     |                                  |                           | Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           | 4,785 % éch. 20/10/2033                             | 2 217                               | 2 218                            | 0,03                      |
| 3,300 % éch. 30/07/2029                        | € 3 400                             | 3 918                            | 0,05                      | 3,965 % éch. 28/04/2034                                                                | € 1 700                             | 1 962                            | 0,03                      |                                                     |                                     | 9 083                            | 0,12                      |
| Boral Finance Pty. Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 23/04/2032                                                                | AUD 1 800                           | 1 242                            | 0,02                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 01/05/2028                        | \$ 415                              | 405                              | 0,01                      | 5,900 % éch. 19/04/2034                                                                | 5 700                               | 3 974                            | 0,05                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Brisbane Airport Corp. Pty. Ltd.               |                                     |                                  |                           | Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.                                                |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 30/12/2030                        | AUD 4 010                           | 2 673                            | 0,04                      | 5,500 % éch. 02/09/2032                                                                | 3 800                               | 2 601                            | 0,03                      | Aircastle Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| ConnectEast Finance Pty. Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 5,623 % éch. 28/08/2034                                                                | 11 650                              | 7 876                            | 0,11                      | 2,850 % éch. 26/01/2028                             | 6 500                               | 6 306                            | 0,09                      |
| 5,600 % éch. 27/06/2031                        | 10 790                              | 7 495                            | 0,10                      | 6,431 % éch. 05/06/2036                                                                | 1 700                               | 1 199                            | 0,02                      | 5,000 % éch. 15/05/2031                             | 5 500                               | 5 452                            | 0,07                      |
| Dexus Finance Pty. Ltd.                        |                                     |                                  |                           | Vicinity Centres Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/03/2030                             | 700                                 | 705                              | 0,01                      |
| 2,500 % éch. 17/10/2029                        | 2 100                               | 1 334                            | 0,02                      | 5,605 % éch. 22/01/2032                                                                | 10 900                              | 7 578                            | 0,10                      | 6,500 % éch. 18/07/2028                             | 8 891                               | 9 155                            | 0,12                      |
| Dynco Nobel Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 6,190 % éch. 24/04/2034                                                                | 4 400                               | 3 122                            | 0,04                      | Bacardi Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 08/11/2032                        | 1 000                               | 677                              | 0,01                      | Weir Group Australian Holdings Pty. Ltd.                                               |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 15/07/2026                             | 1 543                               | 1 542                            | 0,02                      |
| GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                     |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 23/01/2031                                                                | 8 400                               | 5 607                            | 0,08                      | Carnival Corp. Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| 1,900 % éch. 14/12/2028                        | 23 500                              | 15 042                           | 0,20                      | WestConnex Finance Co. Pty. Ltd.                                                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/08/2028                             | 12 255                              | 12 034                           | 0,16                      |
| 4,742 % éch. 03/06/2030                        | 4 500                               | 3 054                            | 0,04                      | 6,150 % éch. 09/10/2030                                                                | 5 370                               | 3 804                            | 0,05                      | 5,750 % éch. 15/03/2030                             | 2 700                               | 2 735                            | 0,04                      |
| 5,617 % éch. 30/06/2032                        | 6 800                               | 4 732                            | 0,06                      | 6,413 % éch. 30/04/2036                                                                | 9 500                               | 6 714                            | 0,09                      | 5,750 % éch. 01/08/2032                             | 3 090                               | 3 124                            | 0,04                      |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.            |                                     |                                  |                           | Westpac Banking Corp.                                                                  |                                     |                                  |                           | Essent Group Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 29/04/2033                        | € 3 900                             | 4 464                            | 0,06                      | 3,131 % éch. 15/04/2031                                                                | € 4 200                             | 4 833                            | 0,06                      | 6,250 % éch. 01/07/2029                             | 4 938                               | 5 093                            | 0,07                      |
| 4,250 % éch. 03/05/2030                        | 900                                 | 1 058                            | 0,01                      | Woodside Finance Ltd.                                                                  |                                     |                                  |                           | Seadrill Finance Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
| GTA Finance Co. Pty. Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 15/03/2028                                                                | \$ 600                              | 590                              | 0,01                      | 8,375 % éch. 01/08/2030                             | 300                                 | 315                              | 0,01                      |
| 2,200 % éch. 26/08/2027                        | AUD 7 200                           | 4 811                            | 0,06                      | 4,500 % éch. 04/03/2029                                                                | 13 115                              | 13 044                           | 0,18                      | Viking Cruises Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 04/12/2029                        | 15 700                              | 10 820                           | 0,15                      | 5,100 % éch. 12/09/2034                                                                | 6 500                               | 6 392                            | 0,09                      | 5,875 % éch. 15/10/2033                             | 2 200                               | 2 205                            | 0,03                      |
| ICPF Finance Pty. Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 19/05/2030                                                                | 1 000                               | 1 017                            | 0,01                      | VOC Escrow Ltd.                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,573 % éch. 07/11/2033                        | 6 000                               | 4 285                            | 0,06                      | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/02/2028                             | 1 200                               | 1 199                            | 0,02                      |
| Lendlease Finance Ltd.                         |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           | Weatherford International Ltd.                      |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 27/10/2027                        | 9 900                               | 6 662                            | 0,09                      | Project Cashmere                                                                       |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/10/2033                             | 1 700                               | 1 735                            | 0,02                      |
| Lonsdale Finance Pty. Ltd.                     |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 51 600                           | 0,70                      |
| 5,100 % éch. 07/10/2032                        | 2 000                               | 1 345                            | 0,02                      | 30/12/2057 (b)                                                                         | AUD 115 100                         | 79 481                           | 1,07                      | Total Bermudes                                      |                                     | 60 683                           | 0,82                      |
| 5,500 % éch. 19/11/2031                        | 9 880                               | 6 849                            | 0,09                      | 5,713 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           | BRÉSIL                                              |                                     |                                  |                           |
| Macquarie University                           |                                     |                                  |                           | 30/12/2057 (b)                                                                         |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 07/09/2028                        | 250                                 | 167                              | 0,00                      | 5,863 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           | Petrobras Global Finance BV                         |                                     |                                  |                           |
| Mirvac Group Finance Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 30/12/2057 (b)                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 10/09/2030                             | 5 800                               | 5 705                            | 0,08                      |
| 5,900 % éch. 18/03/2036                        | 9 700                               | 6 658                            | 0,09                      | 6,163 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 10/01/2036                             | 2 300                               | 2 294                            | 0,03                      |
| NBN Co. Ltd.                                   |                                     |                                  |                           | 30/12/2057 (b)                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     | 7 999                            | 0,11                      |
| 5,000 % éch. 28/08/2031                        | 3 500                               | 2 403                            | 0,03                      | 30/12/2057 (b)                                                                         | 1 000                               | 691                              | 0,01                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
| Network Finance Co. Pty. Ltd.                  |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     | 85 633                           | 1,16                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 05/09/2033                        | € 3 400                             | 3 855                            | 0,05                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 23/04/2030                             | € 14 600                            | 16 753                           | 0,23                      |
| 6,061 % éch. 19/06/2030                        | AUD 700                             | 496                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 13/05/2054                             | \$ 3 555                            | 3 583                            | 0,05                      |
| NSW Ports Finance Co. Pty. Ltd.                |                                     |                                  |                           | New South Wales Treasury Corp.                                                         |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 12/01/2056                             | 4 638                               | 4 669                            | 0,06                      |
| 5,042 % éch. 19/09/2031                        | 6 300                               | 4 290                            | 0,06                      | 1,750 % éch. 20/03/2034                                                                | 3 700                               | 2 021                            | 0,03                      |                                                     |                                     | 25 005                           | 0,34                      |
| 5,432 % éch. 19/09/2034                        | 11 600                              | 7 824                            | 0,11                      | 3,500 % éch. 20/11/2037                                                                | 7 000                               | 4 046                            | 0,05                      | Total Brésil                                        |                                     | 33 004                           | 0,45                      |
| Optus Finance Pty. Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 20/02/2037                                                                | 1 700                               | 1 117                            | 0,02                      | CANADA                                              |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 20/06/2029                        | € 1 700                             | 1 823                            | 0,02                      | Queensland Treasury Corp.                                                              |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           |
| Origin Energy Finance Ltd.                     |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 20/08/2032                                                                | 12 600                              | 7 179                            | 0,10                      | Air Canada Pass-Through Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 17/09/2029                        | 10 800                              | 11 511                           | 0,16                      | Treasury Corp. of Victoria                                                             |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 15/07/2031                             | 1 931                               | 1 837                            | 0,02                      |
| Perth Airport Pty. Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 20/11/2037                                                                | 19 000                              | 9 240                            | 0,12                      | 3,600 % éch. 15/09/2028                             | 4 831                               | 4 789                            | 0,06                      |
| Qantas Airways Ltd.                            |                                     |                                  |                           | Western Australian Treasury Corp.                                                      |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/06/2029                             | 2 071                               | 2 041                            | 0,03                      |
| 3,150 % éch. 27/09/2028                        | 500                                 | 330                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 24/10/2039                                                                | 1 100                               | 780                              | 0,01                      | 5,250 % éch. 01/10/2030                             | 2 011                               | 2 026                            | 0,03                      |
| 5,900 % éch. 19/09/2034                        | 7 700                               | 5 262                            | 0,07                      | Total Australie                                                                        |                                     | 442 870                          | 5,99                      | Brookfield Asset Management Ltd.                    |                                     |                                  |                           |
| QBE Insurance Group Ltd.                       |                                     |                                  |                           | AUTRICHE                                                                               |                                     |                                  |                           | 4,832 % éch. 15/04/2031                             | 12 300                              | 12 188                           | 0,16                      |
| 5,834 % éch.                                   |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | Brookfield Finance, Inc.                            |                                     |                                  |                           |
| 03/10/2035 (h)                                 | \$ 6 900                            | 7 068                            | 0,10                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 29/03/2029                             | 4 834                               | 4 842                            | 0,07                      |
| QPH Finance Co. Pty. Ltd.                      |                                     |                                  |                           | ams-OSRAM AG                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,330 % éch. 15/01/2036                             | 6 600                               | 6 496                            | 0,09                      |
| 5,302 % éch. 05/03/2032                        | AUD 5 300                           | 3 620                            | 0,05                      | 10,500 % éch. 30/03/2029                                                               | € 11 741                            | 14 318                           | 0,19                      | Canadian Imperial Bank of Commerce                  |                                     |                                  |                           |
| 5,695 % éch. 05/03/2035                        | 9 890                               | 6 723                            | 0,09                      | CA Immobilien Anlagen AG                                                               |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 01/10/2029                             | € 5 400                             | 6 129                            | 0,08                      |
| Santos Finance Ltd.                            |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch.                                                                           |                                     |                                  |                           | Canadian Natural Resources Ltd.                     |                                     |                                  |                           |
| 3,649 % éch. 29/04/2031                        | \$ 7 600                            | 7 112                            | 0,10                      | 07/07/2029 (b)                                                                         | 4 200                               | 4 781                            | 0,06                      | 5,000 % éch. 15/12/2029                             | \$ 2 400                            | 2 425                            | 0,03                      |
| 4,125 % éch. 14/09/2027                        | 7 800                               | 7 735                            | 0,10                      | Erste Group Bank AG                                                                    |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/03/2038                             | 7 500                               | 7 916                            | 0,11                      |
|                                                |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 09/01/2031                                                                | 8 100                               | 9 254                            | 0,13                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           | Unicredit Bank Austria AG                                                              |                                     |                                  |                           |                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 10/11/2028                                                                | 3 300                               | 3 781                            | 0,05                      |                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                |                                     |                                  |                           | Total Autriche                                                                         |                                     | 32 134                           | 0,43                      |                                                     |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                                                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                  | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET                    | DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                                                                                         | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                                                                                     | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET                                                                                                                                                            |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| CI Financial Corp.<br>4,100 % éch. 15/06/2051<br>4,750 % éch. 03/04/2028<br>6,000 % éch. 20/09/2027                                                                                     | \$ 5 037<br>CAD 11 000<br>1 000                       | \$ 3 407<br>7 855<br>724                          | 0,05<br>0,11<br>0,01                         | 4,875 % éch.<br>14/02/2035<br>5,250 % éch.<br>13/10/2032                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | \$ 1 700<br>4 000                                                                                                                           | \$ 1 654<br>4 015                                                                                                                    | 0,02<br>0,05                                                                                                                                                                         |
| Enbridge, Inc.<br>3,125 % éch. 15/11/2029<br>5,625 % éch. 05/04/2034                                                                                                                    | \$ 950<br>5 099                                       | 905<br>5 255                                      | 0,01<br>0,07                                 | GGAM Finance Ltd.<br>8,000 % éch.<br>15/02/2027                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 2 700                                                                                                                                       | 2 711                                                                                                                                | 0,04                                                                                                                                                                                 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd.<br>2,750 % éch. 29/03/2028                                                                                                                              | € 29 201                                              | 33 178                                            | 0,45                                         | QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch.<br>19/09/2027                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 19 100                                                                                                                                      | 19 095                                                                                                                               | 0,26                                                                                                                                                                                 |
| Ford Credit Canada Co.<br>4,398 % éch. 09/04/2029 (i)                                                                                                                                   | CAD 4 700                                             | 3 334                                             | 0,05                                         | 4,679 % éch.<br>27/04/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 9 000                                                                                                                                       | 9 045                                                                                                                                | 0,12                                                                                                                                                                                 |
| Ford Credit Canada Co. Cie Credit Ford Du Canada<br>4,916 % éch. 09/01/2031 (i)                                                                                                         | 500                                                   | 358                                               | 0,00                                         | SRC Sukuk Ltd.<br>5,375 % éch.<br>27/02/2035                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 10 000                                                                                                                                      | 10 168                                                                                                                               | 0,14                                                                                                                                                                                 |
| Open Text Corp.<br>6,900 % éch. 01/12/2027                                                                                                                                              | \$ 1 000                                              | 1 023                                             | 0,01                                         | Suci Second Investment Co.<br>6,000 % éch.<br>25/10/2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 800                                                                                                                                         | 820                                                                                                                                  | 0,01                                                                                                                                                                                 |
| Rogers Communications, Inc.<br>3,650 % éch. 31/03/2027                                                                                                                                  | CAD 1 800                                             | 1 273                                             | 0,02                                         | Yorkshire Power Finance Ltd.<br>7,250 % éch.<br>04/08/2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | £ 6 800                                                                                                                                     | 9 424                                                                                                                                | 0,13                                                                                                                                                                                 |
| Royal Bank of Canada<br>3,500 % éch. 25/07/2028                                                                                                                                         | € 1 000                                               | 1 159                                             | 0,02                                         | Total Îles Caïmans                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                             | 116 162                                                                                                                              | 1,57                                                                                                                                                                                 |
| Toronto-Dominion Bank<br>2,582 % éch. 16/02/2027<br>2,776 % éch. 03/09/2027<br>3,191 % éch. 16/02/2029<br>3,247 % éch. 16/02/2034<br>4,680 % éch. 08/01/2029<br>5,376 % éch. 21/10/2027 | 3 330<br>1 700<br>3 330<br>3 330<br>CAD 14 396<br>800 | 3 811<br>1 944<br>3 841<br>3 833<br>10 471<br>580 | 0,05<br>0,03<br>0,05<br>0,05<br>0,14<br>0,01 | CHILI<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES<br>Obligation internationale du gouvernement chilien<br>3,750 % éch.<br>14/01/2032                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | € 3 300                                                                                                                                     | 3 822                                                                                                                                | 0,05                                                                                                                                                                                 |
| Waste Connections, Inc.<br>4,200 % éch. 15/01/2033                                                                                                                                      | \$ 475                                                | 457                                               | 0,01                                         | COLOMBIE<br>Obligation internationale du gouvernement colombien<br>5,375 % éch.<br>21/01/2029<br>5,750 % éch.<br>26/11/2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 4 500<br>4 800                                                                                                                              | 4 492<br>5 590                                                                                                                       | 0,06<br>0,07                                                                                                                                                                         |
|                                                                                                                                                                                         |                                                       | 134 097                                           | 1,82                                         | TES colombien<br>7,000 % éch.<br>30/06/2032<br>9,250 % éch.<br>28/05/2042<br>11,000 % éch.<br>22/08/2029<br>11,500 % éch.<br>25/07/2046<br>11,750 % éch.<br>24/01/2035<br>12,500 % éch.<br>27/02/2030<br>12,750 % éch.<br>28/11/2040<br>13,250 % éch.<br>09/02/2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | COP 1 251 200<br>288<br>1 192 000<br>56 947 200<br>4 093 200<br>4 084 900<br>15 371 200<br>4 486<br>50 581 700<br>14 172                    | 0,00<br>0,00<br>0,22<br>0,02<br>0,02<br>0,06<br>0,21<br>0,19                                                                         |                                                                                                                                                                                      |
| Total Canada                                                                                                                                                                            |                                                       | 146 852                                           | 1,99                                         | Total Colombie                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                             | 62 962<br>71 619                                                                                                                     | 0,85<br>0,97                                                                                                                                                                         |
| ÎLES CAÏMANS<br>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                                                                                                              |                                                       |                                                   |                                              | COSTA RICA<br>ÉMISSIONS SOUVERAINES<br>Obligation internationale du gouvernement costaricain<br>5,950 % éch.<br>27/04/2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |
| AGL CLO Ltd.<br>4,802 % éch. 02/12/2034                                                                                                                                                 | \$ 3 100                                              | 3 104                                             | 0,04                                         | REPUBLIQUE TCHÈQUE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS<br>EPH Financing International A/S<br>4,625 % éch.<br>02/07/2032<br>5,875 % éch.<br>30/11/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 4 300<br>2 800                                                                                                                              | 5 019<br>3 405                                                                                                                       | 0,07<br>0,04                                                                                                                                                                         |
| Atlantic Avenue Ltd.<br>4,935 % éch. 20/01/2035<br>5,053 % éch. 15/10/2038                                                                                                              | 3 000<br>4 100                                        | 3 003<br>4 114                                    | 0,04<br>0,06                                 | Total République tchèque                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                             | 8 424                                                                                                                                | 0,11                                                                                                                                                                                 |
| Barings Private Credit Corp. CLO<br>5,126 % éch. 22/05/2034                                                                                                                             | 2 300                                                 | 2 302                                             | 0,03                                         | DANEMARK<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS<br>Danske Bank A/S<br>5,000 % éch. 13/09/2033<br>H Lundbeck A/S<br>0,875 % éch. 14/10/2027<br>3,375 % éch. 02/06/2029<br>Jyske Realkredit A/S<br>1,500 % éch. 01/10/2053<br>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab<br>1,000 % éch. 01/10/2050<br>Nykredit Realkredit A/S<br>1,000 % éch. 01/10/2050<br>1,000 % éch. 01/10/2053<br>1,500 % éch. 01/10/2053<br>Realkredit Danmark A/S<br>1,000 % éch. 01/10/2050<br>1,000 % éch. 01/10/2053<br>1,500 % éch. 01/10/2053<br>TDC Net A/S<br>5,000 % éch. 09/08/2032                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 288<br>281<br>16 031<br>1 152<br>1 164<br>4 486<br>15 306<br>14 172                                                                         | 0,00<br>0,00<br>0,22<br>0,02<br>0,02<br>0,06<br>0,21<br>0,19                                                                         |                                                                                                                                                                                      |
| Benefit Street Partners CLO Ltd.<br>4,825 % éch. 20/04/2035                                                                                                                             | 2 800                                                 | 2 801                                             | 0,04                                         | Total Danemark                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                             | 38 256                                                                                                                               | 0,52                                                                                                                                                                                 |
| Canyon Capital CLO Ltd.<br>4,683 % éch. 15/10/2034                                                                                                                                      | 1 000                                                 | 1 001                                             | 0,01                                         | FINLANDE<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS<br>Balder Finland Oyj<br>1,000 % éch. 20/01/2029<br>Lumo Kodit Oyj<br>4,000 % éch. 20/05/2030<br>SP Kiinnitysluottopankki Oyj<br>3,250 % éch. 02/05/2031<br>Total Finlande                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 4 500<br>2 400                                                                                                                              | 5 831<br>2 731                                                                                                                       | 0,08<br>0,04                                                                                                                                                                         |
| Marble Point CLO Ltd.<br>4,887 % éch. 25/07/2034                                                                                                                                        | 3 600                                                 | 3 604                                             | 0,05                                         | FRANCE<br>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS<br>FCT Noria<br>2,812 % éch. 25/07/2043                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 5 100                                                                                                                                       | 5 831                                                                                                                                | 0,08                                                                                                                                                                                 |
| Symphony CLO Ltd.<br>4,796 % éch. 23/10/2035<br>4,823 % éch. 15/10/2035                                                                                                                 | 2 000<br>3 000                                        | 2 002<br>3 004                                    | 0,03<br>0,04                                 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS<br>ARGAN S.A.<br>3,779 % éch. 30/10/2029<br>Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.<br>4,541 % éch. 15/01/2031<br>BNP Paribas S.A.<br>1,904 % éch. 30/09/2028<br>3,132 % éch. 20/01/2033<br>4,892 % éch. 30/06/2030<br>BPCE S.A.<br>5,184 % éch. 02/06/2032<br>5,716 % éch. 18/01/2030<br>5,936 % éch. 30/05/2035<br>6,612 % éch. 19/10/2027<br>6,714 % éch. 19/10/2029<br>BPCE SFH S.A.<br>3,000 % éch. 15/01/2031<br>3,000 % éch. 24/03/2032<br>Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.<br>2,750 % éch. 12/01/2029<br>3,000 % éch. 12/01/2034<br>Crédit Agricole Home Loan SFH S.A.<br>2,875 % éch. 12/01/2034<br>Crédit Agricole S.A.<br>4,656 % éch. 12/01/2032<br>Électricité de France S.A.<br>4,500 % éch. 21/09/2028<br>5,250 % éch. 22/04/2036<br>Imerys S.A.<br>4,000 % éch. 21/11/2032<br>Indigo Group S.A.S.<br>3,750 % éch. 24/04/2032<br>New Immo Holding S.A.<br>4,875 % éch. 08/12/2028<br>4,950 % éch. 14/11/2030<br>5,500 % éch. 23/04/2031 | 2 600<br>26 100<br>€ 4 500<br>2 400<br>1 500<br>5 900<br>6 900<br>\$ 7 800<br>7 400<br>5 100<br>€ 1 000<br>2 200<br>4 000<br>1 900<br>8 400 | 2 616<br>27 130<br>5 148<br>2 731<br>1 712<br>6 645<br>7 725<br>7 679<br>7 385<br>5 009<br>1 139<br>2 534<br>4 593<br>2 169<br>9 649 | 0,04<br>0,37<br>0,07<br>0,08<br>0,27<br>0,11<br>0,03<br>0,03<br>0,04<br>0,37<br>0,07<br>0,04<br>0,02<br>0,09<br>0,11<br>0,10<br>0,10<br>0,07<br>0,02<br>0,03<br>0,06<br>0,03<br>0,13 |
| Trinitas CLO Ltd.<br>4,777 % éch. 25/01/2034<br>4,825 % éch. 20/10/2034                                                                                                                 | 3 002<br>4 700                                        | 3 004<br>4 706                                    | 0,04<br>0,06                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |
|                                                                                                                                                                                         |                                                       | 32 645                                            | 0,44                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                                                                                                           |                                                       |                                                   |                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.<br>2,528 % éch. 18/11/2027<br>2,750 % éch. 21/02/2028<br>4,200 % éch. 15/04/2029<br>4,950 % éch. 15/10/2032<br>5,750 % éch. 15/11/2029                     | 5 169<br>7 400<br>9 300<br>1 500<br>9 300             | 5 017<br>7 173<br>9 136<br>1 464<br>9 512         | 0,07<br>0,10<br>0,12<br>0,02<br>0,13         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |
| China Modern Dairy Holdings Ltd.<br>2,125 % éch. 14/07/2026                                                                                                                             | 9 200                                                 | 9 192                                             | 0,12                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |
| Gaci First Investment Co.<br>4,750 % éch. 14/02/2030<br>4,875 % éch. 14/05/2029                                                                                                         | 2 600<br>15 200                                       | 2 584<br>15 152                                   | 0,03<br>0,21                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                             |                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                      |

| DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Orange S.A.<br>4,750 % éch. 13/01/2033                                           | \$ 5 500                            | \$ 5 397                         | 0,07                      | <b>INDONESIE</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| Peugeot Invest S.A.<br>1,875 % éch. 30/10/2026                                   | € 18 300                            | 20 849                           | 0,28                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| SEB S.A.<br>3,625 % éch. 24/06/2030                                              | 3 900                               | 4 387                            | 0,06                      | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara                 | \$ 7 800                            | \$ 5 435                         | 0,07                      |
| Société Générale S.A.<br>4,857 % éch. 07/07/2029 (b)                             | \$ 18 700                           | 18 698                           | 0,25                      | 4,125 % éch. 15/05/2027                                                   | 1 400                               | 1 392                            | 0,02                      |
| 5,249 % éch. 22/05/2029                                                          | 1 700                               | 1 713                            | 0,02                      | 4,875 % éch. 17/07/2049                                                   | 700                                 | 566                              | 0,01                      |
| Ubisoft Entertainment S.A.<br>0,878 % éch. 24/11/2027 (j)                        | € 18 400                            | 18 615                           | 0,25                      |                                                                           |                                     | 7 393                            | 0,10                      |
|                                                                                  |                                     | 217 417                          | 2,94                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement indonésien                      | € 3 700                             | 4 158                            | 0,06                      |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale<br>3,000 % éch. 25/11/2031            | 4 300                               | 4 893                            | 0,06                      | 4,100 % éch. 04/03/2034                                                   | € 3 700                             | 4 158                            | 0,06                      |
| Total France                                                                     |                                     | 228 141                          | 3,08                      | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                                        | \$ 6 600                            | 6 116                            | 0,08                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 2,800 % éch. 23/06/2030                                                   | 600                                 | 600                              | 0,01                      |
| <b>ALLEMAGNE</b>                                                                 |                                     |                                  |                           | 4,450 % éch. 20/02/2029                                                   |                                     | 10 874                           | 0,15                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | Total Indonésie                                                           |                                     | 18 267                           | 0,25                      |
| Amprion GmbH<br>2,750 % éch. 30/09/2029                                          | 5 200                               | 5 868                            | 0,08                      | <b>IRLANDE</b>                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,162 % éch. 15/01/2031                                                          | 3 300                               | 3 745                            | 0,05                      | <b>TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH<br>7,125 % éch. 15/06/2031                         | 3 025                               | 3 551                            | 0,05                      | Bain Capital Euro CLO DAC                                                 | € 5 200                             | 5 952                            | 0,08                      |
| Deutsche Bank AG<br>1,750 % éch. 19/11/2030                                      | 4 100                               | 4 439                            | 0,06                      | 3,444 % éch. 22/01/2038                                                   | € 5 200                             | 5 952                            | 0,08                      |
| 5,000 % éch. 05/09/2030                                                          | 7 800                               | 9 344                            | 0,13                      | Barings Euro CLO DAC                                                      | 3 600                               | 4 122                            | 0,06                      |
| 6,125 % éch. 12/12/2030                                                          | € 1 100                             | 1 509                            | 0,02                      | 3,444 % éch. 21/10/2038                                                   | 3 600                               | 4 122                            | 0,06                      |
| DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH<br>2,500 % éch. 25/01/2027 | € 8 100                             | 9 216                            | 0,12                      | Capital Four CLO DAC                                                      | 2 800                               | 3 205                            | 0,04                      |
| 4,875 % éch. 21/08/2030                                                          | 5 500                               | 6 423                            | 0,09                      | 3,415 % éch. 25/10/2038                                                   | 2 800                               | 3 205                            | 0,04                      |
| HOCHTIEF AG<br>1,250 % éch. 03/09/2031                                           | 1 500                               | 1 532                            | 0,02                      | CVC Cordatus Loan Fund DAC                                                | 1 000                               | 1 146                            | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 15/04/2034                                                          | 2 100                               | 2 416                            | 0,03                      | 3,528 % éch. 15/05/2037                                                   | 1 000                               | 1 146                            | 0,01                      |
| Robert Bosch GmbH<br>4,000 % éch. 21/05/2036                                     | 3 200                               | 3 675                            | 0,05                      | Harvest CLO DAC                                                           | 2 300                               | 2 634                            | 0,04                      |
| TAG Immobilien AG<br>3,625 % éch. 03/03/2032                                     | 4 200                               | 4 753                            | 0,06                      | 3,464 % éch. 15/10/2038                                                   | 2 300                               | 2 634                            | 0,04                      |
| Volkswagen Financial Services AG<br>3,250 % éch. 19/05/2027                      | 10 200                              | 11 696                           | 0,16                      | Hayfin Emerald CLO DAC                                                    | 2 600                               | 2 975                            | 0,04                      |
| Vonovia SE<br>6,385 % éch. 20/05/2033                                            | AUD 10 100                          | 7 139                            | 0,10                      | 3,454 % éch. 15/10/2038                                                   | 1 000                               | 1 144                            | 0,02                      |
| Total Allemagne                                                                  |                                     | 75 306                           | 1,02                      | 3,498 % éch. 18/10/2039                                                   | 1 000                               | 1 144                            | 0,02                      |
| <b>GUERNSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                                            |                                     |                                  |                           | MV Credit Euro CLO DAC                                                    | 1 000                               | 1 144                            | 0,02                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | 3,583 % éch. 15/02/2038                                                   | 1 000                               | 1 144                            | 0,02                      |
| Amdocs Ltd.<br>2,538 % éch. 15/06/2030                                           | \$ 5 875                            | 5 299                            | 0,07                      | OCP Euro CLO DAC                                                          | 1 010                               | 1 156                            | 0,02                      |
| Globalworth Real Estate Investments Ltd.<br>6,250 % éch. 31/03/2030              | € 7 495                             | 8 752                            | 0,12                      | 3,468 % éch. 20/10/2039                                                   | 1 010                               | 1 156                            | 0,02                      |
| Sirius Real Estate Ltd.<br>1,750 % éch. 24/11/2028                               | 11 600                              | 12 817                           | 0,17                      | Palmer Square European Loan Funding DAC                                   | 2 222                               | 2 541                            | 0,03                      |
| 4,000 % éch. 22/01/2032                                                          | 6 500                               | 7 385                            | 0,10                      | 3,134 % éch. 15/07/2035                                                   | 2 222                               | 2 541                            | 0,03                      |
| Total Guernsey, Îles Anglo-Normandes                                             |                                     | 34 253                           | 0,46                      | Providus CLO DAC                                                          | 2 000                               | 2 289                            | 0,03                      |
| <b>HONGRIE</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,513 % éch. 15/11/2039                                                   | 2 000                               | 2 289                            | 0,03                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                     |                                     |                                  |                           | Rockford Tower Europe CLO DAC                                             | 1 500                               | 1 717                            | 0,02                      |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois                               | 5 600                               | 6 704                            | 0,09                      | 3,489 % éch. 29/08/2036                                                   | 1 500                               | 1 717                            | 0,02                      |
| Magyar Export-Import Bank<br>4,500 % éch. 27/11/2031                             | 2 800                               | 3 293                            | 0,04                      | Tikehau CLO DAC                                                           | 2 750                               | 3 150                            | 0,04                      |
| Magyar Fejlesztési Bank Zrt<br>6,500 % éch. 29/06/2028                           | \$ 4 000                            | 4 122                            | 0,06                      |                                                                           |                                     | 33 175                           | 0,45                      |
| Total Hongrie                                                                    |                                     | 14 119                           | 0,19                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>INDE</b>                                                                      |                                     |                                  |                           | AerCap Ireland Capital DAC                                                | \$ 15 100                           | 14 538                           | 0,19                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 29/10/2028                                                   | \$ 15 100                           | 14 538                           | 0,19                      |
| Adani Transmission Step-One Ltd.<br>4,250 % éch. 21/05/2036                      | 13 145                              | 11 912                           | 0,16                      | Flutter Treasury DAC                                                      | € 1 200                             | 1 353                            | 0,02                      |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.<br>7,110 % éch. 11/03/2032                    | 11 450                              | 11 609                           | 0,16                      | 4,000 % éch. 04/06/2031                                                   | € 1 200                             | 1 353                            | 0,02                      |
| Total Inde                                                                       |                                     | 23 521                           | 0,32                      | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.<br>5,000 % éch. 24/06/2033 | \$ 7 400                            | 7 420                            | 0,10                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 23 311                           | 0,31                      |
| <b>ISRAËL</b>                                                                    |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                    |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                             |                                     |                                  |                           | République du Panama                                                      | € 9 500                             | 10 878                           | 0,15                      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                             | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      | 3,886 % éch. 05/03/2027                                                   | € 9 500                             | 10 878                           | 0,15                      |
| 5,343 % éch. 29/06/2029                                                          | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      | Total Irlande                                                             |                                     | 67 364                           | 0,91                      |
|                                                                                  |                                     | 16 567                           | 0,22                      | <b>ÎLE DE MAN</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | AngloGold Ashanti Holdings PLC                                            | \$ 5 557                            | 5 259                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/10/2030                                                   | \$ 5 557                            | 5 259                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>3,197 % éch. 22/01/2032                      | € 10 100                            | 11 446                           | 0,15                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,343 % éch. 29/06/2029                                                   | \$ 5 100                            | 5 121                            | 0,07                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                           |                                     | 16 567                           | 0,22                      |
|                                                                                  |                                     |                                  |                           | <b>ISRAËL</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                                  | </                                  |                                  |                           |                                                                           |                                     |                                  |                           |



## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |         |         |      |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------|---------|------|
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.               |                                     |                                  |                           | Greensaif Pipelines Bidco SARL                     |                                     |                                  |                           | Digital Dutch Finco BV                                                                    |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 2,130 % éch. 08/07/2030                             | \$ 3 500                            | \$ 3 159                         | 0,04                      | 5,853 % éch. 23/02/2036                            | \$ 8 700                            | \$ 8 888                         | 0,12                      | 1,250 % éch. 01/02/2031                                                                   | € 4 400                             | \$ 4 538                         | 0,06                      |         |         |      |
| 2,750 % éch. 15/01/2030                             | 2 018                               | 1 882                            | 0,03                      | Logicor Financing SARL                             |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 13/09/2033                                                                   | 2 100                               | 2 385                            | 0,03                      |         |         |      |
| 3,040 % éch. 16/07/2029                             | 1 000                               | 952                              | 0,01                      | 1,625 % éch. 15/07/2027                            | € 11 301                            | 12 738                           | 0,17                      | 3,875 % éch. 15/07/2034                                                                   | 4 800                               | 5 410                            | 0,07                      |         |         |      |
| 4,494 % éch. 15/01/2032                             | 1 800                               | 1 767                            | 0,02                      | Novartis Finance S.A.                              |                                     |                                  |                           | EnBW International Finance BV                                                             |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 5,710 % éch. 13/01/2030                             | 3 000                               | 3 088                            | 0,04                      | 3,100 % éch. 13/01/2032                            |                                     |                                  |                           | 5,302 % éch. 30/10/2029                                                                   | AUD 6 500                           | 4 515                            | 0,06                      |         |         |      |
|                                                     |                                     | 121 363                          | 1,64                      | P3 Group SARL                                      |                                     |                                  |                           | ENEL Finance International NV                                                             |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                           | 1,625 % éch. 26/01/2029                            | 2 000                               | 2 194                            | 0,03                      | 2,125 % éch. 12/07/2028                                                                   | \$ 165                              | 157                              | 0,00                      |         |         |      |
| Obligation internationale du gouvernement japonais  |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 22/03/2031                            | 8 700                               | 9 820                            | 0,13                      | 4,375 % éch. 30/09/2030                                                                   | 600                                 | 590                              | 0,01                      |         |         |      |
| 2,000 % éch. 20/12/2044                             | ¥ 3 840 000                         | 18 737                           | 0,25                      | SELP Finance SARL                                  |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 26/06/2029                                                                   | 590                                 | 597                              | 0,01                      |         |         |      |
| 2,100 % éch. 20/09/2054                             | 215 600                             | 915                              | 0,01                      | 3,875 % éch. 21/04/2031                            | 8 100                               | 9 341                            | 0,13                      | Galderma Finance Europe BV                                                                |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 2,200 % éch. 20/03/2064                             | 11 000                              | 46                               | 0,00                      | 4,000 % éch. 29/06/2033                            | 3 800                               | 4 367                            | 0,06                      | 3,375 % éch. 17/03/2031                                                                   | € 1 400                             | 1 598                            | 0,02                      |         |         |      |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                             | 92 400                              | 411                              | 0,01                      | TMS Issuer SARL                                    |                                     |                                  |                           | IMCD NV                                                                                   |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 2,400 % éch. 20/03/2045                             | 2 968 800                           | 15 410                           | 0,21                      | 5,780 % éch. 23/08/2032                            | \$ 7 000                            | 7 164                            | 0,10                      | 3,625 % éch. 30/04/2030                                                                   | 3 200                               | 3 670                            | 0,05                      |         |         |      |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                             | 686 000                             | 3 128                            | 0,04                      |                                                    |                                     | 86 032                           | 1,16                      | 4,875 % éch. 18/09/2028                                                                   | 4 100                               | 4 828                            | 0,07                      |         |         |      |
| 2,700 % éch. 20/09/2045                             | 169 350                             | 916                              | 0,01                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | Imperial Brands Finance Netherlands BV                                                    |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                             | 4 297 000                           | 23 214                           | 0,32                      | Eagle Funding Luxco SARL                           |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/02/2031                                                                   | 10 200                              | 12 479                           | 0,17                      |         |         |      |
| 3,700 % éch. 20/03/2056                             | 1 392 350                           | 8 280                            | 0,11                      | 5,500 % éch. 17/08/2030                            |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                                                                              |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| Gouvernement de la métropole de Tokyo               |                                     |                                  |                           | Total Luxembourg                                   | 24 100                              | 24 228                           | 0,33                      | 4,803 % éch. 23/03/2032                                                                   | \$ 13 000                           | 12 917                           | 0,18                      |         |         |      |
| 4,125 % éch. 30/04/2031                             | \$ 11 700                           | 11 572                           | 0,16                      |                                                    |                                     | 110 260                          | 1,49                      | JAB Holdings BV                                                                           |                                     |                                  |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     | 82 629                           | 1,12                      | ACTIONS                                            |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 23/11/2030                                                                   | 7 420                               | 6 650                            | 0,09                      |         |         |      |
| Total Japon                                         |                                     | 203 992                          | 2,76                      | MEXIQUE                                            |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 19/05/2035                                                                   | € 900                               | 1 063                            | 0,01                      |         |         |      |
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES                        |                                     |                                  |                           | ACTIONS ORDINAIRES                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 12/06/2033                                                                   | 1 900                               | 2 327                            | 0,03                      |         |         |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                          |                                     |                                  |                           | Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (c)            |                                     |                                  |                           | JDE Peet's NV                                                                             |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                        |                                     |                                  |                           |                                                    | 427 064                             | 0                                | 0,00                      | 4,125 % éch. 23/01/2030                                                                   | 4 700                               | 5 480                            | 0,07                      |         |         |      |
| 4,814 % éch. 22/04/2035                             | 4 300                               | 4 304                            | 0,06                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 23/01/2034                                                                   | 8 200                               | 9 592                            | 0,13                      |         |         |      |
| 4,840 % éch. 17/07/2035                             | 2 700                               | 2 703                            | 0,03                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | Lineage Europe Finco BV                                                                   |                                     |                                  |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     | 7 007                            | 0,09                      | BBVA Bancomer S.A.                                 |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 26/11/2031                                                                   | 12 000                              | 13 701                           | 0,19                      |         |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 13/09/2034 (h)                        |                                     |                                  |                           | 4,231 % éch. 29/09/2030                                                                   | 5 400                               | 6 417                            | 0,09                      |         |         |      |
| Watnick Funding Ltd.                                |                                     |                                  |                           | \$ 8 000                                           | 7 879                               | 0,11                             | Magnum Icc Finance BV     |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 2,625 % éch. 07/10/2048                             | £ 1 500                             | 1 149                            | 0,02                      | 13 200                                             | 13 642                              | 0,18                             | 3,250 % éch. 26/11/2031   | 5 000                                                                                     | 5 654                               | 0,08                             |                           |         |         |      |
| 3,125 % éch. 28/09/2041                             | 1 600                               | 1 555                            | 0,02                      | Petroleos Mexicanos                                |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 26/11/2034                                                                   | 4 800                               | 5 432                            | 0,07                      |         |         |      |
| 3,625 % éch. 16/10/2035                             | € 8 100                             | 9 194                            | 0,13                      | 2,750 % éch. 21/04/2027                            |                                     |                                  |                           | NE Property BV                                                                            |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 3,875 % éch. 24/06/2035                             | 7 500                               | 8 521                            | 0,12                      | Trust 2401                                         |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 30/09/2033                                                                   | 1 400                               | 1 587                            | 0,02                      |         |         |      |
| GSG Bidco Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | \$ 989                                             | 964                                 | 0,01                             | Sagax Euro MTN NL BV      |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 4,700 % éch. 15/06/2031                             | 6 800                               | 7 711                            | 0,10                      | 5 129                                              | 5 454                               | 0,07                             | 1,000 % éch. 17/05/2029   | 800                                                                                       | 857                                 | 0,01                             |                           |         |         |      |
| 5,375 % éch. 15/06/2036                             | 7 400                               | 8 398                            | 0,11                      | Trust Fibra Uno                                    |                                     |                                  |                           | Sandoz Finance BV                                                                         |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| Heathrow Funding Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 4,869 % éch. 15/01/2030                            | 511                                 | 493                              | 0,01                      | 3,250 % éch. 12/09/2029                                                                   | 3 400                               | 3 894                            | 0,05                      |         |         |      |
| 1,875 % éch. 12/07/2032                             | 3 800                               | 3 964                            | 0,05                      | 7,375 % éch. 13/02/2034                            | 2 071                               | 2 201                            | 0,03                      | SGS Finance BV                                                                            |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 4,500 % éch. 11/07/2035                             | 1 300                               | 1 551                            | 0,02                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 10/09/2030                                                                   | 1 100                               | 1 251                            | 0,02                      |         |         |      |
| 6,450 % éch. 10/12/2033                             | £ 1 376                             | 1 936                            | 0,03                      | Obligation internationale du gouvernement mexicain |                                     |                                  |                           | Simon Global Development BV                                                               |                                     |                                  |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     | 43 979                           | 0,60                      | 3,500 % éch. 19/09/2029                            |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 15/06/2031                                                                   | 14 500                              | 16 715                           | 0,23                      |         |         |      |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                  |                                     | 50 986                           | 0,69                      | € 5 000                                            | 5 679                               | 0,08                             | Technip Energies NV       |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| KOWEÏT                                              |                                     |                                  |                           | \$ 7 100                                           | 6 934                               | 0,09                             | 4,000 % éch. 10/06/2033   | 600                                                                                       | 690                                 | 0,01                             |                           |         |         |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 22/03/2031                            | 10 000                              | 10 240                           | 0,14                      | Universal Music Group NV                                                                  |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït |                                     |                                  |                           | 6,350 % éch. 09/02/2035                            | 3 000                               | 3 151                            | 0,04                      | 3,375 % éch. 16/06/2030                                                                   | 13 000                              | 14 964                           | 0,20                      |         |         |      |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (i)                         | \$ 7 500                            | 7 487                            | 0,10                      | 6,875 % éch. 13/05/2037                            |                                     |                                  | 3,750 % éch. 30/06/2032   | 3 500                                                                                     | 4 057                               | 0,06                             |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  | 4,000 % éch. 13/06/2031   | 2 700                                                                                     | 3 176                               | 0,04                             |                           |         |         |      |
| LETTONIE                                            |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  | 4,125 % éch. 16/06/2036   | 5 300                                                                                     | 6 144                               | 0,08                             |                           |         |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           | MULTINATIONALES                                    |                                     |                                  |                           | Volkswagen Financial Services NV                                                          |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 04/04/2029                                                                   | £ 2 900                             | 3 855                            | 0,05                      |         |         |      |
| Latvenergo A/S                                      |                                     |                                  |                           | Delta Air Lines, Inc.                              |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     | 190 229                          | 2,57                      |         |         |      |
| 3,612 % éch. 13/11/2030                             | € 700                               | 796                              | 0,01                      | 4,750 % éch. 20/10/2028                            |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES<br>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| LIBERIA                                             |                                     |                                  |                           | JetBlue Airways Corp.                              |                                     |                                  |                           | EMF-NL Prime BV                                                                           |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           | 9,875 % éch. 20/09/2031                            |                                     |                                  |                           | 3,040 % éch. 17/04/2041                                                                   |                                     |                                  |                           | € 36    | 41      | 0,00 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.                        |                                     |                                  |                           | NXP BV                                             |                                     |                                  |                           | Green Lion BV                                                                             |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 5,500 % éch. 01/04/2028                             | \$ 7 600                            | 7 674                            | 0,10                      | 4,300 % éch. 19/08/2028                            |                                     |                                  |                           | 2,588 % éch. 23/10/2060                                                                   |                                     |                                  |                           | 3 600   | 4 118   | 0,06 |
|                                                     |                                     |                                  |                           | Total Multinationales                              |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         | 4 159   | 0,06 |
| LUXEMBOURG                                          |                                     |                                  |                           | PAYS-BAS                                           |                                     |                                  |                           | Total Pays-Bas                                                                            |                                     |                                  |                           |         | 198 280 | 2,68 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                       |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                         |                                     |                                  |                           | NORVÈGE                                                                                   |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| Becton Dickinson Euro Finance SARL                  |                                     |                                  |                           | Contego CLO BV                                     |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                             |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 3,855 % éch. 20/05/2033                             | € 3 500                             | 4 043                            | 0,05                      | 3,454 % éch. 15/04/2038                            |                                     |                                  |                           | € 3 400                                                                                   | 3 892                               | 0,05                             | Aker BP ASA               |         |         |      |
| CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF     |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 01/10/2034                                                                   |                                     |                                  |                           | \$ 200  | 196     | 0,00 |
| 3,875 % éch. 28/05/2031                             | 4 300                               | 4 938                            | 0,07                      | Arcadis NV                                         |                                     |                                  |                           | DNB Bank ASA                                                                              |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| CPI Property Group S.A.                             |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 20/05/2031                            |                                     |                                  |                           | 4,832 % éch. 30/03/2032                                                                   |                                     |                                  |                           | 4 500   | 4 485   | 0,06 |
| 1,750 % éch. 14/01/2030 (j)                         | 7 000                               | 7 023                            | 0,09                      | CTP NV                                             |                                     |                                  |                           | Moere Boligkreditt A/S                                                                    |                                     |                                  |                           |         |         |      |
| 4,750 % éch. 22/07/2030                             | 9 500                               | 10 375                           | 0,14                      | 3,625 % éch. 13/04/2032                            |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 25/09/2029                                                                   |                                     |                                  |                           | € 5 000 | 5 671   | 0,08 |
|                                                     |                                     |                                  |                           | Davide Campari-Milano NV                           |                                     |                                  |                           | PPI Public Property Invest AB                                                             |                                     |                                  |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 17/06/2033                            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 21/04/2033                                                                   |                                     |                                  |                           | 6 600   | 7 448   | 0,10 |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | Sparebanken Norge Boligkreditt A/S                                                        |                                     |                                  |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/11/2028                                                                   |                                     |                                  |                           | 2 000   | 2 318   | 0,03 |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | SR-Boligkreditt A/S                                                                       |                                     |                                  |                           |         |         |      |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 19/02/2032                                                                   |                                     |                                  |                           | 5 700   | 6 579   | 0,09 |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |         |         | 0,00 |

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                               | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |        |      |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------|------|
| Var Energi ASA                                     |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/05/2037                                | €                                   | 2 300                            | \$ 2 595                  | 0,03        | Fastighets AB Balder                                              |                                  |                           |        |      |
| 5,875 % éch. 22/05/2030                            | \$                                  | 7 400                            | \$ 7 625                  | Total Roumanie                                         |                                     |                                  | 62 004                    | 0,84        | 1,125 % éch. 29/01/2027                                           | €                                | 700                       | \$ 792 | 0,01 |
| 8,000 % éch. 15/11/2032                            |                                     | 9 600                            | 10 904                    | ARABIE SAOUDITE                                        |                                     |                                  |                           |             | 3,625 % éch. 25/08/2031                                           |                                  | 5 000                     | 5 623  | 0,08 |
| Total Norvège                                      |                                     | 45 226                           | 0,61                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                          |                                     |                                  |                           |             | PPI Public Property Invest AB                                     |                                  | 6 700                     | 7 624  | 0,10 |
| PANAMA                                             |                                     |                                  |                           | Saudi Arabian Oil Co.                                  |                                     |                                  |                           |             | 3,250 % éch. 21/04/2029                                           |                                  |                           |        |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 02/02/2029                                | \$                                  | 12 300                           | 12 093                    | 0,16        | Sagax AB                                                          |                                  | 2 100                     | 2 367  | 0,03 |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 02/02/2031                                |                                     | 5 000                            | 4 891                     | 0,07        | Verisure Holding AB                                               |                                  | 16 800                    | 19 367 | 0,26 |
| 5,227 % éch. 23/02/2034                            | 1 500                               | 1 476                            | 0,02                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                  |                                     |                                  | 16 984                    | 0,23        | 4,125 % éch. 02/01/2032 (b)                                       |                                  |                           |        |      |
| 5,662 % éch. 23/02/2038                            | 1 700                               | 1 698                            | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien     |                                     |                                  |                           |             | Total Suède                                                       |                                  | 42 068                    | 0,57   |      |
| 6,400 % éch. 14/02/2035                            | 5 000                               | 5 293                            | 0,07                      | 2,250 % éch. 02/02/2033                                |                                     | 18 705                           | 15 914                    | 0,22        | SUISSE                                                            |                                  |                           |        |      |
| Total Panama                                       |                                     | 8 467                            | 0,11                      | 4,750 % éch. 18/01/2028                                |                                     | 52 000                           | 52 032                    | 0,70        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                  |                           |        |      |
| PÉROU                                              |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 18/07/2033                                |                                     | 7 300                            | 7 264                     | 0,10        | UBS AG                                                            |                                  |                           |        |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 13/01/2031                                |                                     | 6 000                            | 6 127                     | 0,08        | 4,678 % éch. 29/11/2030                                           | \$                               | 11 300                    | 11 282 | 0,15 |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.       |                                     |                                  |                           | Total Arabie saoudite                                  |                                     |                                  | 81 337                    | 1,10        | UBS Group AG                                                      |                                  |                           |        |      |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                           | PEN                                 | 3 934                            | 1 269                     | SINGAPOUR                                              |                                     |                                  | 98 321                    | 1,33        | 3,091 % éch. 14/05/2032                                           |                                  | 2 000                     | 1 836  | 0,03 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                          |                                     |                                  |                           |             | 4,151 % éch. 23/12/2029                                           |                                  | 8 600                     | 8 478  | 0,12 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien |                                     |                                  |                           | Maybank Singapore Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |             | 4,214 % éch. 10/04/2030                                           |                                  | 9 700                     | 9 542  | 0,13 |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                            | 55 724                              | 17 700                           | 0,24                      | 3,439 % éch. 07/06/2027                                | €                                   | 4 000                            | 4 603                     | 0,06        | 4,588 % éch. 10/08/2032                                           |                                  | 10 000                    | 9 814  | 0,13 |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                            | 23 501                              | 7 840                            | 0,10                      | SLOVAQUIE                                              |                                     |                                  |                           |             | 5,428 % éch. 08/02/2030                                           |                                  | 1 700                     | 1 724  | 0,02 |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                            | 164 200                             | 53 949                           | 0,73                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                  |                                     |                                  |                           |             | UBS Switzerland AG                                                |                                  |                           |        |      |
|                                                    |                                     | 79 489                           | 1,07                      | Obligation internationale du gouvernement slovaque     |                                     |                                  |                           |             | 2,583 % éch. 23/09/2027                                           | €                                | 4 000                     | 4 560  | 0,06 |
| Total Pérou                                        |                                     | 80 758                           | 1,09                      | 1,875 % éch. 09/03/2037                                |                                     | 500                              | 485                       | 0,01        | 3,304 % éch. 05/03/2029                                           |                                  | 3 100                     | 3 582  | 0,05 |
| POLOGNE                                            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 19/02/2046                                |                                     | 10 000                           | 11 436                    | 0,15        | Total Suisse                                                      |                                  | 50 818                    | 0,69   |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | Total Slovaquie                                        |                                     |                                  | 11 921                    | 0,16        | THAÏLANDE                                                         |                                  |                           |        |      |
| mBank S.A.                                         |                                     |                                  |                           | AFRIQUE DU SUD                                         |                                     |                                  |                           |             | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                  |                           |        |      |
| 3,771 % éch. 03/03/2032                            | €                                   | 9 300                            | 10 635                    | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                  |                                     |                                  |                           |             | GC Treasury Center Co. Ltd.                                       |                                  |                           |        |      |
| Synthos S.A.                                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           |             | 6,500 % éch. 10/09/2030 (f)                                       | \$                               | 2 000                     | 1 979  | 0,03 |
| 2,500 % éch. 07/06/2028                            |                                     | 3 500                            | 3 880                     | 8,875 % éch. 28/02/2035                                | ZAR                                 | 1 317 620                        | 83 313                    | 1,13        | 7,125 % éch. 10/03/2035 (f)                                       |                                  | 900                       | 891    | 0,01 |
|                                                    |                                     | 14 515                           | 0,19                      | CORÉE DU SUD                                           |                                     |                                  |                           |             | Total Thaïlande                                                   |                                  | 2 870                     | 0,04   |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                  |                                     |                                  |                           |             | TURQUIE                                                           |                                  |                           |        |      |
| Obligation internationale du gouvernement polonais |                                     |                                  |                           | Korea Housing Finance Corp.                            |                                     |                                  |                           |             | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                  |                           |        |      |
| 3,875 % éch. 14/02/2033                            | 7 300                               | 8 663                            | 0,12                      | 2,733 % éch. 02/07/2028                                | €                                   | 7 000                            | 7 973                     | 0,11        | Turkish Airlines Pass-Through Trust                               |                                  | 1 171                     | 1 160  | 0,02 |
| 4,250 % éch.                                       |                                     |                                  |                           | 2,742 % éch. 05/03/2030                                |                                     | 8 900                            | 10 085                    | 0,13        | ÉMIRATS ARABES UNIS                                               |                                  |                           |        |      |
| 14/02/2043 (j)                                     |                                     | 2 300                            | 2 668                     | 3,124 % éch. 18/03/2029                                |                                     | 5 000                            | 5 741                     | 0,08        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                  |                           |        |      |
| 5,125 % éch. 18/09/2034                            | \$                                  | 4 000                            | 4 025                     | 4,082 % éch. 25/09/2027                                |                                     | 8 200                            | 9 515                     | 0,13        | Abu Dhabi Future Energy Co. PJSC Masdar                           |                                  | 9 000                     | 9 003  | 0,12 |
|                                                    |                                     |                                  | 15 356                    | Total Corée du Sud                                     |                                     |                                  | 33 314                    | 0,45        | 4,875 % éch. 25/07/2029                                           |                                  |                           |        |      |
| Total Pologne                                      |                                     | 29 871                           | 0,40                      | ESPAGNE                                                |                                     |                                  |                           |             | Emirates NBD Bank PJSC                                            |                                  | 6 700                     | 7 513  | 0,10 |
| PORTUGAL                                           |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                          |                                     |                                  |                           |             | 3,236 % éch. 13/02/2031                                           | €                                |                           |        |      |
| Banco Santander Totta S.A.                         |                                     |                                  |                           | Amadeus IT Group S.A.                                  |                                     |                                  |                           |             | First Abu Dhabi Bank PJSC                                         |                                  |                           |        |      |
| 3,250 % éch. 15/02/2031                            | €                                   | 1 100                            | 1 273                     | 3,750 % éch. 20/05/2031                                |                                     | 3 000                            | 3 465                     | 0,05        | 4,789 % éch. 03/06/2031                                           | \$                               | 11 100                    | 11 098 | 0,15 |
| 3,750 % éch. 11/09/2026                            |                                     | 13 200                           | 15 137                    | Banco Santander S.A.                                   |                                     |                                  |                           |             | 5,000 % éch. 28/02/2029                                           |                                  | 1 000                     | 1 005  | 0,01 |
| Total Portugal                                     |                                     | 16 410                           | 0,22                      | 5,538 % éch. 14/03/2030                                | \$                                  | 7 000                            | 7 135                     | 0,10        | 6,320 % éch. 04/04/2034 (h)                                       |                                  | 4 000                     | 4 083  | 0,06 |
| QATAR                                              |                                     |                                  |                           | 6,499 % éch. 23/01/2031                                | AUD                                 | 7 500                            | 5 384                     | 0,07        |                                                                   |                                  | 32 702                    | 0,44   |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                     |                                  |                           | CaixaBank S.A.                                         |                                     |                                  |                           |             | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                             |                                  |                           |        |      |
| QatarEnergy                                        |                                     |                                  |                           | 4,818 % éch. 22/04/2032                                | \$                                  | 7 500                            | 7 441                     | 0,10        | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                  |                           |        |      |
| 2,250 % éch. 12/07/2031                            | \$                                  | 4 000                            | 3 557                     | Grifols S.A.                                           |                                     |                                  |                           |             | 4,625 % éch. 20/04/2033                                           |                                  | 7 500                     | 7 476  | 0,10 |
| 4,625 % éch. 23/06/2029                            |                                     | 4 810                            | 4 781                     | 7,500 % éch. 01/05/2030 (i)                            | €                                   | 3 440                            | 4 100                     | 0,06        | 4,875 % éch. 30/04/2029                                           |                                  | 14 800                    | 14 910 | 0,20 |
|                                                    |                                     |                                  | 8 338                     | Iberdrola Finanzas S.A.                                |                                     |                                  |                           |             |                                                                   |                                  |                           | 22 386 | 0,30 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | 5,380 % éch. 28/11/2030                                | AUD                                 | 5 700                            | 3 943                     | 0,05        | Total Émirats arabes unis                                         |                                  |                           | 55 088 | 0,74 |
| Obligation internationale du gouvernement qatari   |                                     |                                  |                           | Telefonica Emisiones S.A.                              |                                     |                                  |                           |             | ROYAUME-UNI                                                       |                                  |                           |        |      |
| 4,400 % éch. 16/04/2050                            | 11 100                              | 9 548                            | 0,13                      | 3,941 % éch. 25/06/2035                                | €                                   | 7 900                            | 8 994                     | 0,12        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                     |                                  |                           |        |      |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                            | 8 800                               | 8 848                            | 0,12                      | Total Espagne                                          |                                     |                                  | 40 462                    | 0,55        | Anglian Water Osprey Financing PLC                                |                                  |                           |        |      |
|                                                    |                                     | 18 396                           | 0,25                      | SUPRANATIONALES                                        |                                     |                                  |                           |             | 2,000 % éch. 31/07/2028                                           | £                                | 600                       | 738    | 0,01 |
| Total Qatar                                        |                                     | 26 734                           | 0,36                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                  |                                     |                                  |                           |             | 6,750 % éch. 27/08/2031                                           |                                  | 1 100                     | 1 471  | 0,02 |
| ROUMANIE                                           |                                     |                                  |                           | Union européenne                                       |                                     |                                  |                           |             | Anglian Water Services Financing PLC                              |                                  |                           |        |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 04/02/2043                                |                                     | 1 300                            | 1 038                     | 0,01        | 4,250 % éch. 23/06/2036                                           | €                                | 9 000                     | 10 303 | 0,14 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain  |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 05/10/2029                                |                                     | 10 000                           | 11 497                    | 0,16        | 5,750 % éch. 07/06/2043                                           | £                                | 6 000                     | 7 144  | 0,10 |
| 1,375 % éch. 02/12/2029                            | €                                   | 2 984                            | 3 132                     | 3,375 % éch. 05/10/2054                                |                                     | 24 300                           | 24 840                    | 0,34        | 5,875 % éch. 20/06/2031                                           |                                  | 14 500                    | 19 574 | 0,27 |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                            |                                     | 7 650                            | 7 947                     | Total Supranationales                                  |                                     |                                  | 37 375                    | 0,51        | 6,000 % éch. 20/06/2039                                           |                                  | 1 500                     | 1 910  | 0,03 |
| 2,125 % éch. 07/03/2028                            |                                     | 7 200                            | 8 074                     | SUEDE                                                  |                                     |                                  |                           |             | BAE Systems PLC                                                   |                                  |                           |        |      |
| 2,625 % éch. 02/12/2040                            | 22 600                              | 17 473                           | 0,24                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                          |                                     |                                  |                           |             | 5,125 % éch. 26/03/2029                                           | \$                               | 3 900                     | 3 954  | 0,05 |
| 2,875 % éch. 13/04/2042                            | 8 200                               | 6 347                            | 0,09                      | Akellus Residential Property AB                        |                                     |                                  |                           |             | Barclays PLC                                                      |                                  |                           |        |      |
| 5,250 % éch. 10/03/2030                            | 3 900                               | 4 633                            | 0,06                      | 3,950 % éch. 25/03/2031                                |                                     | 5 500                            | 6 295                     | 0,09        | 2,645 % éch. 24/06/2031                                           |                                  | 6 000                     | 5 503  | 0,07 |
| 5,250 % éch. 30/05/2032                            | 7 400                               | 8 638                            | 0,12                      |                                                        |                                     |                                  |                           |             | 4,521 % éch. 24/02/2032                                           |                                  | 5 000                     | 4 887  | 0,07 |
| 5,375 % éch. 22/03/2031                            | 2 670                               | 3 165                            | 0,04                      |                                                        |                                     |                                  |                           |             | 5,501 % éch. 09/08/2028                                           |                                  | 6 550                     | 6 609  | 0,09 |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |             | 6,052 % éch. 18/06/2036                                           | AUD                              | 700                       | 486    | 0,01 |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |             | 6,224 % éch. 09/05/2034                                           | \$                               | 5 531                     | 5 822  | 0,08 |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |             |                                                                   |                                  |                           |        |      |

# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,692 % éch. 13/09/2034                        | \$ 4 200                            | \$ 4 540                         | 0,06                      | Santander UK PLC                                                                       | € 10 000                            | \$ 11 334                        | 0,15                      | BDS LLC                                              | \$ 3 100                            | \$ 3 102                         | 0,04                      |
| 7,090 % éch. 06/11/2029                        | £ 5 000                             | 6 933                            | 0,09                      | 2,875 % éch. 12/01/2032                                                                | 7 200                               | 8 257                            | 0,11                      | 4,921 % éch. 17/10/2042                              |                                     |                                  |                           |
| Broadgate Financing PLC                        |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 12/03/2029                                                                |                                     |                                  |                           | Blackrock DLF CLO LLC                                | 1 500                               | 1 500                            | 0,02                      |
| 4,851 % éch. 05/04/2033                        | 49                                  | 66                               | 0,00                      | Segro PLC                                                                              | 1 700                               | 1 935                            | 0,03                      | 5,253 % éch. 25/07/2034                              |                                     |                                  |                           |
| Burberry Group PLC                             |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 24/09/2032                                                                |                                     |                                  |                           | BrightSpire Capital, Inc.                            | 6 400                               | 6 412                            | 0,09                      |
| 5,750 % éch. 20/06/2030                        | 16 800                              | 22 516                           | 0,30                      | Skipston Building Society                                                              | 900                                 | 1 036                            | 0,01                      | 5,089 % éch. 19/08/2043                              |                                     |                                  |                           |
| Cadent Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 18/06/2029                                                                |                                     |                                  |                           | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | 55                                  | 54                               | 0,00                      |
| 0,750 % éch. 11/03/2032                        | € 900                               | 886                              | 0,01                      | South West Water Finance PLC                                                           | £ 4 433                             | 5 951                            | 0,08                      | 3,567 % éch. 25/08/2032                              |                                     |                                  |                           |
| Chanel Ceres PLC                               |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 11/12/2032                                                                |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust                              | 6 474                               | 1 982                            | 0,03                      |
| 0,500 % éch. 31/07/2026                        | 12 500                              | 14 263                           | 0,19                      | Standard Chartered PLC                                                                 | \$ 1 000                            | 1 013                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/08/2036                              |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 31/07/2031                        | 6 599                               | 6 671                            | 0,09                      | 6,750 % éch. 08/02/2028                                                                |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                          | 541                                 | 532                              | 0,01                      |
| Coca-Cola Europacific Partners PLC             |                                     |                                  |                           | SW Finance PLC                                                                         | £ 500                               | 626                              | 0,01                      | 4,103 % éch. 25/01/2037                              |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 08/05/2032                        | 1 200                               | 1 381                            | 0,02                      | 2,375 % éch. 28/05/2028                                                                | 1 200                               | 1 605                            | 0,02                      | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust         | 3 938                               | 2 670                            | 0,04                      |
| DWR Cymru Financing UK PLC                     | £ 5 285                             | 5 233                            | 0,07                      | 6,875 % éch. 07/08/2032                                                                | 12 000                              | 15 944                           | 0,22                      | 3,953 % éch. 25/04/2037                              |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 31/03/2036                        | 36                                  | 50                               | 0,00                      | 6,875 % éch. 14/11/2034                                                                | 5 525                               | 7 002                            | 0,09                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  | 131                                 | 131                              | 0,00                      |
| 3,514 % éch. 31/03/2030                        | 4 000                               | 5 316                            | 0,07                      | 7,000 % éch. 16/04/2040                                                                | 6 300                               | 8 213                            | 0,11                      | 4,183 % éch. 25/10/2036                              |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 08/09/2037                        |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 12/12/2041 (j)                                                            | 3 735                               | 5 147                            | 0,07                      | Labrador Aviation Finance Ltd.                       | 4 311                               | 4 610                            | 0,06                      |
| Ferguson Finance PLC                           | \$ 2 600                            | 2 449                            | 0,03                      | 7,750 % éch. 31/10/2031                                                                |                                     |                                  |                           | 4,300 % éch. 15/01/2042                              |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 02/06/2030                        |                                     |                                  |                           | Telereal Secured Finance PLC                                                           | 156                                 | 198                              | 0,00                      | Long Beach Mortgage Loan Trust                       | 3 563                               | 2 415                            | 0,03                      |
| Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC               | 7 700                               | 5 313                            | 0,07                      | 4,010 % éch. 10/12/2033                                                                |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/12/2036                              | 2 995                               | 2 932                            | 0,04                      |
| 3,250 % éch. 25/02/2030                        |                                     |                                  |                           | TP ICAP Finance PLC                                                                    | 6 268                               | 7 846                            | 0,11                      | 4,813 % éch. 25/06/2035                              |                                     |                                  |                           |
| Greene King Finance PLC                        | £ 3 493                             | 4 349                            | 0,06                      | 2,625 % éch. 18/11/2028                                                                | 17 700                              | 24 127                           | 0,33                      | MASTR Asset-Backed Securities Trust                  | 1 314                               | 1 247                            | 0,02                      |
| 4,064 % éch. 15/03/2035                        | 68                                  | 89                               | 0,00                      | 6,375 % éch. 12/06/2032                                                                | 5 000                               | 7 124                            | 0,10                      | 4,483 % éch. 25/12/2034                              |                                     |                                  |                           |
| 5,106 % éch. 15/03/2034                        | 162                                 | 215                              | 0,00                      | 7,875 % éch. 17/04/2030                                                                |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               | 1 034                               | 976                              | 0,01                      |
| 5,318 % éch. 15/09/2031                        | 900                                 | 1 118                            | 0,02                      | Virgin Media Secured Finance PLC                                                       | 9 500                               | 10 876                           | 0,15                      | 4,813 % éch. 25/04/2035                              |                                     |                                  |                           |
| 5,946 % éch. 15/03/2036                        |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/08/2030                                                                | \$ 200                              | 170                              | 0,00                      | New Century Home Equity Loan Trust                   | 163                                 | 163                              | 0,00                      |
| Heathrow Finance PLC                           | 3 200                               | 3 999                            | 0,05                      | 4,500 % éch. 15/08/2030                                                                | £ 2 500                             | 3 140                            | 0,04                      | 4,693 % éch. 25/11/2034                              |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 01/09/2029                        |                                     |                                  |                           | Vmed O2 UK Financing PLC                                                               | 6 200                               | 6 791                            | 0,09                      | Option One Mortgage Loan Trust                       | 3 828                               | 2 225                            | 0,03                      |
| HSBC Holdings PLC                              | \$ 1 100                            | 1 019                            | 0,01                      | 4,000 % éch. 31/01/2029                                                                | £ 17 100                            | 17 232                           | 0,23                      | 4,043 % éch. 25/01/2037                              |                                     |                                  |                           |
| 2,848 % éch. 04/06/2031                        | 8 240                               | 8 040                            | 0,11                      | 4,500 % éch. 15/07/2031                                                                | \$ 600                              | 543                              | 0,01                      | Residential Asset Mortgage Products Trust            | 320                                 | 270                              | 0,01                      |
| 3,973 % éch. 22/05/2030                        | 11 800                              | 11 676                           | 0,16                      | 5,625 % éch. 15/04/2032                                                                |                                     |                                  |                           | 4,148 % éch. 25/12/2035                              |                                     |                                  |                           |
| 4,398 % éch. 10/03/2030                        | £ 7 000                             | 9 531                            | 0,13                      | 7,750 % éch. 15/04/2032                                                                |                                     |                                  |                           | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust       | 248                                 | 244                              | 0,00                      |
| 5,813 % éch. 22/05/2033                        |                                     |                                  |                           | Wessex Water Services Finance PLC                                                      | £ 2 900                             | 3 428                            | 0,05                      | 4,343 % éch. 25/12/2035                              | 72                                  | 66                               | 0,00                      |
| Imperial Brands Finance PLC                    | € 6 100                             | 6 917                            | 0,09                      | 1,500 % éch. 17/09/2029                                                                | 1 350                               | 1 800                            | 0,02                      | 4,438 % éch. 25/01/2035                              |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 02/08/2033                        | 3 800                               | 4 284                            | 0,06                      | 6,125 % éch. 19/09/2034                                                                |                                     |                                  |                           | SLM Private Credit Student Loan Trust                | 575                                 | 568                              | 0,01                      |
| 3,875 % éch. 12/02/2034                        |                                     |                                  |                           | Westfield Stratford City Finance PLC                                                   | 5 200                               | 6 958                            | 0,09                      | 4,166 % éch. 16/12/2041                              |                                     |                                  |                           |
| Informa PLC                                    | 17 400                              | 19 935                           | 0,27                      | 5,124 % éch. 05/05/2036                                                                | 10 900                              | 14 292                           | 0,19                      | Soundview Home Loan Trust                            | 1 704                               | 1 655                            | 0,02                      |
| 3,750 % éch. 29/04/2032                        |                                     |                                  |                           | Whitbread Group PLC                                                                    | € 7 500                             | 8 549                            | 0,12                      | 4,223 % éch. 25/06/2036                              |                                     |                                  |                           |
| InterContinental Hotels Group PLC              | £ 7 572                             | 9 708                            | 0,13                      | 5,500 % éch. 31/05/2032                                                                |                                     |                                  |                           | Structured Asset Investment Loan Trust               | 2 739                               | 2 584                            | 0,04                      |
| 3,375 % éch. 08/10/2028                        |                                     |                                  |                           | Yorkshire Building Society                                                             | £ 8 567                             | 9 035                            | 0,12                      | 4,383 % éch. 25/01/2036                              |                                     |                                  |                           |
| International Distribution Services PLC        | 4 000                               | 5 606                            | 0,08                      | 3,000 % éch. 16/04/2031                                                                | 5 800                               | 7 665                            | 0,10                      |                                                      | 40 972                              | 0,56                             |                           |
| 7,375 % éch. 14/09/2030                        |                                     |                                  |                           | Yorkshire Water Finance PLC                                                            | 4 450                               | 5 640                            | 0,08                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           |
| John Lewis PLC                                 | 2 800                               | 3 151                            | 0,04                      | 1,750 % éch. 27/10/2032                                                                | 7 400                               | 9 854                            | 0,13                      | AbbVie, Inc.                                         | 10 000                              | 10 111                           | 0,14                      |
| 4,250 % éch. 18/12/2034                        |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 28/04/2030                                                                | 5 450                               | 7 409                            | 0,10                      | 5,050 % éch. 15/03/2034                              |                                     |                                  |                           |
| Lloyds Banking Group PLC                       | \$ 16 400                           | 16 194                           | 0,22                      | 5,500 % éch. 28/04/2035                                                                | 6 300                               | 8 307                            | 0,11                      | Adventist Health System                              | 2 000                               | 2 031                            | 0,03                      |
| 4,241 % éch. 10/02/2030                        | £ 6 900                             | 9 231                            | 0,13                      | 6,000 % éch. 22/07/2033                                                                |                                     |                                  |                           | 5,430 % éch. 01/03/2032                              |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 08/06/2033                        |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 18/11/2034                                                                |                                     |                                  |                           | AEP Transmission Co. LLC                             | 135                                 | 137                              | 0,00                      |
| LSEGA Financing PLC                            | 2 000                               | 2 646                            | 0,04                      | 6,625 % éch. 22/07/2040                                                                |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 15/06/2035                              |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 19/10/2028                        |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           | AES Corp.                                            | 7 700                               | 6 872                            | 0,09                      |
| Marex Group PLC                                | \$ 1 100                            | 1 108                            | 0,02                      | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS                                                        |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/01/2031                              |                                     |                                  |                           |
| 5,829 % éch. 08/05/2028                        |                                     |                                  |                           | BCP Modular Services Holdings Ltd.                                                     | € 1 000                             | 987                              | 0,01                      | 3,950 % éch. 15/07/2030                              | 1 589                               | 1 523                            | 0,02                      |
| Mitchells & Butlers Finance PLC                | £ 281                               | 366                              | 0,01                      | 6,716 % éch. 10/07/2031                                                                |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 01/06/2028                              | 4 468                               | 4 519                            | 0,06                      |
| 4,316 % éch. 15/12/2030                        | 221                                 | 294                              | 0,00                      | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | Alaska Airlines Pass-Through Trust                   | 5 490                               | 5 490                            | 0,07                      |
| 6,013 % éch. 15/12/2030                        |                                     |                                  |                           | Canary Wharf Finance PLC                                                               | £ 29                                | 40                               | 0,00                      | 4,800 % éch. 15/02/2029                              |                                     |                                  |                           |
| Mitsubishi HC Capital UK PLC                   | € 1 400                             | 1 611                            | 0,02                      | 5,952 % éch. 22/10/2037                                                                |                                     |                                  |                           | Ally Financial, Inc.                                 | 6 000                               | 6 223                            | 0,08                      |
| 3,616 % éch. 02/08/2027                        |                                     |                                  |                           | Harvest Funding PLC                                                                    | 5 400                               | 7 168                            | 0,10                      | 6,992 % éch. 13/06/2029                              | 3 200                               | 3 565                            | 0,05                      |
| Nationwide Building Society                    | £ 14 200                            | 18 660                           | 0,25                      | 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/11/2031                              |                                     |                                  |                           |
| 5,167 % éch. 12/12/2033                        | \$ 10 300                           | 10 359                           | 0,14                      | Newgate Funding PLC                                                                    | 55                                  | 72                               | 0,00                      | American Airlines Pass-Through Trust                 | 975                                 | 880                              | 0,01                      |
| 6,557 % éch. 18/10/2027                        |                                     |                                  |                           | 4,026 % éch. 01/12/2050                                                                |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 11/01/2036                              | 1 645                               | 1 594                            | 0,02                      |
| NatWest Group PLC                              | 200                                 | 201                              | 0,00                      | RMAC PLC                                                                               | 9 712                               | 12 898                           | 0,17                      | 3,000 % éch. 15/04/2030                              | 5 588                               | 5 250                            | 0,07                      |
| 4,892 % éch. 18/05/2029                        | 800                                 | 805                              | 0,01                      | 4,947 % éch. 15/02/2047                                                                |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/08/2033                              | 7 519                               | 7 300                            | 0,10                      |
| 5,076 % éch. 27/01/2030                        |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch. 15/12/2029                              | 1 235                               | 1 181                            | 0,02                      |
| NatWest Markets PLC                            | 520                                 | 512                              | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/04/2030                              | 5 897                               | 5 680                            | 0,08                      |
| 4,412 % éch. 06/11/2030                        | 4 300                               | 4 295                            | 0,06                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           | 3,350 % éch. 15/04/2031                              | 6 256                               | 6 186                            | 0,08                      |
| 4,654 % éch. 27/03/2029                        |                                     |                                  |                           | Bon du Trésor britannique                                                              | 44 848                              | 50 032                           | 0,68                      | 3,375 % éch. 01/11/2028                              | 9 273                               | 8 540                            | 0,12                      |
| Northumbrian Water Finance PLC                 | £ 12 670                            | 16 687                           | 0,23                      | 4,375 % éch. 31/07/2054                                                                |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/08/2033                              | 1 590                               | 1 569                            | 0,02                      |
| 1,625 % éch. 11/10/2026                        | 6 900                               | 8 624                            | 0,12                      | Total Royaume-Uni                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,575 % éch. 15/07/2029                              | 737                                 | 726                              | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 02/10/2037                        | 1 200                               | 1 586                            | 0,02                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 22/03/2029                              | 3 516                               | 3 385                            | 0,05                      |
| 5,625 % éch. 29/04/2033 (j)                    | 2 700                               | 3 691                            | 0,05                      | ÉTATS-UNIS                                                                             |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/04/2031                              | 1 713                               | 1 675                            | 0,02                      |
| 6,375 % éch. 28/10/2034                        |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 15/08/2030                              | 814                                 | 800                              | 0,01                      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC | \$ 7 100                            | 5 783                            | 0,08                      | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                            | \$ 723                              | 664                              | 0,01                      | 4,100 % éch. 15/07/2029                              | 4 500                               | 4 479                            | 0,06                      |
| 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                    |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/12/2034                                                                | 1 811                               | 1 691                            | 0,02                      | 5,250 % éch. 10/05/2040                              |                                     |                                  |                           |
| Royalty Pharma PLC                             | 1 332                               | 1 310                            | 0,02                      | 4,708 % éch. 25/05/2035                                                                |                                     |                                  |                           | American Homes 4 Rent LP                             | 500                                 | 497                              | 0,01                      |
| 4,450 % éch. 25/03/2031                        |                                     |                                  |                           | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates                 | 2 997                               | 2 279                            | 0,03                      | 4,250 % éch. 15/02/2028                              |                                     |                                  |                           |
| Santander UK Group Holdings PLC                | 5 100                               | 5 097                            | 0,07                      | 4,103 % éch. 25/01/2037                                                                |                                     |                                  |                           | American Tower Corp.                                 | 4 800                               | 4 267                            | 0,06                      |
| 4,858 % éch. 11/09/2030                        | £ 6 800                             | 9 483                            | 0,13                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 15/10/2030                              |                                     |                                  |                           |
| 7,482 % éch. 29/08/2029                        |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 2,100 % éch. 15/06/2030              | \$ 1 300                            | \$ 1 176                         | 0,02                      | Blue Owl Capital Corp.               |                                     |                                  |                           | CoStar Group, Inc.                           |                                     |                                  |                           |
| 2,300 % éch. 15/09/2031              | 2 700                               | 2 383                            | 0,03                      | 6,450 % éch. 15/09/2028              | \$ 7 000                            | \$ 7 092                         | 0,10                      | 2,800 % éch. 15/07/2030                      | \$ 5 100                            | \$ 4 590                         | 0,06                      |
| 3,800 % éch. 15/08/2029              | 6 634                               | 6 470                            | 0,09                      | Blue Owl Finance LLC                 |                                     |                                  |                           | CQP Holdco LP                                |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 15/03/2030              | 1 036                               | 1 041                            | 0,01                      | 3,125 % éch. 10/06/2031              | 5 300                               | 4 662                            | 0,06                      | 5,500 % éch. 15/06/2031                      | 250                                 | 245                              | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 31/01/2030              | 300                                 | 302                              | 0,00                      | BMW U.S. Capital LLC                 |                                     |                                  |                           | Crown Castle Towers LLC                      |                                     |                                  |                           |
| 5,200 % éch. 15/02/2029              | 1 750                               | 1 773                            | 0,02                      | 4,500 % éch. 11/08/2030              | 11 600                              | 11 439                           | 0,16                      | 4,241 % éch. 15/07/2048                      | 5 800                               | 5 744                            | 0,08                      |
| 5,650 % éch. 08/02/2029              | 2 200                               | 2 273                            | 0,03                      | Boeing Co.                           |                                     |                                  |                           | Crown Castle, Inc.                           |                                     |                                  |                           |
| 5,800 % éch. 15/11/2028              | 3 300                               | 3 382                            | 0,05                      | 5,150 % éch. 01/05/2030              | 6 098                               | 6 173                            | 0,08                      | 3,100 % éch. 15/11/2029                      | 8 805                               | 8 350                            | 0,11                      |
| Amgen, Inc.                          |                                     |                                  |                           | British Airways Pass-Through Trust   |                                     |                                  |                           | CVS Health Corp.                             |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 02/03/2030              | 7 571                               | 7 715                            | 0,10                      | 3,300 % éch. 15/06/2034              | 9 482                               | 8 924                            | 0,12                      | 5,700 % éch. 01/06/2034                      | 4 300                               | 4 440                            | 0,06                      |
| Antares Holdings LP                  |                                     |                                  |                           | 3,350 % éch. 15/12/2030              | 395                                 | 383                              | 0,01                      | CVS Pass-Through Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 15/01/2027              | 5 800                               | 5 717                            | 0,08                      | 3,800 % éch. 20/03/2033              | 43                                  | 42                               | 0,00                      | 4,704 % éch. 10/01/2036                      | 169                                 | 158                              | 0,00                      |
| 3,950 % éch. 15/07/2026              | 3 500                               | 3 498                            | 0,05                      | 4,125 % éch. 20/03/2033              | 44                                  | 42                               | 0,00                      | 5,926 % éch. 10/01/2034                      | 1 496                               | 1 521                            | 0,02                      |
| 6,500 % éch. 08/02/2029              | 15 600                              | 15 633                           | 0,21                      | Broadcom, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 6,036 % éch. 10/12/2028                      | 528                                 | 530                              | 0,01                      |
| 7,950 % éch. 11/08/2028              | 2 000                               | 2 068                            | 0,03                      | 2,450 % éch. 15/02/2031              | 9 400                               | 8 507                            | 0,12                      | 7,507 % éch. 10/01/2032                      | 767                                 | 802                              | 0,01                      |
| Apollo Debt Solutions BDC            |                                     |                                  |                           | 4,150 % éch. 15/11/2030              | 895                                 | 876                              | 0,01                      | 8,353 % éch. 10/07/2031                      | 161                                 | 173                              | 0,00                      |
| 6,550 % éch. 15/03/2032              | 60                                  | 61                               | 0,00                      | Broadstone Net Lease LLC             |                                     |                                  |                           | DAE Funding LLC                              |                                     |                                  |                           |
| 6,700 % éch. 29/07/2031              | 6 000                               | 6 119                            | 0,08                      | 5,000 % éch. 01/11/2032              | 2 000                               | 1 972                            | 0,03                      | 3,375 % éch. 20/03/2028                      | 24 600                              | 23 825                           | 0,32                      |
| 6,900 % éch. 13/04/2029              | 1 972                               | 2 024                            | 0,03                      | Brookfield Capital Finance LLC       |                                     |                                  |                           | Daimler Truck Finance North America LLC      |                                     |                                  |                           |
| Appalachian Power Co.                |                                     |                                  |                           | 6,087 % éch. 14/06/2033              | 3 000                               | 3 151                            | 0,04                      | 5,250 % éch. 13/01/2030                      | 1 300                               | 1 317                            | 0,02                      |
| 2,700 % éch. 01/04/2031              | 2 500                               | 2 279                            | 0,03                      | Cameron LNG LLC                      |                                     |                                  |                           | Delta Air Lines, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| AppLovin Corp.                       |                                     |                                  |                           | 2,902 % éch. 15/07/2031              | 1 900                               | 1 734                            | 0,02                      | 3,750 % éch. 28/10/2029                      | 9 500                               | 9 175                            | 0,12                      |
| 5,125 % éch. 01/12/2029              | 1 600                               | 1 614                            | 0,02                      | Cantor Fitzgerald LP                 |                                     |                                  |                           | Digital Euro Finco LLC                       |                                     |                                  |                           |
| Ares Capital Corp.                   |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 12/12/2028              | 13 900                              | 14 434                           | 0,20                      | 3,750 % éch. 15/01/2033                      | € 4 000                             | 4 532                            | 0,06                      |
| 2,875 % éch. 15/06/2027              | 1 100                               | 1 079                            | 0,01                      | CBRE Services, Inc.                  |                                     |                                  |                           | Discovery Global Holdings, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| Ares Finance Co. LLC                 |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 15/06/2030              | 200                                 | 200                              | 0,00                      | 4,279 % éch. 15/03/2032                      | \$ 716                              | 643                              | 0,01                      |
| 3,250 % éch. 15/06/2030              | 2 944                               | 2 760                            | 0,04                      | CDW LLC                              |                                     |                                  |                           | 5,141 % éch. 15/03/2052                      | 544                                 | 366                              | 0,01                      |
| Ares Management Corp.                |                                     |                                  |                           | 3,569 % éch. 01/12/2031              | 3 600                               | 3 307                            | 0,05                      | Doctors Co. An Interinsurance Exchange       |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 10/11/2028              | 11 000                              | 11 384                           | 0,15                      | 5,550 % éch. 22/08/2034              | 1 600                               | 1 580                            | 0,02                      | 4,500 % éch. 18/01/2032                      | 900                                 | 837                              | 0,01                      |
| Ares Strategic Income Fund           |                                     |                                  |                           | Centene Corp.                        |                                     |                                  |                           | DT Midstream, Inc.                           |                                     |                                  |                           |
| 5,150 % éch. 15/01/2031              | 5 000                               | 4 777                            | 0,07                      | 2,450 % éch. 15/07/2028              | 9 184                               | 8 732                            | 0,12                      | 5,800 % éch. 15/12/2034                      | 2 350                               | 2 403                            | 0,03                      |
| 5,600 % éch. 15/02/2030              | 600                                 | 590                              | 0,01                      | 3,000 % éch. 15/10/2030              | 21 000                              | 19 018                           | 0,26                      | Duke Energy Carolinas LLC                    |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 21/03/2032              | 700                                 | 693                              | 0,01                      | Charter Communications Operating LLC |                                     |                                  |                           | 2,850 % éch. 15/03/2032                      | 900                                 | 816                              | 0,01                      |
| Ashtead Capital, Inc.                |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 01/02/2032              | 500                                 | 425                              | 0,01                      | Duke Energy Corp.                            |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 12/08/2026              | 6 200                               | 6 177                            | 0,08                      | 3,500 % éch. 01/06/2041              | 9 200                               | 6 445                            | 0,09                      | 3,750 % éch. 01/04/2031                      | € 5 700                             | 6 600                            | 0,09                      |
| Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 01/04/2051              | 6 800                               | 4 223                            | 0,06                      | Edison International                         |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/09/2028              | 3 900                               | 4 013                            | 0,05                      | 3,900 % éch. 01/06/2052              | 1 700                               | 1 085                            | 0,02                      | 4,125 % éch. 15/03/2028                      | \$ 2 300                            | 2 268                            | 0,03                      |
| AT&T, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 01/12/2061              | 750                                 | 485                              | 0,01                      | 5,450 % éch. 15/06/2029                      | 4 200                               | 4 243                            | 0,06                      |
| 4,400 % éch. 30/04/2031              | 13 100                              | 12 883                           | 0,17                      | 5,125 % éch. 01/07/2049              | 9 300                               | 7 183                            | 0,10                      | 6,250 % éch. 15/03/2030                      | 1 500                               | 1 542                            | 0,02                      |
| 4,750 % éch. 30/04/2033              | 4 200                               | 4 111                            | 0,06                      | 5,850 % éch. 01/12/2035 (j)          | 4 700                               | 4 552                            | 0,06                      | EMD Finance LLC                              |                                     |                                  |                           |
| Athene Global Funding                |                                     |                                  |                           | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/10/2030                      | 2 500                               | 2 468                            | 0,03                      |
| 5,516 % éch. 25/03/2027              | 15 800                              | 15 892                           | 0,22                      | 3,700 % éch. 15/11/2029              | 2 989                               | 2 891                            | 0,04                      | Energy Transfer LP                           |                                     |                                  |                           |
| 5,526 % éch. 11/07/2031              | 3 000                               | 3 029                            | 0,04                      | 5,125 % éch. 30/06/2027              | 10 632                              | 10 660                           | 0,14                      | 3,750 % éch. 15/05/2030                      | 5 500                               | 5 298                            | 0,07                      |
| 5,583 % éch. 09/01/2029              | 6 750                               | 6 849                            | 0,09                      | Cheniere Energy Partners LP          |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 01/02/2043                      | 2 294                               | 2 074                            | 0,03                      |
| Aviation Capital Group LLC           |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 31/01/2032 (j)          | 8 600                               | 7 884                            | 0,11                      | 5,250 % éch. 01/07/2029                      | 100                                 | 101                              | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 01/11/2027              | 8 030                               | 7 901                            | 0,11                      | 4,000 % éch. 01/03/2031              | 8 400                               | 8 084                            | 0,11                      | 6,100 % éch. 01/12/2028                      | 100                                 | 103                              | 0,00                      |
| 5,375 % éch. 15/07/2029              | 5 450                               | 5 516                            | 0,08                      | Chick-fil-A, Inc.                    |                                     |                                  |                           | Enterprise Products Operating LLC            |                                     |                                  |                           |
| Bank of America Corp.                |                                     |                                  |                           | 4,580 % éch. 21/07/2028 (b)(i)       | 1 500                               | 1 492                            | 0,02                      | 5,200 % éch. 15/01/2036                      | 5 600                               | 5 620                            | 0,08                      |
| 2,551 % éch. 04/02/2028              | 20 100                              | 19 875                           | 0,27                      | 4,600 % éch. 21/07/2029 (b)(i)       | 700                                 | 694                              | 0,01                      | 6,897 % éch. 15/08/2077                      | 4 838                               | 4 839                            | 0,07                      |
| 2,592 % éch. 29/04/2031              | 8 100                               | 7 476                            | 0,10                      | Citadel Finance LLC                  |                                     |                                  |                           | EPR Properties                               |                                     |                                  |                           |
| 2,651 % éch. 11/03/2032              | 5 600                               | 5 080                            | 0,07                      | 5,900 % éch. 10/02/2030              | 13 600                              | 13 719                           | 0,19                      | 3,600 % éch. 15/11/2031                      | 1 800                               | 1 651                            | 0,02                      |
| 3,824 % éch. 20/01/2028              | 5 100                               | 5 082                            | 0,07                      | Citibank N.A.                        |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/06/2027                      | 6 264                               | 6 253                            | 0,08                      |
| 4,271 % éch. 23/07/2029              | 2 300                               | 2 282                            | 0,03                      | 4,554 % éch. 18/06/2029              | 7 400                               | 7 393                            | 0,10                      | 4,750 % éch. 15/11/2030                      | 2 700                               | 2 643                            | 0,04                      |
| 5,288 % éch. 25/04/2034              | 12 700                              | 12 873                           | 0,17                      | Citigroup, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 15/04/2028                      | 1 986                               | 1 987                            | 0,03                      |
| 5,819 % éch. 15/09/2029              | 7 200                               | 7 369                            | 0,10                      | 2,572 % éch. 03/06/2031              | 14 539                              | 13 362                           | 0,18                      | EQT Corp.                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,872 % éch. 15/09/2034              | 1 050                               | 1 098                            | 0,02                      | 3,785 % éch. 17/03/2033              | 1 000                               | 940                              | 0,01                      | 4,750 % éch. 15/01/2031                      | 5 300                               | 5 252                            | 0,07                      |
| Bank of America N.A.                 |                                     |                                  |                           | 6,270 % éch. 17/11/2033              | 600                                 | 640                              | 0,01                      | 6,375 % éch. 01/04/2029                      | 2 200                               | 2 253                            | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 15/10/2036              | 7 150                               | 7 560                            | 0,10                      | Clorox Co.                           |                                     |                                  |                           | Equinix Europe Financing Corp. LLC           |                                     |                                  |                           |
| BAT Capital Corp.                    |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/05/2031              | 6 800                               | 6 759                            | 0,09                      | 3,250 % éch. 15/03/2031                      | € 7 800                             | 8 815                            | 0,12                      |
| 5,625 % éch. 15/08/2035              | 700                                 | 722                              | 0,01                      | CommonSpirit Health                  |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 03/09/2033                      | 9 400                               | 10 685                           | 0,14                      |
| Bayer U.S. Finance LLC               |                                     |                                  |                           | 4,352 % éch. 01/09/2030              | 2 500                               | 2 446                            | 0,03                      | 4,000 % éch. 19/05/2034                      | 2 900                               | 3 337                            | 0,05                      |
| 4,375 % éch. 15/12/2028              | 26 422                              | 26 144                           | 0,35                      | 4,975 % éch. 01/09/2035              | 900                                 | 874                              | 0,01                      | Eversource Energy                            |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 21/11/2030              | 12 200                              | 12 844                           | 0,17                      | Conagra Brands, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 01/03/2032                      | \$ 300                              | 276                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 21/11/2033              | 5 200                               | 5 584                            | 0,08                      | 4,850 % éch. 01/11/2028              | 2 700                               | 2 705                            | 0,04                      | 4,450 % éch. 15/12/2030                      | 2 000                               | 1 966                            | 0,03                      |
| Beignet Investor LLC                 |                                     |                                  |                           | Constellation Global Funding         |                                     |                                  |                           | Expand Energy Corp.                          |                                     |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049 (j)          | 68 618                              | 70 035                           | 0,95                      | 4,850 % éch. 22/10/2030              | 1 000                               | 980                              | 0,01                      | 5,700 % éch. 15/01/2035                      | 4 000                               | 4 046                            | 0,06                      |
| Berry Global, Inc.                   |                                     |                                  |                           | Constellation Pharmaceuticals, Inc.  |                                     |                                  |                           | F&G Global Funding                           |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 15/01/2027              | € 5 300                             | 6 018                            | 0,08                      | 5,550 % éch. 01/07/2033 (j)          | 3 175                               | 3 225                            | 0,04                      | 2,000 % éch. 20/09/2028                      | 1 100                               | 1 025                            | 0,01                      |
| BGC Group, Inc.                      |                                     |                                  |                           | Consumers Securitization Funding LLC |                                     |                                  |                           | 4,963 % éch. 08/09/2028                      | 7 500                               | 7 533                            | 0,10                      |
| 6,150 % éch. 02/04/2030              | \$ 3 200                            | 3 267                            | 0,04                      | 5,550 % éch. 01/03/2028              | 254                                 | 255                              | 0,00                      | 5,875 % éch. 10/06/2027                      | 3 900                               | 3 939                            | 0,05                      |
| 6,000 % éch. 10/06/2029              | 3 700                               | 3 816                            | 0,05                      | COPT Defense Properties LP           |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 16/01/2030                      | 2 200                               | 2 227                            | 0,03                      |
| 6,600 % éch. 25/05/2028              | 5 500                               | 5 748                            | 0,08                      | 4,500 % éch. 15/10/2030              | 200                                 | 197                              | 0,00                      | Fells Point Funding Trust                    |                                     |                                  |                           |
| Black Hills Corp.                    |                                     |                                  |                           | Corebridge Global Funding            |                                     |                                  |                           | 3,046 % éch. 31/01/2027                      | 6 150                               | 6 094                            | 0,08                      |
| 4,550 % éch. 31/01/2031              | 7 207                               | 7 101                            | 0,10                      | 4,900 % éch. 07/01/2028              | 4 768                               | 4 791                            | 0,07                      | Fidelity National Information Services, Inc. |                                     |                                  |                           |
| Blackstone Secured Lending Fund      |                                     |                                  |                           | CoreWeave, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 4,450 % éch. 10/03/2028                      | 5 700                               | 5 682                            | 0,08                      |
| 5,875 % éch. 15/11/2027              | 8 100                               | 8 160                            | 0,11                      | 8,500 % éch. 15/07/2032              | € 3 300                             | 3 721                            | 0,05                      | 4,550 % éch. 10/03/2029                      | 8 500                               | 8 436                            | 0,11                      |
| Block, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 15/07/2032              | \$ 2 900                            | 2 860                            | 0,04                      |                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 15/08/2030              | 4 000                               | 4 012                            | 0,05                      |                                      |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 15/05/2032              | 4 271                               | 4 362                            | 0,06                      |                                      |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| FirstEnergy Pennsylvania Electric Co.       |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/04/2035                   | \$ 4 500                            | \$ 4 518                         | 0,06                      | Marsh & McLennan Cos., Inc.              |                                     |                                  |                           |
| 3,600 % éch. 01/06/2029                     | \$ 4 270                            | \$ 4 140                         | 0,06                      | 5,700 % éch. 01/07/2034                   | 2 501                               | 2 559                            | 0,03                      | 5,000 % éch. 15/03/2035                  | \$ 14 900                           | \$ 14 759                        | 0,20                      |
| Flex Intermediate Holdco LLC                |                                     |                                  |                           | Howard Midstream Energy Partners LLC      |                                     |                                  |                           | MassMutual Global Funding                |                                     |                                  |                           |
| 3,363 % éch. 30/06/2031                     | 31 761                              | 29 351                           | 0,40                      | 6,625 % éch. 15/01/2034                   | 300                                 | 303                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 22/01/2029                  | 11 800                              | 11 630                           | 0,16                      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                   |                                     |                                  |                           | HPS Corporate Lending Fund                |                                     |                                  |                           | McDonald's Corp.                         |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 16/02/2028                     | 200                                 | 193                              | 0,00                      | 5,950 % éch. 14/04/2032                   | 3 000                               | 2 940                            | 0,04                      | 3,500 % éch. 15/05/2033                  | € 2 100                             | 2 393                            | 0,03                      |
| 2,900 % éch. 10/02/2029                     | 10 400                              | 9 790                            | 0,13                      | Hudson Pacific Properties LP              |                                     |                                  |                           | Mercury General Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 3,815 % éch. 02/11/2027                     | 3 471                               | 3 421                            | 0,05                      | 3,250 % éch. 15/01/2030 (j)               | 2 325                               | 2 036                            | 0,03                      | 4,400 % éch. 15/03/2027                  | \$ 1 603                            | 1 603                            | 0,02                      |
| 4,125 % éch. 17/08/2027                     | 2 400                               | 2 379                            | 0,03                      | Hyatt Hotels Corp.                        |                                     |                                  |                           | Meta Platforms, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| 4,271 % éch. 09/01/2027                     | 7 600                               | 7 579                            | 0,10                      | 5,250 % éch. 30/06/2029                   | 1 607                               | 1 632                            | 0,02                      | 4,600 % éch. 15/11/2032                  | 200                                 | 197                              | 0,00                      |
| 4,950 % éch. 28/05/2027                     | 500                                 | 500                              | 0,01                      | Hyundai Capital America                   |                                     |                                  |                           | Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC |                                     |                                  |                           |
| 4,970 % éch. 06/04/2029                     | 3 800                               | 3 762                            | 0,05                      | 4,600 % éch. 06/04/2028                   | 14 900                              | 14 879                           | 0,20                      | 4,100 % éch. 15/05/2028                  | 7 140                               | 7 078                            | 0,10                      |
| 5,125 % éch. 05/11/2026                     | 1 500                               | 1 502                            | 0,02                      | 4,850 % éch. 25/03/2027                   | 3 000                               | 3 009                            | 0,04                      | Morgan Stanley                           |                                     |                                  |                           |
| 5,800 % éch. 08/03/2029                     | 4 800                               | 4 843                            | 0,07                      | IHG Finance LLC                           |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 02/04/2032 (i)              | 46 900                              | 34 996                           | 0,47                      |
| 5,850 % éch. 17/05/2027                     | 2 600                               | 2 620                            | 0,04                      | 3,625 % éch. 27/09/2031                   | € 400                               | 458                              | 0,01                      | 2,775 % éch. 05/10/2029                  | € 2 600                             | 2 982                            | 0,04                      |
| 6,798 % éch. 07/11/2028                     | 3 132                               | 3 234                            | 0,04                      | Integrus Baptist Medical Center, Inc.     |                                     |                                  |                           | 3,485 % éch. 11/06/2030                  | 5 400                               | 6 208                            | 0,08                      |
| 7,350 % éch. 04/11/2027                     | 3 700                               | 3 803                            | 0,05                      | 3,875 % éch. 15/08/2050                   | \$ 8 200                            | 6 108                            | 0,08                      | 3,521 % éch. 22/05/2031                  | 8 500                               | 9 762                            | 0,13                      |
| Fox Corp.                                   |                                     |                                  |                           | Invitation Homes Operating Partnership LP |                                     |                                  |                           | 3,790 % éch. 21/03/2030                  | 5 600                               | 6 495                            | 0,09                      |
| 4,709 % éch. 25/01/2029                     | 4 200                               | 4 198                            | 0,06                      | 2,700 % éch. 15/01/2034                   | 3 615                               | 3 037                            | 0,04                      | 4,708 % éch. 12/03/2032                  | \$ 5 200                            | 5 137                            | 0,07                      |
| FS KKR Capital Corp.                        |                                     |                                  |                           | 4,150 % éch. 15/04/2032                   | 1 500                               | 1 428                            | 0,02                      | 4,994 % éch. 12/04/2029                  | 500                                 | 503                              | 0,01                      |
| 2,625 % éch. 15/01/2027                     | 2 211                               | 2 171                            | 0,03                      | 4,950 % éch. 15/01/2033                   | 2 700                               | 2 663                            | 0,04                      | 5,123 % éch. 01/02/2029                  | 1 100                               | 1 107                            | 0,02                      |
| 6,125 % éch. 15/01/2030                     | 6 400                               | 6 239                            | 0,08                      | 5,500 % éch. 15/08/2033                   | 1 500                               | 1 531                            | 0,02                      | 5,173 % éch. 16/01/2030                  | 1 200                               | 1 211                            | 0,02                      |
| 7,875 % éch. 15/01/2029                     | 2 500                               | 2 568                            | 0,04                      | IPALCO Enterprises, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 21/04/2034                  | 2 315                               | 2 330                            | 0,03                      |
| GA Global Funding Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 01/05/2030                   | 300                                 | 291                              | 0,00                      | 5,424 % éch. 21/07/2034                  | 8 800                               | 8 940                            | 0,12                      |
| 4,500 % éch. 18/09/2030                     | 6 200                               | 6 011                            | 0,08                      | Jersey Central Power & Light Co.          |                                     |                                  |                           | 6,407 % éch. 01/11/2029                  | 12 200                              | 12 631                           | 0,17                      |
| 4,858 % éch. 22/07/2033                     | CAD 11 400                          | 8 137                            | 0,11                      | 2,750 % éch. 01/03/2032                   | 200                                 | 179                              | 0,00                      | Morgan Stanley Finance LLC               |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 08/01/2029                     | \$ 3 300                            | 3 335                            | 0,05                      | JetBlue Pass-Through Trust                |                                     |                                  |                           | 6,550 % éch. 05/01/2031                  | £ 1 300                             | 1 716                            | 0,02                      |
| 5,900 % éch. 13/01/2035                     | 2 000                               | 2 018                            | 0,03                      | 4,000 % éch. 15/05/2034                   | 704                                 | 669                              | 0,01                      | Morgan Stanley Private Bank N.A.         |                                     |                                  |                           |
| Gartner, Inc.                               |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                      |                                     |                                  |                           | 4,213 % éch. 08/02/2030                  | \$ 6 900                            | 6 811                            | 0,09                      |
| 3,625 % éch. 15/06/2029                     | 6 100                               | 5 770                            | 0,08                      | 2,069 % éch. 01/06/2029                   | 4 100                               | 3 909                            | 0,05                      | 4,734 % éch. 18/07/2031                  | 4 250                               | 4 232                            | 0,06                      |
| 3,750 % éch. 01/10/2030                     | 1 034                               | 945                              | 0,01                      | 2,545 % éch. 08/11/2032                   | 10 000                              | 8 896                            | 0,12                      | Motorola Solutions, Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 20/03/2031                     | 3 200                               | 3 112                            | 0,04                      | 2,580 % éch. 22/04/2032                   | 16 700                              | 15 054                           | 0,20                      | 2,300 % éch. 15/11/2030                  | 200                                 | 180                              | 0,00                      |
| Glencore Funding LLC                        |                                     |                                  |                           | 2,739 % éch. 15/10/2030                   | 32 300                              | 30 342                           | 0,41                      | MSCI, Inc.                               |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 27/03/2027                     | 200                                 | 199                              | 0,00                      | 3,136 % éch. 18/02/2032                   | € 7 400                             | 8 370                            | 0,11                      | 3,625 % éch. 01/09/2030                  | 2 700                               | 2 555                            | 0,03                      |
| Global Atlantic Fin Co.                     |                                     |                                  |                           | 3,540 % éch. 01/05/2028                   | \$ 3 100                            | 3 075                            | 0,04                      | 3,625 % éch. 01/11/2031                  | 9 900                               | 9 188                            | 0,12                      |
| 7,950 % éch. 15/10/2054                     | 10 500                              | 10 581                           | 0,14                      | 3,702 % éch. 06/05/2030                   | 4 600                               | 4 474                            | 0,06                      | 3,875 % éch. 15/02/2031                  | 100                                 | 95                               | 0,00                      |
| Global Payments, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 3,782 % éch. 01/02/2028                   | 3 569                               | 3 555                            | 0,05                      | Mutual of Omaha Cos. Global Funding      |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/11/2028                     | 11 500                              | 11 365                           | 0,15                      | 4,005 % éch. 23/04/2029                   | 6 100                               | 6 035                            | 0,08                      | 4,514 % éch. 09/06/2028                  | 3 700                               | 3 682                            | 0,05                      |
| 4,875 % éch. 17/03/2031                     | € 3 800                             | 4 496                            | 0,06                      | 4,457 % éch. 13/11/2031                   | € 6 000                             | 7 170                            | 0,10                      | 4,750 % éch. 15/10/2029                  | 8 900                               | 8 893                            | 0,12                      |
| GLP Capital LP                              |                                     |                                  |                           | 4,565 % éch. 14/06/2030                   | \$ 8 536                            | 8 505                            | 0,12                      | National Football League                 |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 15/01/2030                     | \$ 1 500                            | 1 443                            | 0,02                      | 4,603 % éch. 22/10/2030                   | 11 300                              | 11 252                           | 0,15                      | 5,250 % éch. 05/10/2034 (i)              | 12 900                              | 12 814                           | 0,17                      |
| 4,000 % éch. 15/01/2031                     | 5 250                               | 4 961                            | 0,07                      | 4,851 % éch. 25/07/2028                   | 1 666                               | 1 671                            | 0,02                      | 5,420 % éch. 05/10/2037 (i)              | 4 600                               | 4 583                            | 0,06                      |
| 5,300 % éch. 15/01/2029                     | 15 224                              | 15 305                           | 0,21                      | 5,350 % éch. 01/06/2034                   | 14 700                              | 14 951                           | 0,20                      | National Grid North America, Inc.        |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 01/06/2028                     | 14 594                              | 14 765                           | 0,20                      | 6,070 % éch. 22/10/2027                   | 7 250                               | 7 286                            | 0,10                      | 3,631 % éch. 03/09/2031                  | € 7 000                             | 8 085                            | 0,11                      |
| 5,750 % éch. 01/11/2037                     | 2 200                               | 2 169                            | 0,03                      | 6,087 % éch. 23/10/2029                   | 10 000                              | 10 306                           | 0,14                      | Nationwide Financial Services, Inc.      |                                     |                                  |                           |
| Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           | Kilroy Realty LP                          |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 30/11/2049                  | \$ 3 385                            | 2 536                            | 0,03                      |
| 2,743 % éch. 17/02/2029                     | € 2 000                             | 2 273                            | 0,03                      | 2,650 % éch. 15/11/2033                   | 364                                 | 296                              | 0,00                      | NetApp, Inc.                             |                                     |                                  |                           |
| 3,509 % éch. 17/08/2033                     | 1 800                               | 2 045                            | 0,03                      | 4,250 % éch. 15/08/2029                   | 200                                 | 194                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 17/03/2032                  | 100                                 | 102                              | 0,00                      |
| 3,641 % éch. 05/03/2032 (i)                 | CAD 4 500                           | 3 149                            | 0,04                      | Kinder Morgan, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Neuberger Berman Group LLC               |                                     |                                  |                           |
| 3,984 % éch. 18/12/2036                     | € 6 200                             | 7 105                            | 0,10                      | 2,250 % éch. 16/03/2027                   | € 4 140                             | 4 714                            | 0,06                      | 4,500 % éch. 15/03/2027                  | 11 277                              | 11 261                           | 0,15                      |
| 4,223 % éch. 01/05/2029                     | \$ 19 400                           | 19 236                           | 0,26                      | 7,420 % éch. 15/02/2037                   | \$ 3 388                            | 3 837                            | 0,05                      | Newmark Group, Inc.                      |                                     |                                  |                           |
| 4,340 % éch. 05/03/2037 (i)                 | CAD 1 800                           | 1 259                            | 0,02                      | 8,050 % éch. 15/10/2030                   | 36                                  | 40                               | 0,00                      | 7,500 % éch. 12/01/2029                  | 2 500                               | 2 620                            | 0,04                      |
| 4,482 % éch. 23/08/2028                     | \$ 13 300                           | 13 290                           | 0,18                      | KKR Financial Holdings LLC                |                                     |                                  |                           | News Corp.                               |                                     |                                  |                           |
| 5,016 % éch. 23/10/2035                     | 2 000                               | 1 965                            | 0,03                      | 5,400 % éch. 23/05/2033                   | 10 400                              | 9 646                            | 0,13                      | 3,875 % éch. 15/05/2029                  | 700                                 | 679                              | 0,01                      |
| 6,484 % éch. 24/10/2029                     | 28 000                              | 29 049                           | 0,39                      | L3Harris Technologies, Inc.               |                                     |                                  |                           | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.    |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 10/04/2028                     | £ 1 317                             | 1 824                            | 0,03                      | 1,800 % éch. 15/01/2031                   | 1 000                               | 881                              | 0,01                      | 3,624 % éch. 10/02/2034                  | € 1 100                             | 1 255                            | 0,02                      |
| Goldman Sachs Private Credit Corp.          |                                     |                                  |                           | Ladder Capital Finance Holdings LLLP      |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Acceptance Co. LLC          |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 23/02/2028                     | \$ 7 300                            | 7 263                            | 0,10                      | 5,500 % éch. 01/08/2030                   | 800                                 | 808                              | 0,01                      | 1,850 % éch. 16/09/2026                  | \$ 10 700                           | 10 607                           | 0,14                      |
| Goodman U.S. Finance Six LLC                |                                     |                                  |                           | Las Vegas Sands Corp.                     |                                     |                                  |                           | NRG Energy, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 07/10/2034                     | 200                                 | 197                              | 0,00                      | 3,900 % éch. 08/08/2029                   | 6 950                               | 6 714                            | 0,09                      | 4,734 % éch. 15/10/2030                  | 2 146                               | 2 121                            | 0,03                      |
| HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           | 5,900 % éch. 01/06/2027                   | 43 100                              | 43 508                           | 0,59                      | 4,955 % éch. 30/04/2031                  | 5 100                               | 5 045                            | 0,07                      |
| 6,375 % éch. 01/07/2034                     | 6 400                               | 6 530                            | 0,09                      | 6,000 % éch. 15/08/2029                   | 2 000                               | 2 055                            | 0,03                      | 5,407 % éch. 15/10/2035                  | 200                                 | 197                              | 0,00                      |
| Haleon U.S. Capital LLC                     |                                     |                                  |                           | 6,200 % éch. 15/08/2034                   | 4 200                               | 4 325                            | 0,06                      | NVR, Inc.                                |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 24/03/2032                     | 500                                 | 468                              | 0,01                      | Lazard Group LLC                          |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/05/2030                  | 3 622                               | 3 397                            | 0,05                      |
| Hardwood Funding LLC                        |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 11/03/2029                   | 4 868                               | 4 813                            | 0,07                      | Occidental Petroleum Corp.               |                                     |                                  |                           |
| 4,840 % éch. 07/06/2028 (i)                 | 2 700                               | 2 694                            | 0,04                      | 6,000 % éch. 15/03/2031                   | 1 600                               | 1 660                            | 0,02                      | 8,875 % éch. 15/07/2030                  | 2 150                               | 2 422                            | 0,03                      |
| 4,980 % éch. 07/06/2030 (i)                 | 2 100                               | 2 091                            | 0,03                      | Lehman Brothers Holdings, Inc.            |                                     |                                  |                           | Omega Healthcare Investors, Inc.         |                                     |                                  |                           |
| 5,160 % éch. 07/06/2032 (i)                 | 2 700                               | 2 698                            | 0,04                      | 0,000 % éch. 12/06/2013 ^                 | € 2 807                             | 11                               | 0,00                      | 5,200 % éch. 01/07/2030                  | 1 400                               | 1 407                            | 0,02                      |
| HCA, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 31/12/2013 ^                 | \$ 900                              | 0                                | 0,00                      | Oncor Electric Delivery Co. LLC          |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/09/2030                     | 775                                 | 735                              | 0,01                      | 1,000 % éch. 02/05/2049 ^                 | 3 000                               | 1                                | 0,00                      | 3,625 % éch. 15/06/2034                  | € 6 400                             | 7 314                            | 0,10                      |
| 5,450 % éch. 15/09/2034                     | 5 000                               | 5 056                            | 0,07                      | Live Nation Entertainment, Inc.           |                                     |                                  |                           | OneMain Finance Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 01/06/2033                     | 22 127                              | 22 615                           | 0,31                      | 3,750 % éch. 15/01/2028                   | 3 700                               | 3 631                            | 0,05                      | 7,875 % éch. 15/03/2030                  | \$ 4 900                            | 5 104                            | 0,07                      |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.         |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/05/2027                   | 5 700                               | 5 703                            | 0,08                      | ONEOK, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/09/2033                     | 2 000                               | 2 008                            | 0,03                      | Marriott International, Inc.              |                                     |                                  |                           | 5,700 % éch. 01/11/2054                  | 13 864                              | 12 882                           | 0,17                      |
| Horizon Mutual Holdings, Inc.               |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/10/2032                   | 3 281                               | 3 021                            | 0,04                      | Oracle Corp.                             |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 15/11/2034                     | 6 300                               | 6 125                            | 0,08                      | 5,250 % éch. 15/10/2035                   | 4 100                               | 4 101                            | 0,06                      | 5,200 % éch. 26/09/2035 (j)              | 2 000                               | 1 873                            | 0,03                      |
| Host Hotels & Resorts LP                    |                                     |                                  |                           | Mars, Inc.                                |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 03/08/2035                  | 3 700                               | 3 542                            | 0,05                      |
| 3,375 % éch. 15/12/2029                     | 2 851                               | 2 721                            | 0,04                      | 4,800 % éch. 01/03/2030                   | 500                                 | 502                              | 0,01                      |                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 15/09/2030                     | 2 600                               | 2 460                            | 0,03                      |                                           |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,150 % éch. 09/11/2029           | \$ 7 500                            | \$ 7 694                         | 0,10                      | Southern California Edison Co.           | \$ 1 110                            | \$ 1 008                         | 0,01                      | 4,125 % éch. 15/08/2030                            | \$ 475                              | \$ 456                           | 0,01                      |
| 6,250 % éch. 09/11/2032 (j)       | 11 920                              | 12 256                           | 0,17                      | 2,250 % éch. 01/06/2030                  | 5 831                               | 5 208                            | 0,07                      | 4,500 % éch. 15/01/2028                            | 6 483                               | 6 441                            | 0,09                      |
| Pacific Gas & Electric Co.        |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/06/2031                  | 1 900                               | 1 691                            | 0,02                      | 4,625 % éch. 01/12/2029                            | 2 825                               | 2 774                            | 0,04                      |
| 2,500 % éch. 01/02/2031           | 1 100                               | 987                              | 0,01                      | 2,750 % éch. 01/02/2032                  | 6 400                               | 3 866                            | 0,05                      | 5,125 % éch. 15/11/2031                            | 1 900                               | 1 892                            | 0,03                      |
| 3,000 % éch. 15/06/2028           | 8 330                               | 8 064                            | 0,11                      | 2,950 % éch. 01/02/2051                  | 6 100                               | 4 032                            | 0,05                      | 5,125 % éch. 15/05/2032                            | 4 000                               | 3 968                            | 0,05                      |
| 3,300 % éch. 15/03/2027           | 11 935                              | 11 831                           | 0,16                      | 3,450 % éch. 01/02/2052                  | 100                                 | 69                               | 0,00                      | 5,625 % éch. 01/04/2035                            | 2 000                               | 2 002                            | 0,03                      |
| 3,300 % éch. 01/12/2027           | 13 369                              | 13 122                           | 0,18                      | 3,650 % éch. 01/02/2050                  | 3 598                               | 2 477                            | 0,03                      | 5,750 % éch. 01/02/2027                            | 3 100                               | 3 108                            | 0,04                      |
| 3,500 % éch. 01/08/2050           | 200                                 | 134                              | 0,00                      | 3,900 % éch. 01/06/2051                  | 450                                 | 352                              | 0,01                      | Viper Energy Partners LLC                          | 2 100                               | 2 094                            | 0,03                      |
| 3,750 % éch. 15/08/2042           | 3 300                               | 2 500                            | 0,03                      | 4,000 % éch. 01/04/2047                  | 9 644                               | 7 195                            | 0,10                      | 4,900 % éch. 01/08/2030                            |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/12/2046           | 100                                 | 75                               | 0,00                      | 5,200 % éch. 01/06/2034                  | 3 500                               | 3 470                            | 0,05                      | Vistra Operations Co. LLC                          |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 01/06/2041           | 2 173                               | 1 784                            | 0,02                      | 5,250 % éch. 15/03/2030                  | 7 800                               | 7 889                            | 0,11                      | 4,550 % éch. 30/10/2028                            | 15 500                              | 15 403                           | 0,21                      |
| 4,300 % éch. 15/03/2045           | 500                                 | 395                              | 0,01                      | 5,450 % éch. 01/06/2031                  | 200                                 | 204                              | 0,00                      | 4,700 % éch. 31/01/2031                            | 5 000                               | 4 907                            | 0,07                      |
| 4,450 % éch. 15/04/2042           | 8 543                               | 7 107                            | 0,10                      | 5,450 % éch. 01/03/2035                  | 16 100                              | 16 137                           | 0,22                      | VMware LLC                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/12/2041           | 3 400                               | 2 807                            | 0,04                      | 5,850 % éch. 01/11/2027                  | 4 700                               | 4 771                            | 0,06                      | 4,700 % éch. 15/05/2030                            | 19 078                              | 19 119                           | 0,26                      |
| 4,750 % éch. 15/02/2044           | 1 889                               | 1 603                            | 0,02                      | 6,650 % éch. 01/04/2029                  | 1 600                               | 1 660                            | 0,02                      | Volkswagen Group of America Finance LLC            |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 04/06/2028           | 1 000                               | 1 006                            | 0,01                      | Southern California Gas Co.              | 3 600                               | 3 657                            | 0,05                      | 4,550 % éch. 11/09/2028                            | 2 625                               | 2 610                            | 0,04                      |
| 5,550 % éch. 15/05/2029           | 4 900                               | 5 002                            | 0,07                      | 5,200 % éch. 01/06/2033                  |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 25/03/2027                            | 6 700                               | 6 723                            | 0,09                      |
| 5,600 % éch. 15/08/2036           | 5 000                               | 5 004                            | 0,07                      | Southern Co. Gas Capital Corp.           | 6 628                               | 5 840                            | 0,08                      | 5,050 % éch. 27/03/2028                            | 9 584                               | 9 627                            | 0,13                      |
| 5,700 % éch. 01/03/2035           | 800                                 | 809                              | 0,01                      | 1,750 % éch. 15/01/2031                  |                                     |                                  |                           | Wells Fargo & Co.                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 15/08/2035           | 5 100                               | 5 260                            | 0,07                      | Spirit AeroSystems, Inc.                 | 13 200                              | 13 165                           | 0,18                      | 2,393 % éch. 02/06/2028                            | 11 500                              | 11 273                           | 0,15                      |
| 6,950 % éch. 15/03/2034           | 5 200                               | 5 673                            | 0,08                      | 4,600 % éch. 15/06/2028                  | 1 440                               | 1 327                            | 0,02                      | 3,584 % éch. 22/05/2028                            | 6 900                               | 6 843                            | 0,09                      |
| Pacific Life Global Funding       |                                     |                                  |                           | Spirit Airlines Pass-Through Trust       | 58                                  | 52                               | 0,00                      | 4,897 % éch. 25/07/2033                            | 4 199                               | 4 173                            | 0,06                      |
| 4,230 % éch. 27/01/2028           | 17 500                              | 17 526                           | 0,24                      | 3,375 % éch. 15/08/2031                  | 2 207                               | 2 142                            | 0,03                      | 5,557 % éch. 25/07/2034 (j)                        | 68 700                              | 70 378                           | 0,95                      |
| 5,692 % éch. 22/04/2031           | AUD 4 500                           | 3 165                            | 0,04                      | 3,650 % éch. 15/08/2031                  |                                     |                                  |                           | 5,574 % éch. 25/07/2029                            | 3 300                               | 3 356                            | 0,05                      |
| Paychex, Inc.                     |                                     |                                  |                           | 4,100 % éch. 01/10/2029                  |                                     |                                  |                           | 5,707 % éch. 22/04/2028                            | 7 600                               | 7 669                            | 0,10                      |
| 5,100 % éch. 15/04/2030           | \$ 867                              | 875                              | 0,01                      | Stellantis Finance U.S., Inc.            |                                     |                                  |                           | 6,303 % éch. 23/10/2029                            | 13 000                              | 13 449                           | 0,18                      |
| PennyMac Financial Services, Inc. |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 12/01/2028                  | 1 700                               | 1 715                            | 0,02                      | Welltower OP LLC                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 15/12/2029           | 100                                 | 104                              | 0,00                      | Stellantis Financial Services U.S. Corp. | 7 700                               | 7 546                            | 0,10                      | 3,100 % éch. 15/01/2030                            | 1 000                               | 950                              | 0,01                      |
| Philip Morris International, Inc. |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 15/09/2030                  | 13 000                              | 12 852                           | 0,17                      | 4,500 % éch. 01/07/2030                            | 12 783                              | 12 721                           | 0,17                      |
| 0,800 % éch. 01/08/2031           | € 3 800                             | 3 835                            | 0,05                      | 5,800 % éch. 15/06/2031                  |                                     |                                  |                           | West Virginia United Health System Obligated Group |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 06/06/2029           | 5 200                               | 5 887                            | 0,08                      | Store Capital LLC                        |                                     |                                  |                           | 3,129 % éch. 01/06/2050                            | 1 500                               | 967                              | 0,01                      |
| 3,250 % éch. 06/06/2032           | 3 700                               | 4 173                            | 0,06                      | 2,750 % éch. 18/11/2030                  | 2 000                               | 1 809                            | 0,02                      | Western Midstream Operating LP                     |                                     |                                  |                           |
| Pioneer Natural Resources Co.     |                                     |                                  |                           | Store Capital LLC                        |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 01/03/2031                            | 200                                 | 198                              | 0,00                      |
| 7,200 % éch. 15/01/2028           | \$ 2 394                            | 2 486                            | 0,03                      | 4,950 % éch. 11/02/2031                  | 3 400                               | 3 358                            | 0,05                      | 6,150 % éch. 01/04/2033                            | 100                                 | 104                              | 0,00                      |
| Prologis LP                       |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 30/04/2030                  | 2 300                               | 2 317                            | 0,03                      | Western-Southern Global Funding                    |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 15/02/2033           | CAD 6 600                           | 4 690                            | 0,06                      | Stryker Corp.                            | 16 630                              | 15 060                           | 0,20                      | 4,500 % éch. 16/07/2028                            | 5 300                               | 5 278                            | 0,07                      |
| Protective Life Corp.             |                                     |                                  |                           | 1,950 % éch. 15/06/2030                  |                                     |                                  |                           | Weyerhaeuser Co.                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 15/01/2030           | \$ 18 039                           | 17 155                           | 0,23                      | Sun Communities Operating LP             | 3 400                               | 3 257                            | 0,04                      | 6,875 % éch. 15/12/2033                            | 649                                 | 714                              | 0,01                      |
| Protective Life Global Funding    |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 15/04/2032                  |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 01/07/2026                            | 12 350                              | 12 350                           | 0,17                      |
| 5,432 % éch. 14/01/2032           | 5 000                               | 5 108                            | 0,07                      | System Energy Resources, Inc.            | 5 000                               | 4 992                            | 0,07                      | 7,375 % éch. 15/03/2032                            | 2 889                               | 3 224                            | 0,04                      |
| Public Storage Operating Co.      |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/12/2034                  |                                     |                                  |                           | Williams Cos., Inc.                                |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 20/01/2034           | € 10 400                            | 11 693                           | 0,16                      | T-Mobile USA, Inc.                       | 14 100                              | 12 380                           | 0,17                      | 5,600 % éch. 15/03/2035                            | 10 000                              | 10 207                           | 0,14                      |
| RBC International                 |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 15/11/2031                  | 6 963                               | 6 320                            | 0,09                      | WMG Acquisition Corp.                              |                                     |                                  |                           |
| 4,660 % éch. 16/12/2028 (i)       | \$ 10 000                           | 9 836                            | 0,13                      | 2,550 % éch. 15/02/2031                  | 13 500                              | 13 034                           | 0,18                      | 3,750 % éch. 01/12/2029                            | 2 552                               | 2 444                            | 0,03                      |
| RD Michigan Property Owner LLC    |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/01/2035                  |                                     |                                  |                           | WP Carey, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045           | 43 330                              | 43 211                           | 0,58                      | Targa Resources Partners LP              |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 02/10/2031                            | € 2 900                             | 3 266                            | 0,04                      |
| Realty Income Corp.               |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/01/2032                  | 200                                 | 190                              | 0,00                      | Wynn Las Vegas LLC                                 | \$ 2 300                            | 2 300                            | 0,03                      |
| 3,875 % éch. 20/06/2035           | € 4 600                             | 5 208                            | 0,07                      | TD SYNNEK Corp.                          | 6 836                               | 6 503                            | 0,09                      | 5,250 % éch. 15/05/2027                            |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/04/2033           | \$ 900                              | 889                              | 0,01                      | 2,375 % éch. 09/08/2028                  |                                     |                                  |                           | Wynn Resorts Finance LLC                           |                                     |                                  |                           |
| RELX Capital, Inc.                |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/07/2032                  | 7 600                               | 8 378                            | 0,11                      | 6,250 % éch. 15/03/2033                            | 3 900                               | 3 917                            | 0,05                      |
| 3,000 % éch. 22/05/2030           | 2 000                               | 1 879                            | 0,03                      | Times Square Hotel Trust                 |                                     |                                  |                           | Yellowstone Energy LP                              |                                     |                                  |                           |
| Republic Services, Inc.           |                                     |                                  |                           | 8,528 % éch. 01/08/2026                  | 248                                 | 248                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 31/12/2026                            | 830                                 | 824                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 01/04/2034           | 200                                 | 201                              | 0,00                      | Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC   | 1 500                               | 1 425                            | 0,02                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| RGA Global Funding                |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/05/2030                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 09/01/2030           | 2 513                               | 2 546                            | 0,03                      | United Airlines Pass-Through Trust       | 5 496                               | 5 018                            | 0,07                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 11/01/2031           | 5 100                               | 5 228                            | 0,07                      | 2,700 % éch. 01/11/2033                  | 407                                 | 392                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 21/11/2028           | 8 763                               | 8 996                            | 0,12                      | 2,875 % éch. 07/04/2030                  | 523                                 | 502                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Rio Oil Finance Trust             |                                     |                                  |                           | 3,100 % éch. 07/04/2030                  | 516                                 | 507                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 06/01/2027           | 35                                  | 36                               | 0,00                      | 3,450 % éch. 01/06/2029                  | 1 320                               | 1 280                            | 0,02                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Robert Bosch Finance LLC          | € 2 200                             | 2 521                            | 0,03                      | 3,450 % éch. 07/01/2030                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 21/05/2029           |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/09/2031                  | 12 226                              | 11 804                           | 0,16                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Sabine Pass Liquefaction LLC      | \$ 5 700                            | 5 663                            | 0,08                      | 3,700 % éch. 01/09/2031                  | 4 067                               | 3 885                            | 0,05                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 15/03/2028           |                                     |                                  |                           | 4,150 % éch. 25/02/2033                  | 8 015                               | 7 792                            | 0,11                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Sammons Financial Group, Inc.     |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 25/02/2033                  | 796                                 | 769                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,450 % éch. 12/05/2027           | 700                                 | 698                              | 0,01                      | 5,800 % éch. 15/07/2037                  | 6 283                               | 6 541                            | 0,09                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 15/04/2034           | 5 100                               | 5 461                            | 0,07                      | 5,875 % éch. 15/04/2029                  | 2 640                               | 2 672                            | 0,04                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| San Diego Gas & Electric Co.      |                                     |                                  |                           | Venture Global Calcasieu Pass LLC        | 7 800                               | 6 957                            | 0,09                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 1,700 % éch. 01/10/2030           | 1 185                               | 1 049                            | 0,01                      | 4,125 % éch. 15/08/2031                  | 400                                 | 376                              | 0,01                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,950 % éch. 15/08/2051           | 200                                 | 128                              | 0,00                      | 6,250 % éch. 15/01/2030                  | 29 200                              | 29 920                           | 0,40                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/03/2032           | 2 100                               | 1 911                            | 0,03                      | Venture Global LNG, Inc.                 | 4 100                               | 4 269                            | 0,06                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 01/06/2047           | 100                                 | 76                               | 0,00                      | 8,375 % éch. 01/06/2031                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| SBL Holdings, Inc.                |                                     |                                  |                           | Verizon Communications, Inc.             | 300                                 | 264                              | 0,00                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,900 % éch. 26/09/2028           | 3 000                               | 2 924                            | 0,04                      | 1,750 % éch. 20/01/2031                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Sempra                            |                                     |                                  |                           | VICI Properties LP                       | 9 075                               | 8 819                            | 0,12                      |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,313 % éch. 07/01/2028           | 15 000                              | 15 071                           | 0,20                      | 3,875 % éch. 15/02/2029                  |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| Sixth Street Lending Partners     |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/01/2030           | 2 100                               | 2 087                            | 0,03                      |                                          |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 11/03/2029           | 4 300                               | 4 392                            | 0,06                      |                                          |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           |

## CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS

|                                      |           |        |      |
|--------------------------------------|-----------|--------|------|
| Databricks, Inc.                     |           |        |      |
| 1,000 % éch. 05/01/2032 μ            | 877       | 877    | 0,01 |
| 8,114 % éch. 05/01/2032              | 3 963     | 3 958  | 0,05 |
| Discovery Global Holdings, Inc.      |           |        |      |
| TBD % éch. 03/06/2033                | € 3 800   | 4 358  | 0,06 |
| TBD % éch. 03/06/2033                | \$ 13 240 | 13 260 | 0,18 |
| Live Nation Entertainment, Inc.      |           |        |      |
| 5,639 % éch. 21/10/2032              | 4 876     | 4 884  | 0,07 |
| Newfold Digital Holdings Group, Inc. |           |        |      |
| 9,364 % éch. 30/04/2029              | 64        | 52     | 0,00 |
| Project Dorchester                   |           |        |      |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (i)          | € 3 500   | 4 002  | 0,05 |
| Virgin Media Bristol LLC             |           |        |      |
| 6,967 % éch. 31/03/2031              | \$ 1 300  | 1 157  | 0,02 |
| 6,990 % éch. 31/01/2029              | 1 500     | 1 441  | 0,02 |
|                                      |           | 33 989 | 0,46 |

## OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX

|                                                                          |     |     |      |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|-----|------|
| Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010 |     |     |      |
| 6,725 % éch. 01/04/2035                                                  | 69  | 73  | 0,00 |
| 7,350 % éch. 01/07/2035                                                  | 357 | 382 | 0,01 |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Obligations Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010                 |                                     |                                  |                           | JPMorgan Alternative Loan Trust                                      |                                     |                                  |                           | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                              |                                     |                                  |                           |
| 6,637 % éch. 01/04/2057                                                                                | \$ 183                              | \$196                            | 0,00                      | 5,843 % éch. 26/05/2037                                              | \$ 155                              | \$120                            | 0,00                      | Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                           |
| Obligations New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, Series 2010 |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust                  |                                     |                                  |                           | 3,913 % éch. 25/07/2037                                        | \$ 1                                | \$1                              | 0,00                      |
| 5,267 % éch. 01/05/2027                                                                                | 2 200                               | 2 214                            | 0,03                      | 4,248 % éch. 05/07/2033                                              | 4 200                               | 3 975                            | 0,06                      | 4,077 % éch. 25/09/2042                                        | 12                                  | 12                               | 0,00                      |
| Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020                |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Trust                                              |                                     |                                  |                           | 4,092 % éch. 25/05/2042                                        | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 1,705 % éch. 01/07/2027                                                                                | 6 785                               | 6 620                            | 0,09                      | 5,511 % éch. 25/07/2035                                              | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 4,164 % éch. 25/03/2049                                        | 355                                 | 353                              | 0,00                      |
|                                                                                                        |                                     | 9 485                            | 0,13                      | Lehman Mortgage Trust                                                |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 25/12/2047                                        | 2 127                               | 2 130                            | 0,03                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX                 |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/02/2037                                              |                                     |                                  |                           | 4,449 % éch. 25/01/2051                                        | 5 754                               | 5 778                            | 0,08                      |
|                                                                                                        |                                     |                                  |                           | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,642 % éch. 25/04/2032                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
|                                                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,370 % éch. 21/11/2034                                              |                                     |                                  |                           | 4,966 % éch. 01/06/2043                                        | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
|                                                                                                        |                                     |                                  |                           | MASTR Alternative Loan Trust                                         |                                     |                                  |                           | 4,967 % éch. 01/10/2044                                        | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
|                                                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 25/02/2034                                              |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 25/05/2036                                        | 139                                 | 141                              | 0,00                      |
|                                                                                                        |                                     |                                  |                           | Merill Lynch Mortgage Investors Trust                                |                                     |                                  |                           | 5,710 % éch. 01/12/2034                                        | 8                                   | 8                                | 0,00                      |
| American Home Mortgage Assets Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/06/2028                                              |                                     |                                  |                           | 5,797 % éch. 01/02/2037                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 4,684 % éch. 25/10/2046                                                                                | 5 509                               | 3 602                            | 0,05                      | 4,806 % éch. 25/01/2029                                              |                                     |                                  |                           | 5,898 % éch. 01/04/2037                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| Banc of America Funding Trust                                                                          |                                     |                                  |                           | 4,938 % éch. 25/05/2036                                              |                                     |                                  |                           | 5,948 % éch. 01/03/2037                                        | 20                                  | 20                               | 0,00                      |
| 6,620 % éch. 20/09/2034                                                                                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,109 % éch. 25/02/2035                                              |                                     |                                  |                           | 6,383 % éch. 01/10/2036                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/04/2036                                              |                                     |                                  |                           | 6,406 % éch. 01/09/2037                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 4,627 % éch. 25/01/2035                                                                                | 247                                 | 240                              | 0,00                      | 6,197 % éch. 25/05/2033                                              |                                     |                                  |                           | 6,411 % éch. 01/09/2037                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,809 % éch. 25/08/2035                                                                                | 18                                  | 17                               | 0,00                      | MortgageIT Trust                                                     |                                     |                                  |                           | Freddie Mac                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,498 % éch. 25/02/2034                                                                                | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,503 % éch. 25/12/2034                                              |                                     |                                  |                           | 1,137 % éch. 25/08/2029 (a)                                    | 2 593                               | 64                               | 0,00                      |
| 6,109 % éch. 25/11/2034                                                                                | 43                                  | 41                               | 0,00                      | NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates                      |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/01/2040                                        | 22                                  | 21                               | 0,00                      |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                                                               |                                     |                                  |                           | 4,213 % éch. 25/02/2035                                              |                                     |                                  |                           | 4,549 % éch. 15/04/2049 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/06/2046                                                                                | 1 671                               | 1 550                            | 0,02                      | Residential Accred Loans, Inc. Trust                                 |                                     |                                  |                           | 15/12/2050                                                     | 7 149                               | 7 154                            | 0,10                      |
| 4,112 % éch. 25/11/2036                                                                                | 341                                 | 143                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/04/2046                                              |                                     |                                  |                           | 4,642 % éch. 25/07/2056                                        | 5 400                               | 5 401                            | 0,07                      |
| Benchmark Mortgage Trust                                                                               |                                     |                                  |                           | 5,244 % éch. 25/08/2035                                              |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 25/07/2056                                        | 10 600                              | 10 617                           | 0,14                      |
| 4,203 % éch. 10/10/2051                                                                                | 1 274                               | 1 272                            | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                                              |                                     |                                  |                           | 4,944 % éch. 25/02/2045                                        | 11                                  | 11                               | 0,00                      |
| Chase Mortgage Finance Trust                                                                           |                                     |                                  |                           | Residential Asset Securitization Trust                               |                                     |                                  |                           | 5,925 % éch. 01/01/2037                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 6,281 % éch. 25/02/2037                                                                                | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/04/2037                                              |                                     |                                  |                           | 5,940 % éch. 01/03/2036                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates                                                   |                                     |                                  |                           | Sequoia Mortgage Trust                                               |                                     |                                  |                           | 5,992 % éch. 25/11/2055                                        | 5 594                               | 4 139                            | 0,06                      |
| 3,993 % éch. 25/10/2035                                                                                | 41                                  | 40                               | 0,00                      | 4,154 % éch. 20/05/2035                                              |                                     |                                  |                           | 6,035 % éch. 01/04/2037                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/01/2035                                                                                | 26                                  | 25                               | 0,00                      | 4,636 % éch. 20/05/2034                                              |                                     |                                  |                           | 6,130 % éch. 01/03/2037                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           | Stripe Global Holdings, Inc.                                         |                                     |                                  |                           | 6,160 % éch. 01/03/2036                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 5,860 % éch. 25/09/2035                                                                                | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,880 % éch. 26/03/2029 (i)                                          |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,170 % éch. 26/03/2031 (i)                                          |                                     |                                  |                           | 4,259 % éch. 20/02/2074 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,174 % éch. 20/07/2046                                                                                | 2 831                               | 2 478                            | 0,03                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | 20/05/2074                                                     | 1 854                               | 1 860                            | 0,03                      |
| 4,323 % éch. 25/02/2037                                                                                | 27                                  | 22                               | 0,00                      | 4,312 % éch. 25/04/2035                                              |                                     |                                  |                           | 4,309 % éch. 20/02/2074                                        | 744                                 | 745                              | 0,01                      |
| 4,383 % éch. 25/08/2035                                                                                | 345                                 | 338                              | 0,01                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                          |                                     |                                  |                           | 4,399 % éch. 20/04/2074                                        | 1 815                               | 1 831                            | 0,03                      |
| 4,463 % éch. 25/12/2035                                                                                | 905                                 | 874                              | 0,01                      | 4,143 % éch. 25/07/2046                                              |                                     |                                  |                           | 4,421 % éch. 20/12/2065                                        | 144                                 | 144                              | 0,00                      |
| 5,094 % éch. 25/08/2035                                                                                | 1 192                               | 1 036                            | 0,02                      | 4,183 % éch. 25/04/2036                                              |                                     |                                  |                           | 4,459 % éch. 20/05/2074                                        | 949                                 | 961                              | 0,01                      |
| 5,750 % éch. 25/04/2047                                                                                | 526                                 | 263                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/05/2036                                              |                                     |                                  |                           | 4,709 % éch. 20/05/2073                                        | 371                                 | 377                              | 0,01                      |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                                      |                                     |                                  |                           | 4,254 % éch. 19/07/2035                                              |                                     |                                  |                           | 5,509 % éch. 20/03/2071                                        | 797                                 | 816                              | 0,01                      |
| 4,223 % éch. 25/05/2035                                                                                | 3                                   | 2                                | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/02/2036                                              |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,650 % éch. 25/01/2036                                                                                | 121                                 | 116                              | 0,00                      | 5,204 % éch. 25/03/2046                                              |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,669 % éch. 25/11/2034                                                                                | 10                                  | 10                               | 0,00                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                     | 211 800                             | 187 917                          | 2,54                      |
| 5,500 % éch. 25/10/2034                                                                                | 288                                 | 286                              | 0,01                      | 6,032 % éch. 25/06/2033                                              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 39 100                              | 36 352                           | 0,49                      |
| 5,500 % éch. 25/07/2035                                                                                | 33                                  | 13                               | 0,00                      | 6,108 % éch. 25/07/2033                                              |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/07/2056                                        | 37 100                              | 35 641                           | 0,48                      |
| 5,500 % éch. 25/12/2035                                                                                | 170                                 | 125                              | 0,00                      | Thornburg Mortgage Securities Trust                                  |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/07/2056                                        | 39 400                              | 38 850                           | 0,53                      |
| 6,000 % éch. 25/11/2037                                                                                | 20                                  | 8                                | 0,00                      | 4,016 % éch. 25/09/2037                                              |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 15 300                              | 15 585                           | 0,21                      |
| 6,224 % éch. 20/02/2036                                                                                | 9                                   | 8                                | 0,00                      | Towd Point Mortgage Trust                                            |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                                                   |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 25/06/2057                                              |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/06/2042 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,149 % éch. 25/06/2033                                                                                | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 3,250 % éch. 25/07/2056                                              |                                     |                                  |                           | 01/10/2046                                                     | 26 035                              | 23 566                           | 0,32                      |
| Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates                                   |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                        |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/10/2045                                        | 2 594                               | 2 380                            | 0,03                      |
| 6,500 % éch. 25/12/2033                                                                                | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 2,200 % éch. 25/11/2041                                              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/05/2030                                        |                                     |                                  |                           |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                                            |                                     |                                  |                           | 4,133 % éch. 25/05/2034                                              |                                     |                                  |                           | 01/05/2049                                                     | 16 943                              | 16 019                           | 0,22                      |
| 3,700 % éch. 26/06/2037                                                                                | 1 754                               | 1 715                            | 0,02                      | 4,303 % éch. 25/12/2045                                              |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/11/2048 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,738 % éch. 27/05/2037                                                                                | 2 982                               | 1 940                            | 0,03                      | 4,383 % éch. 25/01/2045                                              |                                     |                                  |                           | 01/12/2054                                                     | 77 813                              | 75 304                           | 1,02                      |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 4,604 % éch. 25/03/2035                                              |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/02/2053 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/07/2047                                                                                | 343                                 | 329                              | 0,01                      | 4,744 % éch. 25/08/2046                                              |                                     |                                  |                           | 01/05/2054                                                     | 47 083                              | 46 463                           | 0,63                      |
| GS Mortgage Securities Corp. Trust                                                                     |                                     |                                  |                           | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/04/2054 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,872 % éch. 15/07/2035                                                                                | 3 262                               | 2 137                            | 0,03                      | 4,143 % éch. 25/06/2037                                              |                                     |                                  |                           | 01/05/2054                                                     | 5 464                               | 5 508                            | 0,07                      |
| GSC Capital Corp. Mortgage Trust                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,584 % éch. 25/11/2046                                              |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/11/2053                                        | 1 862                               | 1 939                            | 0,03                      |
| 4,123 % éch. 25/05/2036                                                                                | 252                                 | 250                              | 0,00                      | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust       |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |
| GSIMPS Mortgage Loan Trust                                                                             |                                     |                                  |                           | 4,762 % éch. 25/06/2033                                              |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/08/2056                                        | 256 700                             | 245 720                          | 3,32                      |
| 4,113 % éch. 25/01/2036                                                                                | 1 416                               | 1 149                            | 0,02                      | Wells Fargo Alternative Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| GSR Mortgage Loan Trust                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/03/2037                                              |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                     | 338 470                             | 332 359                          | 4,49                      |
| 5,550 % éch. 25/04/2032                                                                                | 62                                  | 60                               | 0,00                      | 6,312 % éch. 25/07/2037                                              |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/07/2056                                        | 11 400                              | 11 438                           | 0,15                      |
| HarborView Mortgage Loan Trust                                                                         |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                                |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 3,944 % éch. 19/08/2037                                                                                | 3 150                               | 2 861                            | 0,04                      | 3,874 % éch. 15/06/2036                                              |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,164 % éch. 19/12/2036                                                                                | 2 786                               | 2 525                            | 0,04                      | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust                         |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,434 % éch. 20/06/2035                                                                                | 1 084                               | 1 015                            | 0,01                      | 6,003 % éch. 25/08/2036                                              |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,057 % éch. 19/04/2034                                                                                | 2                                   | 2                                | 0,00                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| HomeBanc Mortgage Trust                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/03/2035                                                                                | 174                                 | 143                              | 0,00                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| Impac CMB Trust                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,463 % éch. 25/03/2035                                                                                | 44                                  | 43                               | 0,00                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 3,618 % éch. 25/03/2036                                                                                | 568                                 | 383                              | 0,01                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                      | ACTIONS    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------|------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,625 % éch. 15/02/2046 (j)                                | \$ 1 800                            | \$ 1 728                         | 0,02                      | <b>BILLET À COURT TERME</b>              |                                     |                                  |                           | PIMCO Funds: Global              |            |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/08/2055 (j)                                | 160 800                             | 156 045                          | 2,11                      | Discovery Global Holdings, Inc.          |                                     |                                  |                           | Investors Series plc -           |            |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/02/2056 (j)                                | 4 775                               | 4 640                            | 0,06                      | 3,755 % éch. 15/03/2027                  | \$ 474                              | \$ 471                           | 0,01                      | Fonds PIMCO                      |            |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 15/08/2045 (j)                                | 11 855                              | 11 768                           | 0,16                      | Kona Spc Ltd.                            |                                     |                                  |                           | European High Yield              |            |                                  |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) |                                     |                                  |                           | 5,718 % éch. 15/09/2026                  | € 8 200                             | 9 378                            | 0,12                      | Bond Funds (g)                   | 3 290 300  | \$ 50 220                        | 0,68                      |
| 1,000 % éch. 15/02/2046                                    | 4 285                               | 3 149                            | 0,04                      |                                          |                                     | 9 849                            | 0,13                      | PIMCO Funds: Global              |            |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 15/02/2053                                    | 18 480                              | 14 054                           | 0,19                      | Total des Instruments à court terme      |                                     | 16 093                           | 0,22                      | Investors Series plc -           |            |                                  |                           |
| 2,125 % éch. 15/02/2054                                    | 26 708                              | 23 347                           | 0,32                      |                                          |                                     |                                  |                           | Fonds Global High                |            |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 15/02/2055                                    | 12 925                              | 11 903                           | 0,16                      | Total des Valeurs mobilières             | \$ 8 306 426                        | 112,31                           |                           | Yield Bond ESG                   |            |                                  |                           |
| Billets du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | Fund (g)                         | 468 652    | 5 422                            | 0,07                      |
| 3,500 % éch. 31/01/2030                                    | 7 325                               | 7 161                            | 0,10                      | <b>ACTIONS</b>                           |                                     |                                  |                           | PIMCO Select Funds plc -         |            |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 30/04/2030                                    | 6 850                               | 6 777                            | 0,09                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |                                     |                                  |                           | Fonds PIMCO                      |            |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 31/01/2031                                    | 7 550                               | 7 486                            | 0,10                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |                                     |                                  |                           | US Dollar Short-Term             |            |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 28/02/2031                                    | 7 375                               | 7 388                            | 0,10                      | PIMCO Funds: Global Investors            |                                     |                                  |                           | Floating NAV Fund (g)            | 289 466    | 2 887                            | 0,04                      |
| STRIPS du Trésor américain                                 |                                     |                                  |                           | Series plc - Fonds Asia                  |                                     |                                  |                           | PIMCO Specialty Funds            |            |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 15/08/2047 (d)                                | 100 000                             | 34 496                           | 0,46                      | Strategic Interest Bond                  |                                     |                                  |                           | Ireland p.l.c. - Fonds           |            |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 15/11/2049 (d)                                | 6 700                               | 2 031                            | 0,03                      | Fund (g)                                 | 3 787 451                           | 42 609                           | 0,58                      | PIMCO China Bond                 | 329 257    | 5 156                            | 0,07                      |
|                                                            |                                     | 766 485                          | 10,36                     | PIMCO Funds: Global Investors            |                                     |                                  |                           | Fund (g)                         |            | 130 344                          | 1,76                      |
| Total États-Unis                                           |                                     | 4 636 489                        | 62,69                     | Series plc - Fonds PIMCO                 |                                     |                                  |                           |                                  |            |                                  |                           |
| <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                           |                                     |                                  |                           | Credit Opportunities                     |                                     |                                  |                           | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>  |            |                                  |                           |
| <b>BILLET DE TRÉSORERIE</b>                                |                                     |                                  |                           | Bond Fund (g)                            | 2 202 381                           | 24 050                           | 0,32                      | PIMCO Select Funds plc -         |            |                                  |                           |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                  |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | Fonds                            |            |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 21/09/2026                                    | 6 300                               | 6 244                            | 0,09                      |                                          |                                     |                                  |                           | PIMCO US Dollar Short            | 2 587 040  | 259 946                          | 3,52                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | Maturity UCITS ETF (g)           |            |                                  |                           |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement | \$ 390 290 | 5,28                             |                           |

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

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

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2028              | 879                   | \$ 289                                  | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                     | Long  | 12/2027              | 1 610                 | (174)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Court | 09/2026              | 408                   | (303)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Long  | 09/2026              | 268                   | 220                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Long  | 09/2026              | 932                   | 600                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre       | Long  | 09/2026              | 463                   | 551                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Long  | 09/2026              | 3 445                 | 4 235                                   | 0,06                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026              | 2 293                 | 213                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 5 595                 | (682)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 951                   | (142)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 1 912                 | 2 128                                   | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 4 666                 | 13 321                                  | 0,18                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 1 147                 | 3 259                                   | 0,04                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 23 515                               | 0,32                   |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime    | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | \$ 108,250         | 02/07/2026           | 85                    | \$ (15)  | \$ 0            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 02/07/2026           | 180                   | (32)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 02/07/2026           | 85                    | (16)     | (4)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500            | 02/07/2026           | 180                   | (32)     | (4)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000            | 10/07/2026           | 82                    | (13)     | (7)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750            | 10/07/2026           | 82                    | (13)     | (2)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 17/07/2026           | 106                   | (25)     | (12)            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250            | 17/07/2026           | 104                   | (16)     | (23)            | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 17/07/2026           | 106                   | (23)     | (22)            | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 17/07/2026           | 104                   | (19)     | (6)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,000            | 24/07/2026           | 89                    | (25)     | (7)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,500            | 24/07/2026           | 201                   | (59)     | (26)            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,500            | 24/07/2026           | 103                   | (24)     | (39)            | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 24/07/2026           | 393                   | (95)     | (39)            | 0,00                   |
|                                                                                                           |                    |                      |                       | \$ (407) | \$ (191)        | 0,00                   |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 23 324 0,32

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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



## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Ford Motor Co.      | (5,000) %              | 20/06/2030         | \$ 12 300                           | \$ (341)                                | 0,00                   |
| General Motors Co.  | (5,000)                | 20/06/2030         | 38 700                              | 151                                     | 0,00                   |
|                     |                        |                    |                                     | \$ (190)                                | 0,00                   |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Entité de référence                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| American International Group, Inc. | 1,000 %                 | 20/12/2027         | \$ 8 000                            | \$ 138                                  | 0,00                   |
| AT&T, Inc.                         | 1,000                   | 20/12/2026         | 1 300                               | (15)                                    | 0,00                   |
| AT&T, Inc.                         | 1,000                   | 20/06/2028         | 29 600                              | 498                                     | 0,01                   |
| Bank of America Corp.              | 1,000                   | 20/12/2026         | 8 700                               | (79)                                    | 0,00                   |
| Barclays PLC                       | 1,000                   | 20/12/2030         | € 6 700                             | 5                                       | 0,00                   |
| Crédit Agricole S.A.               | 1,000                   | 20/12/2030         | 5 000                               | 36                                      | 0,00                   |
| General Motors Co.                 | 5,000                   | 20/12/2026         | \$ 2 050                            | (358)                                   | 0,00                   |
| Glencore Finance Europe Ltd.       | 5,000                   | 20/06/2028         | € 2 700                             | (140)                                   | 0,00                   |
| Glencore Finance Europe Ltd.       | 5,000                   | 20/12/2029         | 2 700                               | (100)                                   | 0,00                   |
| Glencore Finance Europe Ltd.       | 5,000                   | 20/06/2031         | 9 500                               | 18                                      | 0,00                   |
| Lennar Corp.                       | 5,000                   | 20/12/2026         | \$ 3 200                            | (584)                                   | (0,01)                 |
| Lloyds Banking Group PLC           | 1,000                   | 20/12/2030         | € 6 700                             | 3                                       | 0,00                   |
| MetLife, Inc.                      | 1,000                   | 20/06/2028         | \$ 600                              | 19                                      | 0,00                   |
| MGM Resorts International          | 5,000                   | 20/12/2029         | 2 000                               | (57)                                    | 0,00                   |
| NatWest Group PLC                  | 1,000                   | 20/12/2030         | € 10 000                            | (17)                                    | 0,00                   |
| Oracle Corp.                       | 1,000                   | 20/06/2030         | \$ 11 600                           | (429)                                   | (0,01)                 |
| Stellantis NV                      | 5,000                   | 20/12/2030         | € 2 400                             | (69)                                    | 0,00                   |
| T-Mobile USA, Inc.                 | 5,000                   | 20/06/2028         | \$ 7 800                            | (634)                                   | (0,01)                 |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                   | 20/12/2027         | 500                                 | 14                                      | 0,00                   |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                   | 20/06/2028         | 9 400                               | 144                                     | 0,00                   |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                   | 20/12/2028         | 2 300                               | 38                                      | 0,00                   |
|                                    |                         |                    |                                     | \$ (1 569)                              | (0,02)                 |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | (5,000) %              | 20/06/2030         | \$ 10 780                           | \$ (660)                                | (0,01)                 |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | (5,000)                | 20/12/2030         | 46 158                              | (291)                                   | 0,00                   |
|                                |                        |                    |                                     | \$ (951)                                | (0,01)                 |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000 %                 | 20/12/2030         | \$ 951 870                          | \$ 478                                  | 0,01                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 2 550 250                           | 9 732                                   | (0,01)                 |
| Indice iTraxx Europe Main 44 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2030         | € 66 680                            | (36)                                    | (0,01)                 |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 188 400                             | 602                                     | 0,01                   |
|                                            |                         |                    |                                     | \$ 10 776                               | 0,14                   |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|--------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %   | 18/03/2031         | £ 6 520              | \$ (177)                                | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 16/09/2036         | 82 400               | 21                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,250     | 18/06/2030         | \$ 106 200           | 1 078                                   | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,281     | 15/02/2040         | 110 000              | 10 072                                  | 0,14                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,325     | 31/08/2030         | 175 200              | 3 118                                   | 0,04                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 18/03/2031         | 35 300               | 684                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 20/06/2054         | 72 765               | 6 144                                   | 0,08                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,514     | 04/09/2034         | 13 100               | 503                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,551     | 17/09/2035         | 5 700                | 226                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,564     | 31/01/2033         | 3 200                | 67                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,642     | 15/02/2055         | 4 790                | 449                                     | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,679     | 15/02/2036         | 4 300                | 113                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,715     | 15/08/2035         | 6 204                | 115                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,748     | 03/03/2036         | 10 300               | 235                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2029         | 60 600               | 1 528                                   | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 15/05/2032         | 155 211              | 1 516                                   | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/06/2036         | 56 400               | (412)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                  | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 16/09/2036         | 15 900               | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,755     | 15/02/2036         | 9 000                | 180                                     | 0,00                   |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775 %   | 03/03/2036      | \$ 10 200         | \$ 210                            | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,842     | 04/03/2030      | 11 500            | 48                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,848     | 15/02/2055      | 121 000           | 1 340                             | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,901     | 15/02/2035      | 204 540           | 1 018                             | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,915     | 15/02/2055      | 13 000            | 614                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,943     | 15/02/2055      | 12 000            | 512                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,945     | 15/02/2055      | 12 500            | 528                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      | 3 900             | 137                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 14 810            | (47)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 68 820            | (151)                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 10 990            | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 5 200             | 138                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 13 100            | 170                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 95 900            | 532                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 2 000             | 66                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,015     | 15/11/2053      | 2 000             | 64                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,052     | 15/02/2056      | 2 100             | 48                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,059     | 15/02/2056      | 2 200             | 48                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,066     | 15/02/2046      | 1 600             | 34                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,082     | 15/11/2053      | 1 800             | 38                                | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,359    | 02/01/2029      | BRL 241 900       | (922)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,402    | 02/01/2029      | 439 400           | (1 656)                           | (0,02)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,657    | 02/01/2031      | 117 200           | (160)                             | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,681    | 02/01/2031      | 32 800            | (27)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,725    | 02/01/2031      | 1 100             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,899    | 02/01/2031      | 9 100             | (5)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,927    | 04/01/2027      | 644 100           | (1 018)                           | (0,01)              |
| À payer                                            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,500     | 17/06/2030      | CAD 143 400       | 7 251                             | 0,10                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,000     | 17/12/2035      | AUD 50 400        | (1 563)                           | (0,02)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 19/03/2030      | 156 200           | (2 575)                           | (0,03)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,650     | 12/04/2027      | € 88 900          | (1 463)                           | (0,02)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,700     | 11/04/2027      | 5 400             | (89)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,000     | 13/05/2027      | 62 700            | (928)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,000     | 18/05/2027      | 28 000            | (421)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 243 210           | (2 645)                           | (0,04)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 20/03/2054      | 15 500            | 3 368                             | 0,05                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 29 900            | 286                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 49 280            | (625)                             | (0,01)              |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 27 645                         | 0,37                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 35 711                         | 0,48                |

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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

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

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 6 472                            | \$ (23)  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 11 481                           | (25)     | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 09/07/2026        | 16 672                           | (52)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 16 634                           | (43)     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (143) | \$ 0         | 0,00                |

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,200 %         | 20/07/2026        | 52 200                           | \$ (40) | \$ (23)      | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004           | 08/07/2026        | 4 300                            | (11)    | (10)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 4 300                            | (11)    | 0            | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,875           | 24/07/2026        | 4 900                            | (11)    | (8)          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,135           | 24/07/2026        | 4 900                            | (12)    | (12)         | 0,00                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,150           | 01/07/2026        | 11 200                           | (9)     | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (94) | \$ (53)      | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

### OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                        | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GSC          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/07/2056 | \$ 92,891       | 06/07/2026        | 5 600                            | \$ (23) | \$ (3)       | 0,00                |
| JPM          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 89,641          | 06/08/2026        | 9 100                            | (48)    | (4)          | 0,00                |
|              |                                                                                                                    |                 |                   |                                  | \$ (71) | \$ (7)       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Petroleos Mexicanos                                 | 1,000 %              | 20/12/2029      | \$ 8 000                         | \$ (1 108)             | \$ 914                           | \$ (194)     | 0,00                |
|              | SW Finance PLC                                      | 1,000                | 20/06/2035      | 800                              | (98)                   | 7                                | (91)         | 0,00                |
| GST          | Equinix, Inc.                                       | 5,000                | 20/06/2027      | 4 500                            | 629                    | (432)                            | 197          | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                 | 1,000                | 20/12/2029      | 500                              | (73)                   | 61                               | (12)         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement saoudien  | 1,000                | 20/12/2026      | 1 400                            | 33                     | (27)                             | 6            | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000                | 20/06/2027      | 15 800                           | (978)                  | 1 057                            | 79           | 0,00                |
|              |                                                     |                      |                 |                                  | \$ (1 595)             | \$ 1 580                         | \$(15)       | 0,00                |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 18 600                         | \$ 4 233               | \$ (275)                         | \$ 3 958     | 0,05                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 23 900                           | 5 325                  | (239)                            | 5 086        | 0,07                |
| BRC          | Indice iTraxx Japan 45 Index à 5 ans              | 1,000                | 20/06/2031      | ¥ 1 348 650                      | 112                    | 45                               | 157          | 0,00                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | € 2 100                          | 476                    | (29)                             | 447          | 0,01                |
|              | Indice iTraxx Japan 45 Index à 5 ans              | 1,000                | 20/06/2031      | ¥ 1 096 520                      | 99                     | 28                               | 127          | 0,00                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | € 9 900                          | 2 082                  | 25                               | 2 107        | 0,03                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 22 950                           | 5 103                  | (220)                            | 4 883        | 0,07                |
|              | Indice iTraxx Japan 45 Index à 5 ans              | 1,000                | 20/06/2031      | ¥ 6 545 790                      | 537                    | 224                              | 761          | 0,01                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 17 967              | \$ (441)                         | \$ 17 526    | 0,24                |

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

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

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 72 662            | \$ 51 959          | \$ 1 619              | \$ 0                             | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH             | 4 344             | 643                | 3                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 28 029            | 16 553             | 609                   | 0                                | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 145               | 113                | 2                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 358             | CAD 1 931          | 3                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 18 640            | NZD 32 877         | 122                   | (60)                             | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 1 928             | \$ 1 358           | 0                     | (3)                              | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 30 880            | 17 464             | 0                     | (122)                            | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 678               | 130                | 0                     | (1)                              | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 10 354            | 12 835             | 0                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 530             | 16                 | 0                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 109 187           | 686                | 15                    | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 14 865            | 1 503              | 1                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 51                | 40                 | 1                     | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 3 634             | CNH 24 574         | 0                     | (14)                             | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 643               | COP 2 217 391      | 0                     | (3)                              | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 522             | € 2 167            | 0                     | (45)                             | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 238               | KRW 361 901        | 0                     | (4)                              | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 525             | NOK 23 458         | 0                     | (155)                            | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 513               | PLN 1 937          | 2                     | 0                                | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 772             | \$ 932             | 0                     | 0                                | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 30 377 554        | 7 837              | 0                     | (822)                            | (0,01)              |
|              | 09/2026           | MXN             | 11 146            | 629                | 0                     | (5)                              | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 684               | INR 65 006         | 0                     | (2)                              | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 2 269 769         | \$ 643             | 3                     | 0                                | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 14 341 236        | 3 605              | 0                     | (395)                            | (0,01)              |
| BPS          | 07/2026           | BRL             | 141 963           | 27 876             | 506                   | (57)                             | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 21 083            | 14 888             | 27                    | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 3 085             | 3 922              | 97                    | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 67 190            | 9 929              | 31                    | 0                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 1 267 935         | 1 476 915          | 27 351                | (67)                             | 0,37                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 07/2026           | £ 351 292       | \$ 470 822        | \$ 4 570           | \$ 0                  | \$ 4 570                                | 0,06                |
|              | 07/2026           | IDR 471 672 458 | 26 308            | 20                 | (18)                  | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 9 020       | 3 060             | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 777 014     | 8 090             | 0                  | (119)                 | (119)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 369 337       | 2 323             | 50                 | 0                     | 50                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 3 870 128   | 2 534             | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 12 335      | 1 254             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 28 714      | 22 217            | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 118 310     | 3 602             | 44                 | (7)                   | 37                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 083        | AUD 3 023         | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 22 542          | BRL 116 369       | 0                  | (59)                  | (59)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 050           | CAD 1 449         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 038           | € 902             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 13 614          | £ 10 280          | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 900           | IDR 69 491 937    | 0                  | (32)                  | (32)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 39 803          | INR 3 771 783     | 60                 | (84)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 502           | ¥ 404 800         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 835           | KRW 10 492 382    | 0                  | (56)                  | (56)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 515             | KWD 157           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 131             | PLN 491           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 70 848      | \$ 4 319          | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 905       | 639               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 130        | BRL 21 036        | 0                  | (98)                  | (98)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 46 861 292  | \$ 2 580          | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 98 192      | 3 027             | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 8 795        | COP 32 139 094    | 365                | 0                     | 365                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | 14 902          | IDR 263 801 338   | 16                 | (296)                 | (280)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 2 110           | INR 200 492       | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 601             | THB 19 684        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | 1 637           | IDR 29 808 974    | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | 504             | KWD 153           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD 4 605       | \$ 15 831         | 813                | 0                     | 813                                     | 0,01                |
|              | 07/2029           | 466             | 1 602             | 83                 | 0                     | 83                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 11 230      | 3 794             | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 210 152       | 1 300             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 40 713      | 24 077            | 917                | 0                     | 917                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | TRY 130 382     | 2 719             | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 25 830       | TRY 1 234 199     | 253                | 0                     | 253                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 349 901     | \$ 21 542         | 227                | 0                     | 227                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 300        | ¥ 209 601         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ¥ 1 957 184     | \$ 12 310         | 267                | 0                     | 267                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 7 167        | € 6 147           | 0                  | (139)                 | (139)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 30 220          | NZD 53 486        | 206                | 0                     | 206                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 53 486      | \$ 30 254         | 0                  | (206)                 | (206)                                   | 0,00                |
| CBK          | 09/2026           | COP 15 328 929  | 3 928             | 0                  | (441)                 | (441)                                   | (0,01)              |
|              | 10/2026           | PEN 60 969      | 17 744            | 0                  | (70)                  | (70)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 7 749 679   | 2 030             | 0                  | (212)                 | (212)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 24 615      | 3 841             | 76                 | 0                     | 76                                      | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | € 13 208        | 15 394            | 294                | 0                     | 294                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 6 428         | 8 661             | 130                | 0                     | 130                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 10 057      | 3 462             | 85                 | 0                     | 85                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 522 676     | 5 540             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 13 140      | 1 416             | 89                 | 0                     | 89                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 162         | 18                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 883        | COP 13 524 513    | 31                 | (6)                   | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 303           | € 5 490           | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 485           | IDR 80 461 849    | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | ILS 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 394           | INR 522 676       | 128                | 0                     | 128                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 128           | ¥ 1 313 400       | 0                  | (47)                  | (47)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 603             | KRW 911 043       | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 769           | PEN 12 738        | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 258             | PLN 944           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 52          | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 16 800      | 5 937             | 293                | 0                     | 293                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 177        | ILS 3 496         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 83 712 527  | \$ 21 873         | 0                  | (1 987)               | (1 987)                                 | (0,03)              |
|              | 09/2026           | IDR 171 066 842 | 9 476             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 52 145      | 543               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 21 145      | 6 146             | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 138 116     | 4 169             | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 34 291       | COP 125 243 503   | 1 407              | 0                     | 1 407                                   | 0,02                |
|              | 09/2026           | 3 095           | IDR 55 190 933    | 0                  | (35)                  | (35)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 121           | MXN 20 049        | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP 5 699 570   | \$ 1 612          | 6                  | (3)                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 12 791      | 3 769             | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 8 193 557   | 2 271             | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 4 991        | IDR 90 744 651    | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 03/2027           | PEN 158 055     | \$ 45 535         | 0                  | (365)                 | (365)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 10 794 867  | 604               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 247 980     | 2 626             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 752        | INR 169 033       | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,00                |



# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | \$ 695          | NOK 6 454         | \$ 0               | \$ (42)               | \$ (42)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 258             | PLN 957           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 162 706     | \$ 10 051         | 140                | 0                     | 140                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 104 863 716 | 5 820             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 899        | IDR 34 492 869    | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 2 626           | INR 249 661       | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 66 844      | \$ 9 880          | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 234 078     | 2 481             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 12 731      | 3 765             | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 91 352      | 71 605            | 979                | 0                     | 979                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 36 432       | CNH 247 813       | 75                 | 0                     | 75                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 119 805         | £ 90 562          | 394                | 0                     | 394                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 2 453           | INR 234 078       | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 44 369          | ¥ 7 175 025       | 0                  | (221)                 | (221)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9 242           | PLN 33 764        | 0                  | (260)                 | (260)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | SEK 96            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 231 792     | \$ 14 046         | 0                  | (74)                  | (74)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 247 268     | 36 432            | 0                  | (72)                  | (72)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 59 733 266  | 15 486            | 0                  | (1 707)               | (1 707)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | £ 90 562        | 119 801           | 0                  | (395)                 | (395)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | ILS 16 912      | 5 907             | 226                | 0                     | 226                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 6 947 314     | 43 050            | 193                | 0                     | 193                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 18 961      | 5 608             | 55                 | 0                     | 55                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 96          | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9            | SGD 12            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 199           | INR 114 854       | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 910             | MXN 16 063        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | BRL 127 463     | \$ 24 757         | 131                | 0                     | 131                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 229 031     | 60                | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 1 728 224   | 1 119             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 27 910       | BRL 147 276       | 764                | (220)                 | 544                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 130 620         | CAD 185 873       | 391                | 0                     | 391                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 15 013          | COP 51 836 396    | 27                 | (79)                  | (52)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 325           | IDR 77 553 615    | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 119           | KRW 1 727 978     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10 562          | PLN 39 387        | 0                  | (84)                  | (84)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 185 609     | \$ 130 620        | 0                  | (391)                 | (391)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 6 716        | BRL 34 321        | 0                  | (137)                 | (137)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 674           | INR 160 527       | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 45 490 251  | \$ 13 032         | 66                 | 0                     | 66                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 78 007 777  | 4 325             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 44 118      | 2 509             | 3                  | (3)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 315 487     | 9 776             | 220                | 0                     | 220                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 8 943        | BRL 46 031        | 0                  | (181)                 | (181)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 8 859           | IDR 159 073 206   | 17                 | (59)                  | (42)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 6 780           | INR 651 932       | 62                 | 0                     | 62                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 771           | MXN 30 857        | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | 24 757          | BRL 130 268       | 0                  | (132)                 | (132)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 6 533 329   | \$ 1 806          | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
| IND JPM      | 07/2026           | DKK 44 005      | 6 870             | 139                | 0                     | 139                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 315 765     | 225 109           | 6 349              | 0                     | 6 349                                   | 0,09                |
|              | 07/2026           | CNH 23 487      | 3 466             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 28 621      | 9 585             | 0                  | (22)                  | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 66 185      | 701               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 534 032     | 345               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 19 031      | 1 923             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 2 760       | 1 631             | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 7 852        | £ 5 851           | 0                  | (86)                  | (86)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 655             | IDR 11 774 302    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 701             | INR 66 185        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 519             | KRW 796 270       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 017           | NZD 3 576         | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 22 156          | PLN 80 770        | 2                  | (670)                 | (668)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 2 382           | THB 79 622        | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 195         | \$ 25             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 80 162      | 27 397            | 467                | 0                     | 467                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$ 1 923        | NOK 19 039        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 12 239 204  | \$ 677            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 23 077      | 1 308             | 1                  | (6)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 512 348     | 15 655            | 160                | (24)                  | 136                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | TWD 20 595      | 651               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 69 221       | BRL 356 247       | 0                  | (1 415)               | (1 415)                                 | (0,02)              |
|              | 09/2026           | 6 149           | COP 22 489 717    | 261                | 0                     | 261                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 5 474           | INR 521 970       | 2                  | (2)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 25 942          | MXN 453 058       | 0                  | (177)                 | (177)                                   | 0,00                |
| MBC          | 12/2026           | 63 955          | 1 124 728         | 0                  | (451)                 | (451)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD 5 709       | \$ 4 019          | 63                 | 0                     | 63                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 32 036      | 40 628            | 952                | (40)                  | 912                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | COP 52 031 098  | 14 269            | 0                  | (748)                 | (748)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | € 45 641        | 52 946            | 765                | 0                     | 765                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR 1 066 913   | 60                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 248 960     | 2 636             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------|--------|
| MYI          | 07/2026           | ¥               | 1 941 498         | \$                 | 12 215                | \$ 269                                  | 0,00                |         |        |
|              | 07/2026           | NOK             | 6 271             |                    | 633                   | 0                                       | (1)                 | 0,00    |        |
|              | 07/2026           | NZD             | 21 643            |                    | 12 404                | 93                                      | 93                  | 0,00    |        |
|              | 07/2026           | \$              | 150 679           | AUD                | 218 204               | 596                                     | (104)               | 492     | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 13 589            | DKK                | 89 071                | 35                                      | 0                   | 35      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 490 153         | €                  | 1 311 865             | 9 803                                   | (100)               | 9 703   | 0,13   |
|              | 07/2026           |                 | 2 258             | £                  | 1 677                 | 0                                       | (32)                | (32)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 065             | INR                | 391 799               | 68                                      | 0                   | 68      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 109             | KRW                | 6 229 195             | 0                                       | (86)                | (86)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 768             | NOK                | 35 812                | 0                                       | (149)               | (149)   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 809             | NZD                | 3 206                 | 15                                      | 0                   | 15      | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 214 948           | \$                 | 148 221               | 0                                       | (608)               | (608)   | (0,01) |
|              | 08/2026           | DKK             | 88 917            |                    | 13 589                | 0                                       | (35)                | (35)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 1 306 875         |                    | 1 486 353             | 0                                       | (9 801)             | (9 801) | (0,13) |
|              | 08/2026           | ILS             | 773               |                    | 258                   | 0                                       | (1)                 | (1)     | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 234               | NOK                | 2 322                 | 1                                       | 0                   | 1       | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 823             | \$                 | 160                   | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 91 414            |                    | 2 738                 | 0                                       | (31)                | (31)    | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 10 790            | INR                | 1 032 263             | 50                                      | (14)                | 36      | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 6                 | \$                 | 8                     | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 61                |                    | 47                    | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 963               | €                  | 844                   | 2                                       | 0                   | 2       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 5 338             | £                  | 4 032                 | 13                                      | 0                   | 13      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3                 | SGD                | 4                     | 0                                       | 0                   | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 026             | IDR                | 71 785 252            | 0                                       | (11)                | (11)    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 110             | INR                | 395 439               | 63                                      | 0                   | 63      | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 15 767            | TRY                | 741 161               | 36                                      | 0                   | 36      | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 72 187 839        | \$                 | 4 026                 | 24                                      | 0                   | 24      | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 1 894             | IDR                | 33 695 274            | 0                                       | (26)                | (26)    | 0,00   |
|              | 07/2026           | COP             | 8 177 528         | \$                 | 2 123                 | 0                                       | (237)               | (237)   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 32 900            |                    | 205                   | 3                                       | 0                   | 3       | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 7 359             | £                  | 5 485                 | 0                                       | (79)                | (79)    | 0,00   |
| 07/2026      |                   | 1 522           | IDR               | 27 309 921         | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 5 410           | INR               | 518 522            | 63                    | 0                                       | 63                  | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 2 995           | ¥                 | 475 900            | 0                     | (67)                                    | (67)                | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 9 954           | KRW               | 14 237 268         | 0                     | (758)                                   | (758)               | (0,01)  |        |
| 08/2026      | HKD               | 184             | \$                | 23                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
| 08/2026      | \$                | 4 161           | INR               | 398 720            | 33                    | 0                                       | 33                  | 0,00    |        |
| 09/2026      | IDR               | 82 144 049      | \$                | 4 550              | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00    |        |
| 09/2026      | THB               | 112 477         |                   | 3 483              | 76                    | 0                                       | 76                  | 0,00    |        |
| 09/2026      | \$                | 4 828           | IDR               | 86 664 453         | 6                     | (30)                                    | (24)                | 0,00    |        |
| 07/2026      | CNH               | 110 509         | \$                | 16 336             | 56                    | 0                                       | 56                  | 0,00    |        |
| 07/2026      | DKK               | 46 200          |                   | 7 194              | 127                   | 0                                       | 127                 | 0,00    |        |
| 07/2026      | ¥                 | 4 748 881       |                   | 29 892             | 673                   | 0                                       | 673                 | 0,01    |        |
| 07/2026      | \$                | 119 307         | AUD               | 172 909            | 484                   | 0                                       | 484                 | 0,01    |        |
| 07/2026      |                   | 54              | CAD               | 75                 | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 1 259           | CHF               | 1 019              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 401             | €                 | 344                | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 126 647         | £                 | 95 756             | 445                   | 0                                       | 445                 | 0,01    |        |
| 07/2026      |                   | 92 857          | SGD               | 120 272            | 128                   | 0                                       | 128                 | 0,00    |        |
| 08/2026      | AUD               | 172 909         | \$                | 119 231            | 0                     | (491)                                   | (491)               | (0,01)  |        |
| 08/2026      | CHF               | 1 015           |                   | 1 259              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00    |        |
| 08/2026      | £                 | 95 756          |                   | 126 643            | 0                     | (446)                                   | (446)               | (0,01)  |        |
| 08/2026      | SGD               | 120 000         |                   | 92 857             | 0                     | (132)                                   | (132)               | 0,00    |        |
| 07/2026      | BRL               | 45 798          |                   | 8 950              | 132                   | 0                                       | 132                 | 0,00    |        |
| 07/2026      | CAD               | 171 506         |                   | 124 376            | 3 490                 | 0                                       | 3 490               | 0,05    |        |
| 07/2026      | CHF               | 1 070           |                   | 1 361              | 35                    | 0                                       | 35                  | 0,00    |        |
| 07/2026      | \$                | 1 200           | CAD               | 1 701              | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00    |        |
| 08/2026      | CAD               | 1 698           | \$                | 1 200              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00    |        |
| 07/2026      | \$                | 263             | PLN               | 960                | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00    |        |
| 08/2026      | COP               | 10 231 957      | \$                | 2 709              | 0                     | (236)                                   | (236)               | 0,00    |        |
| 09/2026      |                   | 102 262 154     |                   | 26 503             | 0                     | (2 645)                                 | (2 645)             | (0,03)  |        |
| 09/2026      | MXN               | 8 862           |                   | 505                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00    |        |
| 09/2026      | THB               | 13 047          |                   | 398                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00    |        |
| 09/2026      | \$                | 7               | THB               | 217                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |        |
| 07/2026      |                   | 56 391          | CHF               | 45 529             | 52                    | 0                                       | 52                  | 0,00    |        |
| 08/2026      | CHF               | 45 366          | \$                | 56 391             | 0                     | (53)                                    | (53)                | 0,00    |        |
|              |                   |                 |                   | \$ 71 231          | \$ (30 312)           | \$ 40 919                               | 0,55                |         |        |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et Investisseurs en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |      |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|------|
| AZD          | 07/2026              | AUD                | 4 905                | \$                    | 3 382                    | \$ 0                                          | \$ (16)                | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 3 161                | AUD                   | 4 438                    | 0                                             | (86)                   | 0,00 |
|              | 08/2026              |                    | 3 380                |                       | 4 905                    | 16                                            | 0                      | 16   |
| BOA          | 07/2026              |                    | 2                    |                       | 3                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| BSH          | 07/2026           | AUD             | 2 583             | \$ 1 794           | \$ 5                  | \$ 0                                    | 5                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 2 835             | AUD 3 978          | 0                     | (79)                                    | (79)                | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 1 793             | 2 583              | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00 |
| FAR          | 07/2026           | AUD             | 2 517             | \$ 1 748           | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 3 287             | AUD 4 607          | 0                     | (95)                                    | (95)                | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 1 747             | 2 517              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00 |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 3 669             | \$ 2 528           | 0                     | (14)                                    | (14)                | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 196               | AUD 278            | 1                     | (4)                                     | (3)                 | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 2 428             | 3 527              | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00 |
| SOG          | 07/2026           | AUD             | 760               | \$ 525             | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 804               | AUD 1 131          | 0                     | (21)                                    | (21)                | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 524               | 760                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |
|              |                   |                 |                   | \$ 42              | \$ (326)              | \$ (284)                                | 0,00                |      |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation, Investisseurs en CHF (couverte) de distribution, Administrations en CHF (couverte) de capitalisation, E en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF 96          | \$ 118            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 174          | CHF 138           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CHF 163         | \$ 204            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 88           | CHF 69            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 149 525         | 116 875           | 0                  | (4 636)               | (4 636)                                 | (0,06)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF 2 422       | \$ 2 994          | 6                  | (15)                  | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 168 283      | CHF 131 794       | 0                  | (4 899)               | (4 899)                                 | (0,07)              |
| MYI          | 08/2026           | 472             | 380               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 128 489     | \$ 158 821        | 0                  | (466)                 | (466)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 158 821      | CHF 128 028       | 467                | 0                     | 467                                     | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | 162 648         | 127 857           | 1                  | (4 145)               | (4 144)                                 | (0,06)              |
| UAG          | 07/2026           | CHF 268         | \$ 337            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 127 816         | 158 308           | 0                  | (145)                 | (145)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 158 308      | CHF 127 358       | 148                | 0                     | 148                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 630             | \$ (14 310)           | \$ (13 680)                             | (0,19)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CZK (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | CZK             | 28 894            | \$ 1 358           | \$ 0                  | \$ (3)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 358             | CZK 28 886         | 3                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 2 990             | 62 341             | 0                     | (53)                                    | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | CZK             | 62 948            | \$ 2 962           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 962             | CZK 62 940         | 4                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | CZK             | 63 244            | \$ 2 970           | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 165             | CZK 45 126         | 0                     | (39)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 2 970             | 63 225             | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 28 898            | \$ 1 358           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
| RYL          | 08/2026           | \$              | 1 358             | CZK 28 890         | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 716               | 14 915             | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 2 947             | 61 608             | 0                     | (45)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 19              | \$ (168)              | \$ (149)                                | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en EUR (exposition au risque de change) de distribution et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 107               | \$ 74              | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | CAD             | 147               | 103                | 0                     | 0                                       | 0,00                |      |
|              | 07/2026           | \$              | 4 770             | AUD 6 698          | 0                     | (130)                                   | (130)               | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 345               | £ 257              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 86                | NZD 147            | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 74                | AUD 107            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 103               | CAD 147            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | €               | 218               | \$ 254             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00 |
| BOA          | 07/2026           | \$              | 23                | ¥ 3 667            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | £               | 22                | \$ 29              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
| BPS          | 07/2026           | NZD             | 15                | 8                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 15 782            | £ 11 778           | 0                     | (150)                                   | (150)               | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 78                | ¥ 12 405           | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 29                | £ 22               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 8                 | NZD 15             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00 |
|              | 07/2026           | AUD             | 490               | \$ 340             | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00 |
| BSH          | 07/2026           | €               | 123               | 144                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| CBK          | 07/2026           | \$ 413          | ¥ 65 737          | \$ 0               | \$ (9)                | \$ (9)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | 340             | AUD 490           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 739           | € 1 491           | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 70              | SEK 644           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 33              | AUD 46            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD 226         | \$ 157            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 302 531       | 1 870             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 383         | 40                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 277          | AUD 389           | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | 157             | 226               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 870           | ¥ 301 739         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 40              | SEK 383           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 14 125      | \$ 9 927          | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
| JPM          | 08/2026           | \$ 9 927        | CAD 14 105        | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 6 210       | \$ 4 344          | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4            | AUD 6             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19              | £ 14              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 1               | NZD 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 4 341           | AUD 6 210         | 0                  | (41)                  | (41)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 108         | \$ 74             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 579           | 672               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | NZD 134         | 76                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 234         | 24                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 387        | CHF 1 086         | 0                  | (40)                  | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 208             | € 181             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 386             | ¥ 61 254          | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 74              | AUD 108           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 77              | NZD 134           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 24              | SEK 234           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 5             | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 6            | £ 5               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 11 497        | \$ 15 217         | 0                  | (42)                  | (42)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 15 216       | £ 11 497          | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | € 104 508       | \$ 118 878        | 0                  | (606)                 | (606)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £525            | 694               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3            | AUD 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 121 036         | € 103 757         | 0                  | (2 411)               | (2 411)                                 | (0,03)              |
| WST          | 07/2026           | 1 004           | ¥ 159 504         | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 119 039         | € 104 508         | 605                | 0                     | 605                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | 694             | £ 525             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 129         | \$ 91             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 530       | CAD 14 520        | 0                  | (296)                 | (296)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 91              | 129               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 1 085       | \$ 1 344          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 344        | CHF 1 081         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 748             | \$ (3 857)            | \$ (3 109)                              | (0,04)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 47            | \$ 54             | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 2 311           | 2 633             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 528 512      | € 453 764         | 35                 | (9 760)               | (9 725)                                 | (0,13)              |
| BSH          | 07/2026           | € 3 864         | \$ 4 494          | 76                 | 0                     | 76                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 488 981      | € 419 389         | 0                  | (9 493)               | (9 493)                                 | (0,13)              |
| CBK          | 07/2026           | € 994           | \$ 1 159          | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14 253       | € 12 221          | 0                  | (282)                 | (282)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 415 130       | \$ 473 455        | 0                  | (1 163)               | (1 163)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 474 093      | € 415 130         | 1 161              | 0                     | 1 161                                   | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | € 465 582       | \$ 529 188        | 250                | (3 361)               | (3 111)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 245        | € 1 071           | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 1 992         | \$ 2 275          | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 509 623      | € 448 086         | 3 361              | 0                     | 3 361                                   | 0,05                |
| SOG          | 07/2026           | € 448 086       | \$ 509 697        | 0                  | (2 599)               | (2 599)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 524 272      | € 449 424         | 0                  | (10 446)              | (10 446)                                | (0,14)              |
| SSB          | 08/2026           | 510 389         | 448 086           | 2 595              | 0                     | 2 595                                   | 0,03                |
|              | 07/2026           | 164             | 143               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 143           | \$ 164            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 7 501           | \$ (37 139)           | \$ (29 638)                             | (0,40)              |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de distribution, E en GBP (couverte) de distribution, R en GBP (couverte) de distribution, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 169 110      | £ 125 964         | \$ 0               | \$ (1 924)            | \$ (1 924)                              | (0,02)              |
| BOA          | 07/2026           | £ 473           | \$ 633            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 123 966         | 163 530           | 27                 | (1 031)               | (1 004)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 223 815      | £ 167 044         | 14                 | (2 121)               | (2 107)                                 | (0,03)              |
|              | 08/2026           | £ 81            | \$ 106            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 160 745      | £ 121 890         | 1 030              | 0                     | 1 030                                   | 0,01                |
| BRC          | 07/2026           | £ 317           | \$ 419            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 5 887           | 7 898             | 84                 | 0                     | 84                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 157          | £ 117             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 774           | \$ 1 023          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 131        | £ 6 047           | 0                  | (106)                 | (106)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 023           | 774               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | £ 482           | \$ 647            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 182 555      | £ 136 047         | 0                  | (1 987)               | (1 987)                                 | (0,03)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 845           | \$ 1 137          | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 592        | £ 3 466           | 16                 | (8)                   | 8                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 25 036        | \$ 32 948         | 0                  | (281)                 | (281)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 32 947       | £ 25 036          | 281                | 0                     | 281                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 139 436       | \$ 184 558        | 1                  | (509)                 | (508)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 308          | £ 229             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 184 459         | 139 367           | 512                | 0                     | 512                                     | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | £ 139 357       | \$ 184 092        | 0                  | (869)                 | (869)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 184 087      | £ 139 357         | 870                | 0                     | 870                                     | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £ 17 847        | \$ 23 592         | 0                  | (96)                  | (96)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 23 591       | £ 17 847          | 96                 | 0                     | 96                                      | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | 22 108          | 16 771            | 151                | 0                     | 151                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 113           | \$ (8 943)            | \$ (5 830)                              | (0,08)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 10 804       | NOK 100 027       | \$ 0               | \$ (696)              | \$ (696)                                | (0,01)              |
| CBK          | 07/2026           | 6 229           | 57 675            | 0                  | (401)                 | (401)                                   | (0,01)              |
| DUB          | 07/2026           | 7 675           | 71 310            | 0                  | (468)                 | (468)                                   | (0,01)              |
| JPM          | 07/2026           | NOK 76 207      | \$ 7 699          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 699        | NOK 76 240        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NOK 97 901      | \$ 9 851          | 0                  | (42)                  | (42)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 795        | NOK 63 007        | 0                  | (428)                 | (428)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 9 851           | 97 943            | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | 303             | 2 801             | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 44              | \$ (2 057)            | \$ (2 013)                              | (0,03)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 74 861       | SEK 692 315       | \$ 0               | \$ (3 327)            | \$ (3 327)                              | (0,05)              |
| BPS          | 07/2026           | SEK 47          | \$ 5              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 83 028       | SEK 767 193       | 0                  | (3 757)               | (3 757)                                 | (0,05)              |
| FAR          | 07/2026           | SEK 450 525     | \$ 46 429         | 0                  | (122)                 | (122)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 46 429       | SEK 449 726       | 122                | 0                     | 122                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 681 742     | \$ 70 030         | 2                  | (413)                 | (411)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 80 700       | SEK 749 551       | 0                  | (3 253)               | (3 253)                                 | (0,04)              |
|              | 08/2026           | 69 903          | 679 323           | 414                | 0                     | 414                                     | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 538             | \$ (10 872)           | \$ (10 334)                             | (0,14)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et W en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 27 536       | SGD 35 111        | \$ 0               | \$ (390)              | \$ (390)                                | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | SGD 11 807      | \$ 9 122          | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 45 134       | SGD 57 639        | 0                  | (572)                 | (572)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 9 122           | 11 780            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD 115         | \$ 89             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 232             | 181               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 140          | SGD 179           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SGD 9 193       | \$ 7 107          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |



| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR                                                | 07/2026           | \$ 30 944       | SGD 39 472        | \$ 0               | \$ (428)              | \$ (428)                                | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | 7 107           | 9 172             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| MBC                                                | 07/2026           | SGD 27 930      | \$ 21 536         | 0                  | (58)                  | (58)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 52 300       | SGD 66 723        | 0                  | (715)                 | (715)                                   | (0,01)              |
| NSL                                                | 08/2026           | 21 536          | 27 866            | 58                 | 0                     | 58                                      | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | SGD 553         | \$ 432            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| RBC                                                | 07/2026           | \$ 84           | SGD 108           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | SGD 6 038       | \$ 4 663          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| SOG                                                | 08/2026           | \$ 4 663        | SGD 6 024         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | 69              | 89                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | SGD 139 875     | \$ 107 970        | 0                  | (171)                 | (171)                                   | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 47           | SGD 60            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 107 970         | 139 558           | 174                | 0                     | 174                                     | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | 1 272           | 1 650             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 253             | \$ (2 347)            | \$ (2 094)                              | (0,03)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (8 761)                              | (0,12)              |

| DESCRIPTION                            | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>        |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim             | \$ 22 000                     | \$ 7 755                   | 0,11                |
| MMK International Capital DAC          |                               |                            |                     |
| 4,375 % éch. 13/06/2024 ^              | 4 900                         | 294                        | 0,00                |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. |                               |                            |                     |
| 5,125 % éch. 29/10/2022 ^              | 61 150                        | 3 669                      | 0,05                |
| 5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (h)          | 12 200                        | 732                        | 0,01                |
| Total des Autres actifs financiers     |                               | \$ 12 450                  | 0,17                |

**TITRES VENDUS À DÉCOUVERT****AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN**

Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA  
5,000 % éch. 01/07/2056

95 385 (93 738) (1,27)

|                                        |                |         |
|----------------------------------------|----------------|---------|
| Total des Titres vendus à découvert    | \$ (93 738)    | (1,27)  |
| Total des Investissements              | \$ 8 665 702   | 117,17  |
| Autres actifs et passifs à court terme | \$ (1 269 562) | (17,17) |
| Actif net                              | \$ 7 396 140   | 100,00  |

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

μ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

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

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

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 1,18 %) :

| Description de l'émetteur                        | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Aurizon Network Pty. Ltd.                        | 6,560 % | 21/12/2034      | 21/11/2024   | \$ 329 | \$ 353       | 0,00                |
| Chick-fil-A, Inc.                                | 4,580   | 21/07/2028      | 23/04/2026   | 1 500  | 1 492        | 0,02                |
| Chick-fil-A, Inc.                                | 4,600   | 21/07/2029      | 23/04/2026   | 700    | 694          | 0,01                |
| Constellation Pharmaceuticals, Inc.              | 5,550   | 01/07/2033      | 16/01/2025   | 3 175  | 3 225        | 0,04                |
| Ford Credit Canada Co.                           | 4,398   | 09/04/2029      | 06/01/2026   | 3 410  | 3 334        | 0,05                |
| Ford Credit Canada Co. Cie Credit Ford Du Canada | 4,916   | 09/01/2031      | 06/01/2026   | 363    | 358          | 0,00                |
| Goldman Sachs Group, Inc.                        | 3,641   | 05/03/2032      | 26/02/2026   | 3 288  | 3 149        | 0,04                |
| Goldman Sachs Group, Inc.                        | 4,340   | 05/03/2037      | 26/02/2026   | 1 315  | 1 259        | 0,02                |
| Grifols S.A.                                     | 7,500   | 01/05/2030      | 20/08/2025   | 4 160  | 4 100        | 0,06                |
| Hardwood Funding LLC                             | 4,840   | 07/06/2028      | 11/03/2025   | 2 700  | 2 694        | 0,04                |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût       | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|------------|--------------|---------------------|
| Hardwood Funding LLC                                | 4,980 % | 07/06/2030      | 11/03/2025   | \$ 2 100   | \$ 2 091     | 0,03                |
| Hardwood Funding LLC                                | 5,160   | 07/06/2032      | 11/03/2025   | 2 700      | 2 698        | 0,04                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804   | 20/04/2033      | 13/04/2026   | 7 500      | 7 487        | 0,10                |
| Morgan Stanley                                      | 0,000   | 02/04/2032      | 11/02/2020   | 42 537     | 34 996       | 0,47                |
| National Football League                            | 5,250   | 05/10/2034      | 07/10/2025   | 12 900     | 12 814       | 0,17                |
| National Football League                            | 5,420   | 05/10/2037      | 27/06/2025   | 4 600      | 4 583        | 0,06                |
| Project Dorchester                                  | 4,610   | 04/01/2027      | 10/12/2025   | 4 075      | 4 002        | 0,05                |
| RBC International                                   | 4,660   | 16/12/2028      | 18/11/2025   | 10 000     | 9 836        | 0,13                |
| Stripe Global Holdings, Inc.                        | 4,880   | 26/03/2029      | 23/03/2026   | 7 700      | 7 581        | 0,10                |
| Stripe Global Holdings, Inc.                        | 5,170   | 26/03/2031      | 23/03/2026   | 7 700      | 7 527        | 0,10                |
|                                                     |         |                 |              | \$ 122 752 | \$ 114 273   | 1,53                |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 662 559 \$ (31 décembre 2025 : 25 061 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2025 : 30 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 4 909 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 1 322 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 295 468 \$ (31 décembre 2025 : 264 329 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 45 190 \$ (31 décembre 2025 : 14 830 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 8 137 161                                         | \$ 169 265                                        | \$ 8 306 426        |
| Fonds d'investissement                        | 390 290                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 390 290             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 8 775                                                                             | 41 590                                               | (91)                                              | 50 274              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 12 450                                               | 0                                                 | 12 450              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (93 738)                                             | 0                                                 | (93 738)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 399 065</b>                                                                 | <b>\$ 8 097 463</b>                                  | <b>\$ 169 174</b>                                 | <b>\$ 8 665 702</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 7 688 752                                         | \$ 163 249                                        | \$ 7 852 001        |
| Fonds d'investissement                        | 445 491                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 445 491             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (8 271)                                                                           | 47 013                                               | 30                                                | 38 772              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 6 490                                                | 4 695                                             | 11 185              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 437 220</b>                                                                 | <b>\$ 7 742 255</b>                                  | <b>\$ 167 974</b>                                 | <b>\$ 8 347 449</b> |

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

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

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|--------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS          | 3,500 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (8 954)       | \$ (8 961)                               | (0,12)              |
| BPS          | (0,250)        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 319)        | (1 508)                                  | (0,02)              |
|              | 3,830          | 30/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (50 347)      | (50 347)                                 | (0,68)              |
| BRC          | 1,000          | 09/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 708)          | (1 715)                                  | (0,02)              |
|              | 1,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (2 814)        | (3 220)                                  | (0,04)              |
|              | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 344)          | (2 682)                                  | (0,04)              |
|              | 3,000          | 04/02/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (3 854)       | (3 901)                                  | (0,05)              |
|              | 3,000          | 01/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | £ (1 768)        | (2 352)                                  | (0,03)              |
|              | 3,000          | 02/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 953)          | (5 259)                                  | (0,07)              |
|              | 3,250          | 27/03/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 238)          | (1 658)                                  | (0,02)              |
| CIB          | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026         | \$ (10 591)      | (10 620)                                 | (0,14)              |
| DEU          | 3,650          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (4 775)          | (4 776)                                  | (0,07)              |
|              | 3,710          | 10/06/2026        | 01/07/2026         | (7 690)          | (7 707)                                  | (0,11)              |
|              | 3,740          | 29/06/2026        | 06/07/2026         | (99)             | (99)                                     | 0,00                |
|              | 3,750          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (7 186)          | (7 187)                                  | (0,10)              |
| JML          | 1,750          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (3 869)        | (4 427)                                  | (0,06)              |
| JPS          | 3,720          | 22/06/2026        | 06/07/2026         | \$ (90 419)      | (90 503)                                 | (1,23)              |
|              | 3,730          | 30/06/2026        | 06/07/2026         | (47 591)         | (47 596)                                 | (0,64)              |

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| MEI                                           | 1,850 %        | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 287)        | \$ (1 472)                               | (0,02)              |
| NOM                                           | 3,720          | 11/06/2026        | 09/07/2026         | \$ (48 193)      | (48 293)                                 | (0,65)              |
| NXN                                           | 3,710          | 08/06/2026        | 06/07/2026         | (156 579)        | (156 950)                                | (2,12)              |
| SCX                                           | 3,500          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (3 931)          | (3 952)                                  | (0,05)              |
|                                               | 3,650          | 10/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (4 896)          | (4 906)                                  | (0,07)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (190 365)        | (190 385)                                | (2,58)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (660 476)</b>                      | <b>(8,93)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (363)                                                   | \$ 1 010                | \$ 647                            | \$ 5 264                                                   | \$ (6 140)              | \$ (876)                          |
| BOA          | (2 075)                                                    | 2 530                   | 455                               | 5 415                                                      | (5 430)                 | (15)                              |
| BPS          | 26 363                                                     | (27 780)                | (1 417)                           | 4 517                                                      | (4 280)                 | 237                               |
| BRC          | 1 203                                                      | (1 450)                 | (247)                             | 12 027                                                     | (13 170)                | (1 143)                           |
| BSH          | (9 886)                                                    | 10 430                  | 544                               | 342                                                        | (350)                   | (8)                               |
| CBK          | (4 010)                                                    | 4 010                   | 0                                 | (158)                                                      | 1 440                   | 1 282                             |
| DUB          | (751)                                                      | 710                     | (41)                              | (620)                                                      | 580                     | (40)                              |
| FAR          | (1 627)                                                    | 1 670                   | 43                                | (2 354)                                                    | 2 870                   | 516                               |
| GLM          | 362                                                        | (520)                   | (158)                             | 2 814                                                      | (2 940)                 | (126)                             |
| GSC          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| GST          | 2 298                                                      | (2 280)                 | 18                                | 292                                                        | (300)                   | (8)                               |
| IND          | 140                                                        | 0                       | 140                               | 78                                                         | 0                       | 78                                |
| JPM          | 3 497                                                      | (4 610)                 | (1 113)                           | 3 502                                                      | (3 640)                 | (138)                             |
| MBC          | (7 409)                                                    | 7 890                   | 481                               | (8 043)                                                    | 8 670                   | 627                               |
| MYC          | 79                                                         | (10)                    | 69                                | 84                                                         | (10)                    | 74                                |
| MYI          | (23)                                                       | 0                       | (23)                              | (113)                                                      | 0                       | (113)                             |
| NSL          | 86                                                         | 0                       | 86                                | 2 690                                                      | (3 050)                 | (360)                             |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 2                                                          | (10)                    | (8)                               |
| SCX          | (1 024)                                                    | 920                     | (104)                             | (735)                                                      | 800                     | 65                                |
| SOG          | (12 111)                                                   | 12 510                  | 399                               | 9 206                                                      | (9 570)                 | (364)                             |
| SSB          | (783)                                                      | 840                     | 57                                | 466                                                        | (340)                   | 126                               |
| UAG          | (2 726)                                                    | 2 670                   | (56)                              | (657)                                                      | 470                     | (187)                             |
| WST          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 41                                                         | 0                       | 41                                |

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

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 52,78            | 56,46                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 27,92            | 25,45                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,83             | 0,30                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,83             | 4,66                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,24             | 0,09                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,53             | 0,39                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,00             | 0,83                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,12             | 0,12                 |
| Autres actifs                                                    | 12,75            | 11,70                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 5,99             | 4,47                 |
| Autriche                          | 0,43             | 0,48                 |
| Belgique                          | 0,21             | 0,40                 |
| Bermudes                          | 0,82             | 0,53                 |
| Brésil                            | 0,45             | 0,20                 |
| Canada                            | 1,99             | 2,51                 |
| Îles Caïmans                      | 2,01             | 1,12                 |
| Chili                             | 0,05             | 0,05                 |
| Colombie                          | 0,97             | 0,84                 |
| Costa Rica                        | 0,03             | S/O                  |
| République tchèque                | 0,11             | 0,07                 |
| Danemark                          | 0,52             | 0,31                 |
| Finlande                          | 0,25             | 0,32                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| France                                                                                                   | 3,08             | 2,20                 |
| Allemagne                                                                                                | 1,02             | 0,83                 |
| Guernesey, Îles Anglo-Normandes                                                                          | 0,46             | 0,54                 |
| Hongrie                                                                                                  | 0,19             | 0,18                 |
| Inde                                                                                                     | 0,32             | 0,31                 |
| Indonésie                                                                                                | 0,25             | 0,21                 |
| Irlande                                                                                                  | 0,91             | 0,86                 |
| Île de Man                                                                                               | 0,07             | 0,16                 |
| Israël                                                                                                   | 0,81             | 0,44                 |
| Italie                                                                                                   | 0,91             | 0,98                 |
| Japon                                                                                                    | 2,76             | 2,31                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                             | 0,69             | 0,56                 |
| Koweït                                                                                                   | 0,10             | S/O                  |
| Lettonie                                                                                                 | 0,01             | 0,01                 |
| Liberia                                                                                                  | 0,10             | 0,28                 |
| Luxembourg                                                                                               | 1,49             | 0,94                 |
| Mexique                                                                                                  | 0,79             | 0,76                 |
| Multinationales                                                                                          | 0,12             | 0,12                 |
| Pays-Bas                                                                                                 | 2,68             | 2,31                 |
| Norvège                                                                                                  | 0,61             | 0,43                 |
| Panama                                                                                                   | 0,11             | 0,37                 |
| Pérou                                                                                                    | 1,09             | 1,05                 |
| Pologne                                                                                                  | 0,40             | 0,39                 |
| Portugal                                                                                                 | 0,22             | 0,24                 |
| Qatar                                                                                                    | 0,36             | 0,17                 |
| Roumanie                                                                                                 | 0,84             | 0,82                 |
| Arabie saoudite                                                                                          | 1,33             | 1,05                 |
| Singapour                                                                                                | 0,06             | 0,10                 |
| Slovaquie                                                                                                | 0,16             | 0,01                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 1,13             | 1,06                 |
| Corée du Sud                                                                                             | 0,45             | 0,63                 |
| Espagne                                                                                                  | 0,55             | 0,67                 |
| Supranationales                                                                                          | 0,51             | 0,49                 |
| Suède                                                                                                    | 0,57             | 0,01                 |
| Suisse                                                                                                   | 0,69             | 0,63                 |
| Thaïlande                                                                                                | 0,04             | 0,04                 |
| Turquie                                                                                                  | 0,02             | 0,02                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,74             | 0,18                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 8,93             | 7,56                 |
| États-Unis                                                                                               | 62,69            | 58,41                |
| Îles Vierges britanniques                                                                                | S/O              | 0,08                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,22             | 0,14                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 5,28             | 5,67                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,32             | (0,16)               |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,02)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,14             | 0,03                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,37             | 0,23                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | S/O              | 0,01                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Options sur titres                                                                                       | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,24             | 0,17                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,55             | (0,47)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,91)           | 0,72                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,17             | 0,14                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (1,27)           | S/O                  |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (17,17)          | (6,15)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## 30 juin 2026

[Voir les notes annexes](#)



# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 5,500 % éch. 11/07/2043                                                                | € 2 300                             | \$ 2 864                         | 0,13                      | Deutsche Bank AG                                          |                                     |                                  |                           | HONGRIE                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 16/07/2033 (e)(g)                                                         | 1 500                               | 1 847                            | 0,08                      | 1,875 % éch. 23/02/2028                                   | € 2 500                             | \$ 2 840                         | 0,12                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                     |                                  |                           |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.                                                |                                     |                                  |                           | 2,311 % éch. 16/11/2027                                   | \$ 2 200                            | 2 182                            | 0,10                      | Obligation internationale du gouvernement hongrois   |                                     |                                  |                           |
| 0,250 % éch. 29/06/2028                                                                | 900                                 | 977                              | 0,04                      | 3,547 % éch. 18/09/2031                                   | 250                                 | 236                              | 0,01                      | 4,875 % éch. 22/03/2040 (i)                          | € 6 260                             | \$ 7 506                         | 0,33                      |
| 4,000 % éch. 21/11/2029                                                                | 1 800                               | 2 113                            | 0,09                      | 3,742 % éch. 07/01/2033                                   | 1 300                               | 1 192                            | 0,05                      | INDE                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 18/09/2030                                                                | 800                                 | 947                              | 0,04                      | 4,725 % éch. 06/02/2032                                   | 900                                 | 887                              | 0,04                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 02/05/2030                                                                | 1 100                               | 1 302                            | 0,06                      | Deutsche Boerse AG                                        |                                     |                                  |                           | IIFL Finance Ltd.                                    |                                     |                                  |                           |
| BNP Paribas Cardiff S.A.                                                               |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 28/09/2026                                   | € 1 500                             | 1 719                            | 0,08                      | 7,600 % éch. 10/09/2029                              | \$ 3 000                            | 3 016                            | 0,13                      |
| 6,125 % éch. 19/12/2033 (e)(g)                                                         | 4 900                               | 5 731                            | 0,25                      | E.ON SE                                                   |                                     |                                  |                           | ReNew Pvt Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |
| BNP Paribas S.A.                                                                       |                                     |                                  |                           | 5,461 % éch. 21/10/2035                                   | AUD 2 200                           | 1 470                            | 0,06                      | 5,875 % éch. 05/03/2027                              | 1 765                               | 1 764                            | 0,08                      |
| 0,500 % éch. 19/01/2030                                                                | 1 500                               | 1 603                            | 0,07                      | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG                        |                                     |                                  |                           | Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.                         |                                     |                                  |                           |
| 1,250 % éch. 13/07/2031                                                                | £ 500                               | 553                              | 0,02                      | 4,500 % éch. 10/02/2056                                   | € 1 700                             | 1 931                            | 0,09                      | 6,500 % éch. 02/02/2031                              | 4 000                               | 3 959                            | 0,18                      |
| 3,132 % éch. 20/01/2033 (i)                                                            | \$ 1 400                            | 1 269                            | 0,06                      | Eurogrid GmbH                                             |                                     |                                  |                           | ReNew Wind Energy AP2                                |                                     |                                  |                           |
| 4,400 % éch. 14/08/2028                                                                | 1 333                               | 1 324                            | 0,06                      | 3,279 % éch. 05/09/2031                                   | 1 000                               | 1 138                            | 0,05                      | 4,500 % éch. 14/07/2028                              | 1 000                               | 968                              | 0,04                      |
| 4,750 % éch. 13/11/2032                                                                | € 1 800                             | 2 174                            | 0,10                      | 3,915 % éch. 01/02/2034                                   | 2 100                               | 2 440                            | 0,11                      | SAEL Ltd.                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,892 % éch. 30/06/2030                                                                | \$ 2 400                            | 2 400                            | 0,10                      | HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH                        |                                     |                                  |                           | 7,800 % éch. 31/07/2031                              | 634                                 | 644                              | 0,03                      |
| 5,125 % éch. 13/01/2029                                                                | 800                                 | 805                              | 0,04                      | 3,875 % éch. 05/06/2030                                   | 3 200                               | 3 723                            | 0,16                      | Total Inde                                           |                                     | 10 351                           | 0,46                      |
| 7,375 % éch. 10/09/2034 (e)(g)                                                         | 800                                 | 836                              | 0,04                      | IHO Verwaltungs GmbH                                      |                                     |                                  |                           | INDONÉSIE                                            |                                     |                                  |                           |
| BPCE S.A.                                                                              |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/05/2031                                   | 900                                 | 1 072                            | 0,05                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                     |                                  |                           |
| 3,116 % éch. 19/10/2032                                                                | 300                                 | 267                              | 0,01                      | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                           |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement indonésien |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 11/01/2029                                                                | € 100                               | 116                              | 0,01                      | 0,875 % éch. 15/09/2026                                   | £ 1 600                             | 2 110                            | 0,09                      | 4,500 % éch. 29/05/2033                              | € 4 000                             | 4 629                            | 0,20                      |
| 4,875 % éch. 26/02/2036                                                                | 2 400                               | 2 858                            | 0,13                      | 2,750 % éch. 14/02/2033                                   | € 750                               | 851                              | 0,04                      | IRLANDE                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,389 % éch. 28/05/2031                                                                | \$ 2 500                            | 2 529                            | 0,11                      | 2,750 % éch. 01/04/2033                                   | 2 600                               | 2 948                            | 0,13                      | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                           |                                     |                                  |                           |
| 6,508 % éch. 18/01/2035                                                                | 1 100                               | 1 145                            | 0,05                      | 4,250 % éch. 15/02/2030                                   | £ 2 300                             | 3 047                            | 0,13                      | Aqueduct European CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 6,915 % éch. 14/01/2046                                                                | 2 250                               | 2 344                            | 0,10                      | 4,875 % éch. 03/02/2031                                   | 2 400                               | 3 253                            | 0,14                      | 3,511 % éch. 15/07/2039 (b)                          | 2 200                               | 2 515                            | 0,11                      |
| Carmila S.A.                                                                           |                                     |                                  |                           | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen |                                     |                                  |                           | Arbour CLO DAC                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 13/01/2033                                                                | € 900                               | 1 014                            | 0,04                      | 1,000 % éch. 26/05/2042                                   | € 1 700                             | 1 680                            | 0,07                      | 3,433 % éch. 15/11/2037                              | 900                                 | 1 030                            | 0,04                      |
| Crédit Agricole Assurances S.A.                                                        |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 26/05/2044                                   | 900                                 | 1 046                            | 0,05                      | Ares European CLO DAC                                |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 06/10/2031                                                                | 3 100                               | 3 195                            | 0,14                      | Robert Bosch GmbH                                         |                                     |                                  |                           | 3,234 % éch. 21/10/2034                              | 206                                 | 237                              | 0,01                      |
| Crédit Agricole S.A.                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 21/05/2036                                   | 3 300                               | 3 790                            | 0,17                      | 3,512 % éch. 15/07/2037                              | 2 400                               | 2 746                            | 0,12                      |
| 3,250 % éch. 25/08/2032                                                                | 2 400                               | 2 711                            | 0,12                      | 4,375 % éch. 02/06/2043                                   | 1 000                               | 1 135                            | 0,05                      | Capital Four CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 26/09/2034                                                                | 1 200                               | 1 353                            | 0,06                      | Volkswagen Bank GmbH                                      |                                     |                                  |                           | 3,394 % éch. 15/04/2038                              | 2 000                               | 2 287                            | 0,10                      |
| 3,750 % éch. 23/01/2031                                                                | 3 300                               | 3 823                            | 0,17                      | 3,625 % éch. 26/11/2028                                   | 1 900                               | 2 184                            | 0,10                      | CVC Cordatus Loan Fund DAC                           |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 23/03/2035 (e)(g)                                                         | 1 300                               | 1 528                            | 0,07                      | 4,000 % éch. 26/11/2030                                   | 3 000                               | 3 460                            | 0,15                      | 3,488 % éch. 15/06/2037                              | 3 000                               | 3 434                            | 0,15                      |
| Électricité de France S.A.                                                             |                                     |                                  |                           | Vonovia SE                                                |                                     |                                  |                           | 3,528 % éch. 15/05/2037                              | 1 000                               | 1 146                            | 0,05                      |
| 5,500 % éch. 25/01/2035                                                                | £ 600                               | 781                              | 0,03                      | 3,500 % éch. 06/07/2031 (b)                               | 1 700                               | 1 937                            | 0,09                      | Harvest CLO DAC                                      |                                     |                                  |                           |
| Engie S.A.                                                                             |                                     |                                  |                           | ZF Finance GmbH                                           |                                     |                                  |                           | 3,464 % éch. 15/10/2038                              | 650                                 | 744                              | 0,03                      |
| 6,125 % éch. 16/01/2032 (e)                                                            | 3 300                               | 4 421                            | 0,19                      | 2,250 % éch. 03/05/2028                                   | 1 800                               | 1 996                            | 0,09                      | 3,523 % éch. 25/07/2037 (b)                          | 2 400                               | 2 744                            | 0,12                      |
| Société Générale S.A.                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     | 59 495                           | 2,62                      | Hayfin Emerald CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 01/03/2041                                                                | \$ 1 050                            | 776                              | 0,03                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 3,454 % éch. 15/10/2038                              | 1 400                               | 1 602                            | 0,07                      |
| 7,367 % éch. 10/01/2053                                                                | 2 200                               | 2 371                            | 0,10                      |                                                           |                                     |                                  |                           | Invesco Euro CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| SPIE S.A.                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     |                                  |                           | 3,277 % éch. 15/07/2037                              | 2 800                               | 3 205                            | 0,14                      |
| 3,875 % éch. 18/05/2031                                                                | € 4 400                             | 5 015                            | 0,22                      |                                                           |                                     |                                  |                           | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC          |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     | 77 274                           | 3,39                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 3,414 % éch. 15/07/2039                              | 1 700                               | 1 946                            | 0,09                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | Land de Berlin                                            |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| BPCE Home Loans FCT                                                                    |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 14/02/2033 (i)                               | 2 600                               | 2 936                            | 0,13                      | 3,513 % éch. 15/04/2037                              | 2 500                               | 2 858                            | 0,13                      |
| 2,750 % éch. 31/10/2058                                                                | 3 453                               | 3 954                            | 0,18                      | République d'Allemagne                                    |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 15/02/2035                                   | 13 000                              | 14 521                           | 0,63                      | 3,415 % éch. 20/11/2038                              | 2 700                               | 3 089                            | 0,14                      |
| Action Logement Services                                                               |                                     |                                  |                           | État de Hesse                                             |                                     |                                  |                           | Toro European CLO DAC                                |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 28/09/2037                                                                | 400                                 | 426                              | 0,02                      | 2,875 % éch. 04/07/2033                                   | 1 200                               | 1 364                            | 0,06                      | 3,474 % éch. 15/04/2037                              | 3 000                               | 3 434                            | 0,15                      |
| Caisse Française de Financement Local S.A.                                             |                                     |                                  |                           | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie                       |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     | 33 017                           | 1,45                      |
| 3,250 % éch. 17/04/2035                                                                | 3 900                               | 4 426                            | 0,19                      | 0,500 % éch. 25/11/2039                                   | 200                                 | 159                              | 0,01                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 17/01/2029                                                                | 2 600                               | 3 027                            | 0,13                      | 2,900 % éch. 07/06/2033                                   | 1 975                               | 2 249                            | 0,10                      | BMS Ireland Capital Funding DAC                      |                                     |                                  |                           |
| Île-de-France Mobilités                                                                |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     | 21 229                           | 0,93                      | 4,581 % éch. 10/11/2055                              | 250                                 | 283                              | 0,01                      |
| 3,450 % éch. 25/06/2049                                                                | 1 200                               | 1 185                            | 0,05                      | Total Allemagne                                           |                                     | 80 724                           | 3,55                      | CCEP Finance Ireland DAC                             |                                     |                                  |                           |
| 3,700 % éch. 14/06/2038                                                                | 3 900                               | 4 336                            | 0,19                      | GUERNESEY, ILES ANGLO-NORMANDES                           |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 06/09/2029                              | 1 900                               | 2 010                            | 0,09                      |
| Société Des Grands Projets EPIC                                                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                                     |                                  |                           | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.       |                                     |                                  |                           |
| 3,700 % éch. 25/05/2053                                                                | 2 000                               | 2 007                            | 0,09                      | Globalworth Real Estate Investments Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 24/06/2033                              | \$ 4 400                            | 4 412                            | 0,20                      |
| Société Nationale SNCF S.A.                                                            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/03/2030                                   | 987                                 | 1 152                            | 0,05                      |                                                      |                                     | 6 705                            | 0,30                      |
| 3,625 % éch. 03/04/2035                                                                | 1 400                               | 1 601                            | 0,07                      | HONG KONG                                                 |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                     |                                  |                           |
| Unedic ASSEO                                                                           |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement irlandais  |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 03/06/2041                                                                | 1 500                               | 1 707                            | 0,08                      | Bauhinia Ltd.                                             |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 18/10/2043                              | € 3 000                             | 3 254                            | 0,14                      |
|                                                                                        |                                     | 18 715                           | 0,82                      | 4,919 % éch. 19/10/2045                                   | \$ 5 039                            | 5 032                            | 0,22                      | Total Irlande                                        |                                     | 42 976                           | 1,89                      |
| Total France                                                                           |                                     | 99 943                           | 4,39                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                             |                                     |                                  |                           | ITALIE                                               |                                     |                                  |                           |
| ALLEMAGNE                                                                              |                                     |                                  |                           | MTR Corp. Ltd.                                            |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | 5,582 % éch. 29/01/2038                                   | AUD 2 800                           | 1 940                            | 0,09                      | Intesa Sanpaolo SpA                                  |                                     |                                  |                           |
| Amprion GmbH                                                                           |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                     |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 11/03/2036                              | £ 1 000                             | 1 038                            | 0,04                      |
| 3,125 % éch. 27/08/2030                                                                | 1 400                               | 1 592                            | 0,07                      | Obligation internationale du gouvernement hongkongais     |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,162 % éch. 15/01/2031                                                                | 2 300                               | 2 610                            | 0,11                      | 3,000 % éch. 14/05/2034                                   | € 2 300                             | 2 614                            | 0,11                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 21/05/2031                                                                | 1 800                               | 2 083                            | 0,09                      | Total Hong Kong                                           |                                     | 9 586                            | 0,42                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,850 % éch. 27/08/2039                                                                | 1 700                               | 1 887                            | 0,08                      |                                                           |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,971 % éch. 22/09/2032                                                                | 900                                 | 1 056                            | 0,05                      |                                                           |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,000 % éch. 23/09/2029                            | \$ 1 300                            | \$ 1 271                         | 0,06                      | Bevco Lux SARL                                              |                                     |                                  |                           | Ayvens Bank NV                   |                                     |                                  |                           |
| 4,198 % éch. 01/06/2032                            | 900                                 | 850                              | 0,04                      | 1,000 % éch. 16/01/2030                                     | € 1 900                             | \$ 1 993                         | 0,09                      | 0,250 % éch. 07/09/2026          | € 3 300                             | \$ 3 757                         | 0,17                      |
| 4,950 % éch. 01/06/2042                            | 2 100                               | 1 834                            | 0,08                      | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF             |                                     |                                  |                           | Coöperatieve Rabobank UA         | \$ 1 700                            | 1 690                            | 0,07                      |
| 6,500 % éch. 14/03/2029                            | € 1 000                             | 1 364                            | 0,06                      | 3,500 % éch. 22/09/2032                                     | 5 500                               | 6 154                            | 0,27                      | 3,649 % éch. 06/04/2028          | \$ 1 000                            | 999                              | 0,04                      |
| 6,625 % éch. 31/05/2033                            | 1 100                               | 1 570                            | 0,07                      | 3,875 % éch. 28/05/2031                                     | 1 400                               | 1 608                            | 0,07                      | 3,750 % éch. 21/07/2026          | € 2 000                             | 2 328                            | 0,10                      |
| 6,625 % éch. 20/06/2033                            | \$ 600                              | 651                              | 0,03                      | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 29/06/2029 (e)(g)   | \$ 500                              | 509                              | 0,02                      |
| 7,778 % éch. 20/06/2054                            | 400                                 | 472                              | 0,02                      | European Core Fund                                          |                                     |                                  |                           | CTP NV                           |                                     |                                  |                           |
| Terna - Rete Elettrica Nazionale                   |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 27/01/2028                                     | 600                                 | 659                              | 0,03                      | 1,500 % éch. 27/09/2031          | € 500                               | 511                              | 0,02                      |
| 3,000 % éch. 22/07/2031                            | € 1 000                             | 1 129                            | 0,05                      | 0,900 % éch. 12/10/2029                                     | 3 700                               | 3 909                            | 0,17                      | 3,375 % éch. 19/07/2030          | 2 600                               | 2 955                            | 0,13                      |
| UniCredit SpA                                      |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 27/03/2034                                     | 2 300                               | 2 740                            | 0,12                      | 3,625 % éch. 10/03/2031          | 3 300                               | 3 762                            | 0,17                      |
| 5,459 % éch. 30/06/2035                            | \$ 2 080                            | 2 092                            | 0,09                      | CPI Property Group S.A.                                     |                                     |                                  |                           | Digital Dutch Finco BV           |                                     |                                  |                           |
| 7,296 % éch. 02/04/2034                            | 2 600                               | 2 737                            | 0,12                      | 1,750 % éch. 14/01/2030                                     | 1 550                               | 1 555                            | 0,07                      | 3,875 % éch. 13/09/2033          | 7 500                               | 8 519                            | 0,37                      |
|                                                    |                                     | 15 008                           | 0,66                      | 4,750 % éch. 22/07/2030                                     | 2 500                               | 2 730                            | 0,12                      | Digital Intrepid Holding BV      |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 05/02/2033                                     | € 3 100                             | 3 841                            | 0,17                      | 0,625 % éch. 15/07/2031          | 250                                 | 247                              | 0,01                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | Nova Securitisation SARL                                    |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch. 18/07/2032          | 300                                 | 299                              | 0,01                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                  |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 03/02/2031                                     | \$ 8 200                            | 7 914                            | 0,35                      | DSV Finance BV                   |                                     |                                  |                           |
| 4,050 % éch. 30/10/2037                            | € 3 800                             | 4 487                            | 0,20                      | P3 Group SARL                                               |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 06/11/2028          | 400                                 | 458                              | 0,02                      |
| 4,100 % éch. 30/04/2046                            | 3 660                               | 4 142                            | 0,18                      | 3,375 % éch. 22/03/2031                                     | € 1 100                             | 1 242                            | 0,05                      | 3,250 % éch. 06/11/2030          | 200                                 | 229                              | 0,01                      |
|                                                    |                                     | 8 629                            | 0,38                      | 4,000 % éch. 19/04/2032                                     | 7 375                               | 8 496                            | 0,37                      | 3,375 % éch. 06/11/2032          | 600                                 | 684                              | 0,03                      |
| Total Italie                                       |                                     | 23 637                           | 1,04                      | Prologis International Funding S.A.                         |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 06/11/2034          | 600                                 | 675                              | 0,03                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 07/10/2034                                     | 2 000                               | 2 272                            | 0,10                      | ENEL Finance International NV    |                                     |                                  |                           |
| <b>JAPON</b>                                       |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 01/07/2036                                     | 2 100                               | 2 483                            | 0,11                      | 2,125 % éch. 12/07/2028          | \$ 900                              | 857                              | 0,04                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | Segro Capital SARL                                          |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 12/07/2031          | 3 600                               | 3 208                            | 0,14                      |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.               |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 23/03/2030                                     | 950                                 | 1 035                            | 0,04                      | 7,500 % éch. 14/10/2032          | 600                                 | 672                              | 0,03                      |
| 1,538 % éch. 20/07/2027                            | \$ 1 650                            | 1 648                            | 0,07                      | Total Luxembourg                                            |                                     | 52 465                           | 2,30                      | Flora Food Management BV         |                                     |                                  |                           |
| 2,048 % éch. 17/07/2030                            | 700                                 | 631                              | 0,03                      | <b>ÎLE MAURICE</b>                                          |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 02/07/2029          | € 2 600                             | 2 908                            | 0,13                      |
| 2,494 % éch. 13/10/2032                            | 2 900                               | 2 569                            | 0,11                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 31/10/2030          | 1 800                               | 2 054                            | 0,09                      |
| 3,197 % éch. 10/06/2031                            | € 1 800                             | 2 047                            | 0,09                      | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.                   |                                     |                                  |                           | Iberdrola International BV       |                                     |                                  |                           |
| Mizuho Bank Ltd.                                   |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 25/03/2027                                     | \$ 956                              | 944                              | 0,04                      | 6,750 % éch. 15/09/2033          | \$ 1 200                            | 1 309                            | 0,06                      |
| 4,395 % éch. 16/04/2029                            | \$ 1 900                            | 1 895                            | 0,08                      | India Green Power Holdings                                  |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                     |                                     |                                  |                           |
| Mizuho Financial Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/02/2027                                     | 960                                 | 948                              | 0,04                      | 3,125 % éch. 10/02/2032          | € 4 500                             | 5 074                            | 0,22                      |
| 2,201 % éch. 10/07/2031                            | 2 900                               | 2 618                            | 0,11                      | Total Île Maurice                                           |                                     | 1 892                            | 0,08                      | 5,525 % éch. 25/03/2036          | \$ 4 900                            | 4 978                            | 0,22                      |
| 3,210 % éch. 16/05/2032                            | € 1 200                             | 1 358                            | 0,06                      | <b>MEXIQUE</b>                                              |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 16/11/2032 (e)(g)   | 2 000                               | 2 059                            | 0,09                      |
| 3,261 % éch. 22/05/2030                            | \$ 3 800                            | 3 653                            | 0,16                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | JAB Holdings BV                  |                                     |                                  |                           |
| Nippon Life Insurance Co.                          |                                     |                                  |                           | BBVA Bancomer S.A.                                          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 08/04/2052          | 7 300                               | 5 626                            | 0,25                      |
| 2,900 % éch. 16/09/2051                            | 700                                 | 619                              | 0,03                      | 7,625 % éch. 11/02/2035 (g)                                 | 700                                 | 724                              | 0,03                      | 5,000 % éch. 12/06/2033          | € 200                               | 245                              | 0,01                      |
| Nomura Holdings, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 8,125 % éch. 08/01/2039 (g)                                 | 2 700                               | 2 881                            | 0,13                      | JDE Peet's NV                    |                                     |                                  |                           |
| 2,172 % éch. 14/07/2028                            | 2 600                               | 2 471                            | 0,11                      | Metalsa S.A. de C.V.                                        |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch. 16/06/2033          | 800                                 | 759                              | 0,03                      |
| Norinchukin Bank                                   |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 04/05/2031                                     | 1 700                               | 1 521                            | 0,07                      | 1,375 % éch. 15/01/2027          | \$ 1 482                            | 1 455                            | 0,06                      |
| 1,284 % éch. 22/09/2026                            | 2 000                               | 1 985                            | 0,09                      | Trust 2401                                                  |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 24/09/2031          | 1 358                               | 1 177                            | 0,05                      |
| 2,080 % éch. 22/09/2031                            | 800                                 | 692                              | 0,03                      | 7,375 % éch. 13/02/2034                                     | 938                                 | 997                              | 0,04                      | Lseg Netherlands BV              |                                     |                                  |                           |
| 5,094 % éch. 16/10/2029                            | 5 600                               | 5 640                            | 0,25                      | Trust Fibra Uno                                             |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 06/04/2033          | € 2 700                             | 2 590                            | 0,11                      |
| NTT Finance Corp.                                  |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 13/02/2034                                     | 662                                 | 703                              | 0,03                      | 4,125 % éch. 29/09/2026          | 1 500                               | 1 719                            | 0,08                      |
| 5,171 % éch. 16/07/2032                            | 600                                 | 600                              | 0,03                      | Total Mexique                                               |                                     | 6 826                            | 0,30                      | 4,231 % éch. 29/09/2030          | 2 100                               | 2 495                            | 0,11                      |
| 5,502 % éch. 16/07/2035                            | 1 100                               | 1 107                            | 0,05                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | Nationale-Nederlanden Bank NV    |                                     |                                  |                           |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.              |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain          |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 21/09/2028          | 2 900                               | 3 141                            | 0,14                      |
| 2,472 % éch. 14/01/2029                            | 4 800                               | 4 559                            | 0,20                      | 4,490 % éch. 25/05/2032                                     | € 1 550                             | 1 803                            | 0,08                      | NE Property BV                   |                                     |                                  |                           |
| 4,522 % éch. 12/02/2032                            | 3 900                               | 3 836                            | 0,17                      | 5,375 % éch. 16/05/2040                                     | 4 000                               | 4 606                            | 0,20                      | 2,000 % éch. 20/01/2030          | 4 600                               | 4 977                            | 0,22                      |
| Toyota Motor Corp.                                 |                                     |                                  |                           | 6,338 % éch. 04/05/2053                                     | \$ 2 000                            | 1 879                            | 0,08                      | 3,875 % éch. 30/09/2033          | 4 800                               | 5 441                            | 0,24                      |
| 3,230 % éch. 29/03/2030                            | € 4 000                             | 4 581                            | 0,20                      |                                                             |                                     | 8 288                            | 0,36                      | NN Group NV                      |                                     |                                  |                           |
| 3,714 % éch. 29/06/2034                            | 900                                 | 1 032                            | 0,04                      |                                                             |                                     | 15 114                           | 0,66                      | 4,625 % éch. 13/01/2048          | 200                                 | 232                              | 0,01                      |
|                                                    |                                     | 43 541                           | 1,91                      |                                                             |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 11/09/2034 (e)(g)   | 1 700                               | 1 983                            | 0,09                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 03/11/2043          | 2 100                               | 2 674                            | 0,12                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | Prosus NV                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais |                                     |                                  |                           | <b>PAYS-BAS</b>                                             |                                     |                                  |                           | 3,257 % éch. 19/01/2027          | \$ 2 200                            | 2 179                            | 0,10                      |
| 2,100 % éch. 20/09/2054                            | ¥ 290 000                           | 1 231                            | 0,05                      | <b>TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS</b>                         |                                     |                                  |                           | Sagax Euro MTN NL BV             |                                     |                                  |                           |
| 2,400 % éch. 20/03/2045                            | 808 000                             | 4 194                            | 0,18                      | Bumper NL BV                                                |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 17/05/2029          | € 1 000                             | 1 071                            | 0,05                      |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                            | 1 620 000                           | 7 387                            | 0,33                      | 2,925 % éch. 21/03/2036                                     | € 4 535                             | 5 193                            | 0,23                      | SGS Finance BV                   |                                     |                                  |                           |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                            | 800 000                             | 4 322                            | 0,19                      | 2,955 % éch. 22/03/2035                                     | 932                                 | 1 067                            | 0,05                      | 3,125 % éch. 10/09/2030          | 700                                 | 796                              | 0,03                      |
| Gouvernement de la métropole de Tokyo              |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     | 6 260                            | 0,28                      | Stedin Holding NV                |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 30/04/2031                            | \$ 2 700                            | 2 671                            | 0,12                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 21/10/2035 (e)      | 600                                 | 674                              | 0,03                      |
|                                                    |                                     | 19 805                           | 0,87                      | ABN AMRO Bank NV                                            |                                     |                                  |                           | Stellantis NV                    |                                     |                                  |                           |
| Total Japon                                        |                                     | 63 346                           | 2,78                      | 2,470 % éch. 13/12/2029                                     | \$ 5 700                            | 5 402                            | 0,24                      | 6,250 % éch. 16/03/2031 (e)      | 3 500                               | 3 927                            | 0,17                      |
| <b>LETTONIE</b>                                    |                                     |                                  |                           | Alliander NV                                                |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 16/12/2033 (e)      | 3 150                               | 3 518                            | 0,15                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 30/04/2031                                     | € 2 500                             | 2 867                            | 0,13                      | 8,250 % éch. 16/06/2032 (e)      | € 400                               | 520                              | 0,02                      |
| Latvenergo A/S                                     |                                     |                                  |                           | American Medical Systems Europe BV                          |                                     |                                  |                           | Swisscom Finance BV              |                                     |                                  |                           |
| 4,162 % éch. 25/06/2033                            | € 5 100                             | 5 858                            | 0,26                      | 3,375 % éch. 08/03/2029                                     | 1 100                               | 1 267                            | 0,06                      | 3,625 % éch. 20/05/2035          | € 2 800                             | 3 232                            | 0,14                      |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                  |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 08/03/2032                                     | 1 800                               | 2 071                            | 0,09                      | Tennet Netherlands BV            |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | Arcadis NV                                                  |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 01/04/2036          | 1 500                               | 1 730                            | 0,08                      |
| Acef Holding S.C.A.                                |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 20/05/2031                                     | 6 700                               | 7 698                            | 0,34                      | 4,250 % éch. 28/04/2032          | 1 000                               | 1 202                            | 0,05                      |
| 1,250 % éch. 26/04/2030                            | 1 700                               | 1 792                            | 0,08                      | ASR Nederland NV                                            |                                     |                                  |                           | Universal Music Group NV         |                                     |                                  |                           |
| AXA Logistics Europe Master S.C.A.                 |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 27/12/2031 (e)(g)                              | 2 300                               | 2 821                            | 0,12                      | 4,000 % éch. 13/06/2031          | 1 800                               | 2 117                            | 0,09                      |
| 3,375 % éch. 13/05/2031                            | 1 800                               | 2 042                            | 0,09                      | 7,000 % éch. 07/12/2043                                     | 2 000                               | 2 690                            | 0,12                      | Vesteda Finance BV               |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 18/10/2031          | 5 000                               | 5 049                            | 0,22                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | Volkswagen Financial Services NV |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 04/04/2029          | £ 1 300                             | 1 728                            | 0,08                      |

# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Volkswagen International Finance NV |                                     |                                  |                           |
| 5,994 % éch. 15/11/2033 (e)         | € 1 700                             | \$ 2 001                         | 0,09                      |
| ZF Europe Finance BV                |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 31/01/2029             | 3 100                               | 3 565                            | 0,16                      |
|                                     |                                     | 143 380                          | 6,30                      |

## TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

|                         |       |        |      |
|-------------------------|-------|--------|------|
| Green Lion BV           |       |        |      |
| 2,506 % éch. 23/01/2062 | 500   | 572    | 0,02 |
| 2,588 % éch. 23/10/2060 | 4 600 | 5 262  | 0,23 |
| 2,618 % éch. 23/07/2065 | 4 900 | 5 608  | 0,25 |
| Green Storm BV          |       |        |      |
| 2,541 % éch. 22/02/2071 | 4 700 | 5 368  | 0,23 |
| 2,601 % éch. 22/02/2062 | 4 700 | 5 374  | 0,24 |
|                         |       | 22 184 | 0,97 |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                |        |        |      |
|--------------------------------|--------|--------|------|
| BNG Bank NV                    |        |        |      |
| 2,750 % éch. 11/01/2034        | 3 000  | 3 364  | 0,15 |
| 2,750 % éch. 28/08/2034        | 1 800  | 2 008  | 0,09 |
| 3,000 % éch. 11/01/2033        | 5 000  | 5 725  | 0,25 |
| 3,250 % éch. 29/08/2033        | 14 000 | 16 257 | 0,71 |
| Nederlandse Waterschapsbank NV |        |        |      |
| 2,625 % éch. 10/01/2034        | 2 500  | 2 782  | 0,12 |
| 2,750 % éch. 24/09/2032        | 2 100  | 2 373  | 0,10 |
| 3,000 % éch. 20/04/2033        | 2 900  | 3 320  | 0,15 |
|                                |        | 35 829 | 1,57 |

Total Pays-Bas

|  |  |         |      |
|--|--|---------|------|
|  |  | 207 653 | 9,12 |
|--|--|---------|------|

## NOUVELLE-ZÉLANDE

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                         |       |       |      |
|-------------------------|-------|-------|------|
| Auckland Council        |       |       |      |
| 3,000 % éch. 18/03/2034 | 1 700 | 1 912 | 0,08 |

## NORVÈGE

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                               |         |       |      |
|-------------------------------|---------|-------|------|
| DNB Bank ASA                  |         |       |      |
| 3,000 % éch. 15/01/2031       | 400     | 455   | 0,02 |
| 3,125 % éch. 20/05/2031       | 700     | 796   | 0,03 |
| 3,625 % éch. 28/05/2032       | 1 800   | 2 082 | 0,09 |
| 4,625 % éch. 01/11/2029       | 700     | 828   | 0,04 |
| 5,000 % éch. 23/07/2032       | £ 1 300 | 1 723 | 0,08 |
| PPI Public Property Invest AB |         |       |      |
| 4,125 % éch. 21/04/2033       | € 200   | 226   | 0,01 |
| Statkraft A/S                 |         |       |      |
| 3,125 % éch. 13/12/2031       | 500     | 567   | 0,02 |
|                               |         | 6 677 | 0,29 |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                         |       |       |      |
|-------------------------|-------|-------|------|
| Kommunalbanken A/S      |       |       |      |
| 2,625 % éch. 05/11/2031 | 1 200 | 1 353 | 0,06 |
|                         |       | 8 030 | 0,35 |

## PÉROU

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                              |           |     |      |
|----------------------------------------------|-----------|-----|------|
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |           |     |      |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                      | PEN 2 500 | 785 | 0,03 |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                    |           |       |      |
|----------------------------------------------------|-----------|-------|------|
| Corp. Financiera de Desarrollo S.A.                |           |       |      |
| 5,500 % éch. 06/05/2030                            | \$ 2 000  | 2 032 | 0,09 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien |           |       |      |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                            | PEN 2 500 | 716   | 0,03 |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                            | 2 300     | 710   | 0,03 |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                            | 900       | 296   | 0,02 |
|                                                    |           | 3 754 | 0,17 |
|                                                    |           | 4 539 | 0,20 |

## POLOGNE

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                         |         |       |      |
|-------------------------|---------|-------|------|
| mBank S.A.              |         |       |      |
| 3,771 % éch. 03/03/2032 | € 2 200 | 2 516 | 0,11 |
| ORLEN S.A.              |         |       |      |
| 3,625 % éch. 02/07/2032 | 1 900   | 2 166 | 0,10 |
|                         |         | 4 682 | 0,21 |

| DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ROUMANIE</b>                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                      |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement roumain |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                           | € 2 500                             | \$ 2 597                         | 0,12                      |
| 2,625 % éch. 02/12/2040                           | 3 400                               | 2 629                            | 0,12                      |
| 3,750 % éch. 07/02/2034                           | 900                                 | 931                              | 0,04                      |
| 4,625 % éch. 03/04/2049                           | 100                                 | 91                               | 0,00                      |
| 5,375 % éch. 07/06/2033                           | 2 000                               | 2 310                            | 0,10                      |
| 5,875 % éch. 11/07/2032                           | 1 200                               | 1 439                            | 0,06                      |
| 6,750 % éch. 11/07/2039                           | 900                                 | 1 092                            | 0,05                      |
| Total Roumanie                                    |                                     | 11 089                           | 0,49                      |

## SERBIE

|                                                 |       |       |      |
|-------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                    |       |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement serbe |       |       |      |
| 4,875 % éch. 06/05/2038                         | 2 400 | 2 748 | 0,12 |

## SINGAPOUR

### TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS

|                                          |          |        |      |
|------------------------------------------|----------|--------|------|
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd. |          |        |      |
| 4,941 % éch. 11/04/2045                  | \$ 6 375 | 6 362  | 0,28 |
| 5,026 % éch. 11/04/2043                  | 4 600    | 4 601  | 0,20 |
|                                          |          | 10 963 | 0,48 |

## OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                             |       |        |      |
|-----------------------------|-------|--------|------|
| United Overseas Bank Ltd.   |       |        |      |
| 3,863 % éch. 07/10/2032 (g) | 4 000 | 3 958  | 0,18 |
|                             |       | 14 921 | 0,66 |

## SLOVÉNIE

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                   |         |       |      |
|---------------------------------------------------|---------|-------|------|
| Obligation internationale du gouvernement slovène |         |       |      |
| 3,125 % éch. 02/07/2035                           | € 4 880 | 5 566 | 0,24 |

## AFRIQUE DU SUD

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                        |            |       |      |
|--------------------------------------------------------|------------|-------|------|
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |            |       |      |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                | ZAR 89 800 | 5 678 | 0,25 |

## CORÉE DU SUD

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                         |          |       |      |
|-------------------------|----------|-------|------|
| KEB Hana Bank           |          |       |      |
| 3,125 % éch. 20/01/2031 | € 900    | 1 032 | 0,05 |
| 5,375 % éch. 23/04/2027 | \$ 1 500 | 1 512 | 0,07 |

## NAVER Corp.

|                         |          |     |      |
|-------------------------|----------|-----|------|
| 3,750 % éch. 21/04/2033 | € 600    | 692 | 0,03 |
| 4,375 % éch. 21/04/2031 | \$ 1 000 | 989 | 0,04 |

## Shinhan Bank Co. Ltd.

|                             |        |       |      |
|-----------------------------|--------|-------|------|
| 3,320 % éch. 29/01/2027     | € 300  | 344   | 0,02 |
| 4,000 % éch. 23/04/2029 (g) | \$ 200 | 196   | 0,01 |
| 4,375 % éch. 13/04/2032 (g) | 2 200  | 2 138 | 0,09 |

## SK Hynix, Inc.

|                         |       |        |      |
|-------------------------|-------|--------|------|
| 6,375 % éch. 17/01/2028 | 3 400 | 3 489  | 0,15 |
|                         |       | 10 392 | 0,46 |

## ESPAGNE

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. |       |       |      |
| 7,750 % éch.                         |       |       |      |
| 14/01/2032 (e)(g)                    | 1 300 | 1 369 | 0,06 |

## Banco Santander S.A.

|                   |       |       |      |
|-------------------|-------|-------|------|
| 3,625 % éch.      |       |       |      |
| 21/03/2029 (e)(g) | € 600 | 666   | 0,03 |
| 4,125 % éch.      |       |       |      |
| 12/11/2027 (e)(g) | 1 000 | 1 144 | 0,05 |

## CaixaBank S.A.

|                         |          |       |      |
|-------------------------|----------|-------|------|
| 0,625 % éch. 21/01/2028 | € 3 000  | 3 390 | 0,15 |
| 5,375 % éch. 14/11/2030 | 100      | 122   | 0,01 |
| 5,402 % éch. 22/04/2037 | \$ 2 400 | 2 377 | 0,10 |

## Cellnex Finance Co. S.A.

|                         |       |     |      |
|-------------------------|-------|-----|------|
| 3,875 % éch. 07/07/2041 | 1 000 | 786 | 0,03 |
|-------------------------|-------|-----|------|

## Iberdrola Finanzas S.A.

|                         |         |       |      |
|-------------------------|---------|-------|------|
| 3,750 % éch. 25/06/2036 | € 1 300 | 1 493 | 0,07 |
|-------------------------|---------|-------|------|

| DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Werfen S.A.             |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 12/02/2032 | € 4 600                             | \$ 5 236                         | 0,23                      |
|                         |                                     | 25 920                           | 1,14                      |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                    |       |        |      |
|----------------------------------------------------|-------|--------|------|
| Adif Alta Velocidad                                |       |        |      |
| 3,500 % éch. 30/04/2032                            | 200   | 233    | 0,01 |
| Junta de Andalucía                                 |       |        |      |
| 3,450 % éch. 30/04/2036                            | 2 000 | 2 293  | 0,10 |
| 3,950 % éch. 30/04/2033                            | 2 500 | 2 995  | 0,13 |
| Junta de Castilla y Leon                           |       |        |      |
| 2,900 % éch. 30/04/2032                            | 4 700 | 5 343  | 0,23 |
| 3,500 % éch. 30/04/2033                            | 1 400 | 1 632  | 0,07 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol |       |        |      |
| 1,000 % éch. 30/07/2042                            | 3 170 | 2 439  | 0,11 |
| 3,200 % éch. 31/10/2035                            | 2 650 | 3 017  | 0,13 |
| Xunta de Galicia                                   |       |        |      |
| 3,296 % éch. 30/04/2031                            | 900   | 1 046  | 0,05 |
|                                                    |       | 18 998 | 0,83 |
|                                                    |       | 44 918 | 1,97 |

## SUPRANATIONALES

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                                                                                |           |        |      |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| Banque Ouest Africaine de Développement                                        |           |        |      |
| 2,750 % éch. 22/01/2033                                                        | 3 800     | 3 718  | 0,17 |
| Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateriel |           |        |      |
| 3,125 % éch. 09/11/2031                                                        | 3 200     | 3 690  | 0,16 |
| Banque européenne d'investissement                                             |           |        |      |
| 0,750 % éch. 15/07/2027                                                        | AUD 2 100 | 1 398  | 0,06 |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement               |           |        |      |
| 3,100 % éch. 14/04/2038                                                        | € 2 900   | 3 258  | 0,14 |
| Association internationale de développement                                    |           |        |      |
| 3,200 % éch. 18/01/2044                                                        | 1 500     | 1 620  | 0,07 |
|                                                                                |           | 13 684 | 0,60 |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                         |       |        |      |
|-------------------------|-------|--------|------|
| Union européenne        |       |        |      |
| 1,250 % éch. 04/02/2043 | 9 800 | 7 825  | 0,35 |
| 3,250 % éch. 04/02/2050 | 2 300 | 2 351  | 0,10 |
| 3,375 % éch. 05/10/2054 | 5 600 | 5 725  | 0,25 |
|                         |       | 15 901 | 0,70 |
|                         |       | 29 585 | 1,30 |

## Total Supranationales

|  |  |  |  |
|--|--|--|--|
|  |  |  |  |
|--|--|--|--|

## SUÈDE

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                               |       |        |      |
|-------------------------------|-------|--------|------|
| Castellum AB                  |       |        |      |
| 3,125 % éch. 02/12/2026 (e)   | 1 400 | 1 587  | 0,07 |
| Ellevio AB                    |       |        |      |
| 3,750 % éch. 14/05/2035       | 1 500 | 1 715  | 0,07 |
| EQT AB                        |       |        |      |
| 0,875 % éch. 14/05/2031       | 2 900 | 2 916  | 0,13 |
| 2,375 % éch. 06/04/2028       | 200   | 226    | 0,01 |
| PPI Public Property Invest AB |       |        |      |
| 3,250 % éch. 21/04/2029       | 2 600 | 2 959  | 0,13 |
| Sagax AB                      |       |        |      |
| 1,125 % éch. 30/01/2027       | 800   | 905    | 0,04 |
| 3,375 % éch. 26/01/2031       | 1 400 | 1 578  | 0,07 |
| 4,000 % éch. 13/03/2032       | 4 500 | 5 185  | 0,23 |
|                               |       | 17 071 | 0,75 |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                   |           |        |      |
|---------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| Kommuninvest Sverige AB                           |           |        |      |
| 3,000 % éch. 20/02/2030                           | 2 000     | 2 307  | 0,10 |
| Obligation internationale du gouvernement suédois |           |        |      |
| 0,125 % éch. 09/09/2030                           | SEK 9 000 | 853    | 0,04 |
|                                                   |           | 3 160  | 0,14 |
|                                                   |           | 20 231 | 0,89 |

## Total Suède

|  |  |  |  |
|--|--|--|--|
|  |  |  |  |
|--|--|--|--|

## SUISSE

### OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

|                         |          |       |      |
|-------------------------|----------|-------|------|
| UBS AG                  |          |       |      |
| 5,650 % éch. 11/09/2028 | \$ 3 300 | 3 380 | 0,15 |
| UBS Group AG            |          |       |      |
| 3,126 % éch. 13/08/2030 | 700      | 665   | 0,03 |

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,194 % éch. 01/04/2031              | \$ 10 350                           | \$ 10 106                        | 0,44                      | 4,041 % éch. 13/03/2028              | \$ 2 790                            | \$ 2 780                         | 0,12                      | United Utilities Water Finance PLC                                                                |                                     |                                  |                           |
| 5,617 % éch. 13/09/2030              | 3 400                               | 3 480                            | 0,15                      | 4,856 % éch. 23/05/2033              | € 1 600                             | 1 949                            | 0,09                      | 3,500 % éch. 27/02/2033                                                                           | € 2 400                             | \$ 2 716                         | 0,12                      |
| 5,959 % éch. 12/01/2034              | 1 400                               | 1 459                            | 0,07                      | 5,402 % éch. 11/08/2033              | \$ 600                              | 608                              | 0,03                      | Vmed O2 UK Financing PLC                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 05/02/2035 (e)(g)       | 2 800                               | 2 813                            | 0,12                      | Informa PLC                          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/07/2031                                                                           | £ 1 000                             | 1 095                            | 0,05                      |
| Total Suisse                         |                                     | 21 903                           | 0,96                      | 3,750 % éch. 29/04/2032              | € 3 400                             | 3 895                            | 0,17                      | 5,625 % éch. 15/04/2032                                                                           | € 2 750                             | 2 771                            | 0,12                      |
| <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>           |                                     |                                  |                           | InterContinental Hotels Group PLC    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/01/2033 (i)                                                                       | \$ 900                              | 763                              | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 08/10/2028              | £ 4 400                             | 5 641                            | 0,25                      | Vodafone Group PLC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC           |                                     |                                  |                           | John Lewis PLC                       |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 04/06/2081                                                                           | 2 659                               | 2 080                            | 0,09                      |
| 5,794 % éch. 30/06/2053              | 2 700                               | 2 677                            | 0,12                      | 4,250 % éch. 18/12/2034              | 300                                 | 338                              | 0,01                      | Wessex Water Services Finance PLC                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Emirates NBD Bank PJSC               |                                     |                                  |                           | Land Securities Capital Markets PLC  |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 19/09/2034                                                                           | £ 3 100                             | 4 133                            | 0,18                      |
| 3,236 % éch. 13/02/2031              | € 2 800                             | 3 140                            | 0,14                      | 4,875 % éch. 15/09/2034 (i)          | 5 000                               | 6 592                            | 0,29                      | Whitbread Group PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,529 % éch. 13/01/2031              | \$ 4 400                            | 4 323                            | 0,19                      | Lloyds Banking Group PLC             |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 31/05/2032                                                                           | 1 200                               | 1 573                            | 0,07                      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC            |                                     |                                  |                           | 2,864 % éch. 12/02/2030              | € 3 500                             | 4 010                            | 0,18                      | Yorkshire Building Society                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,120 % éch. 20/02/2031              | € 600                               | 671                              | 0,03                      | 3,750 % éch. 18/03/2028              | \$ 1 200                            | 1 194                            | 0,05                      | 3,511 % éch. 11/10/2030                                                                           | 2 400                               | 3 053                            | 0,13                      |
| 3,530 % éch. 24/12/2029              | 800                                 | 919                              | 0,04                      | 5,188 % éch. 07/08/2027              | 2 500                               | 2 503                            | 0,11                      | Yorkshire Water Finance PLC                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,789 % éch. 03/06/2031              | \$ 2 400                            | 2 404                            | 0,10                      | 5,985 % éch. 07/08/2027              | 4 900                               | 4 908                            | 0,22                      | 6,000 % éch. 22/07/2033                                                                           | 3 800                               | 5 060                            | 0,22                      |
| Total Émirats arabes unis            |                                     | 14 134                           | 0,62                      | 7,500 % éch. 27/06/2030 (e)(g)       | £ 1 800                             | 2 465                            | 0,11                      | 6,375 % éch. 18/11/2034                                                                           | 3 350                               | 4 554                            | 0,20                      |
| <b>ROYAUME-UNI</b>                   |                                     |                                  |                           | London & Quadrant Housing Trust      |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     | 216 367                          | 9,50                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>    |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 31/03/2032              | 1 400                               | 1 571                            | 0,07                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON ÉMIS<br/>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| Pulse UK PLC                         |                                     |                                  |                           | London Power Networks PLC            |                                     |                                  |                           | Newgate Funding PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,397 % éch. 27/05/2036              | £ 1 063                             | 1 411                            | 0,06                      | 3,837 % éch. 11/06/2037              | € 2 200                             | 2 505                            | 0,11                      | 4,866 % éch. 15/12/2050                                                                           | 806                                 | 1 062                            | 0,05                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           | LSEGA Financing PLC                  |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Affinity Water Finance PLC           |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 06/04/2031              | \$ 1 809                            | 1 632                            | 0,07                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 12/09/2040              | 850                                 | 1 121                            | 0,05                      | 3,200 % éch. 06/04/2041              | 1 000                               | 759                              | 0,03                      | Bon du Trésor britannique                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Anglian Water Osprey Financing PLC   |                                     |                                  |                           | Marex Group PLC                      |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 22/07/2027                                                                           | 4 800                               | 6 188                            | 0,27                      |
| 2,000 % éch. 31/07/2028              | 1 000                               | 1 230                            | 0,05                      | 5,680 % éch. 21/04/2031              | 3 300                               | 3 303                            | 0,14                      | 4,375 % éch. 31/07/2054                                                                           | 30 230                              | 33 725                           | 1,48                      |
| 6,750 % éch. 27/08/2031              | 900                                 | 1 204                            | 0,05                      | Marks & Spencer PLC                  |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     | 39 913                           | 1,75                      |
| Anglian Water Services Financing PLC |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 18/08/2032              | £ 2 300                             | 3 015                            | 0,13                      | Total Royaume-Uni                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 26/10/2029              | 100                                 | 123                              | 0,01                      | Motability Operations Group PLC      |                                     |                                  |                           |                                                                                                   |                                     | 258 753                          | 11,36                     |
| 4,250 % éch. 23/06/2036              | € 4 600                             | 5 266                            | 0,23                      | 1,500 % éch. 20/01/2041              | 400                                 | 298                              | 0,01                      | <b>ÉTATS-UNIS</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 12/09/2044              | £ 2 500                             | 3 122                            | 0,14                      | 3,500 % éch. 17/07/2031              | € 2 300                             | 2 631                            | 0,12                      | <b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Antofagasta PLC                      |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 24/07/2029              | 3 100                               | 3 583                            | 0,16                      | ACREC LLC                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 09/09/2035              | \$ 2 800                            | 2 838                            | 0,12                      | 3,625 % éch. 22/01/2033              | 1 300                               | 1 476                            | 0,06                      | 4,950 % éch. 18/07/2043                                                                           | \$ 2 900                            | 2 900                            | 0,13                      |
| Assura Financing PLC                 |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 24/01/2034              | 3 100                               | 3 553                            | 0,16                      | GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust                                                         |                                     |                                  |                           |
| 1,625 % éch. 30/06/2033              | £ 1 200                             | 1 238                            | 0,05                      | 4,000 % éch. 22/01/2037              | 1 400                               | 1 586                            | 0,07                      | 2,100 % éch. 20/05/2048                                                                           | 2 092                               | 1 689                            | 0,07                      |
| Aviva PLC                            |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 17/06/2035              | 900                                 | 1 048                            | 0,05                      | 4,000 % éch. 20/04/2049                                                                           | 4 198                               | 3 657                            | 0,16                      |
| 4,750 % éch. 28/11/2057              | € 500                               | 586                              | 0,03                      | Nationwide Building Society          |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 20/07/2049                                                                           | 4 906                               | 4 420                            | 0,19                      |
| Barclays PLC                         |                                     |                                  |                           | 5,167 % éch. 12/12/2033              | £ 2 200                             | 2 891                            | 0,13                      | Iskandar Enterprise LLC                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 2,894 % éch. 24/11/2032              | \$ 300                              | 269                              | 0,01                      | NatWest Group PLC                    |                                     |                                  |                           | 5,049 % éch. 17/04/2056                                                                           | 1 600                               | 1 593                            | 0,07                      |
| 3,250 % éch. 12/02/2027              | £ 1 000                             | 1 317                            | 0,06                      | 0,780 % éch. 26/02/2030              | € 1 200                             | 1 288                            | 0,06                      | Switch ABS Issuer LLC                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,521 % éch. 24/02/2032              | \$ 400                              | 391                              | 0,02                      | 2,057 % éch. 09/11/2028              | £ 1 900                             | 2 436                            | 0,11                      | 5,121 % éch. 25/10/2055                                                                           | 8 900                               | 8 774                            | 0,39                      |
| 6,224 % éch. 09/05/2034              | 600                                 | 631                              | 0,03                      | 4,892 % éch. 18/05/2029              | \$ 1 200                            | 1 203                            | 0,05                      |                                                                                                   |                                     | 23 033                           | 1,01                      |
| 7,090 % éch. 06/11/2029              | £ 3 000                             | 4 160                            | 0,18                      | 7,500 % éch.                         | 2 100                               | 2 114                            | 0,09                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                              |                                     |                                  |                           |
| 7,437 % éch. 02/11/2033              | \$ 3 000                            | 3 345                            | 0,15                      | 03/06/2036 (e)(g)                    | £ 300                               | 402                              | 0,02                      | 180 Medical, Inc.                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch.                         |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch.                         |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 08/10/2035                                                                           | 200                                 | 197                              | 0,01                      |
| 15/06/2030 (e)(g)                    | £ 1 200                             | 1 693                            | 0,07                      | 30/09/2035 (e)(g)                    | 1 400                               | 1 916                            | 0,08                      | AES Corp.                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| BCP Modular Services Finance PLC     |                                     |                                  |                           | NatWest Markets PLC                  |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/01/2031                                                                           | 3 800                               | 3 391                            | 0,15                      |
| 6,500 % éch. 10/07/2031              | € 2 900                             | 2 885                            | 0,13                      | 5,899 % éch. 23/08/2028              | AUD 900                             | 632                              | 0,03                      | 5,450 % éch. 01/06/2028                                                                           | 2 740                               | 2 771                            | 0,12                      |
| Berkeley Group PLC                   |                                     |                                  |                           | Ocado Group PLC                      |                                     |                                  |                           | Alcon Finance Corp.                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 11/08/2031              | £ 4 050                             | 4 612                            | 0,20                      | 11,000 % éch. 15/06/2030 (i)         | £ 1 300                             | 1 822                            | 0,08                      | 3,000 % éch. 23/09/2029                                                                           | 1 900                               | 1 802                            | 0,08                      |
| British Telecommunications Ltd.      |                                     |                                  |                           | Peabody Trust                        |                                     |                                  |                           | Ally Financial, Inc.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 03/12/2055              | 1 200                               | 1 612                            | 0,07                      | 2,750 % éch. 02/03/2034              | 500                                 | 551                              | 0,02                      | 6,184 % éch. 26/07/2035                                                                           | 2 500                               | 2 542                            | 0,11                      |
| Brookfield Finance UK PLC            |                                     |                                  |                           | Places for People Treasury PLC       |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/11/2031                                                                           | 300                                 | 334                              | 0,01                      |
| 2,340 % éch. 30/01/2032              | \$ 3 000                            | 2 634                            | 0,12                      | 6,250 % éch. 06/12/2041              | 1 700                               | 2 229                            | 0,10                      | Alphabet, Inc.                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Burberry Group PLC                   |                                     |                                  |                           | Santander UK Group Holdings PLC      |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 06/11/2038                                                                           | € 3 700                             | 4 092                            | 0,18                      |
| 5,750 % éch. 20/06/2030              | £ 4 500                             | 6 031                            | 0,26                      | 3,823 % éch. 03/11/2028              | \$ 5 900                            | 5 834                            | 0,26                      | 4,000 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Chanel Ceres PLC                     |                                     |                                  |                           | 6,534 % éch. 10/01/2029              | 600                                 | 616                              | 0,03                      | 15/05/2033 (h)                                                                                    | CAD 4 600                           | 3 289                            | 0,14                      |
| 0,500 % éch. 31/07/2026              | € 800                               | 913                              | 0,04                      | 7,482 % éch. 29/08/2029              | £ 1 600                             | 2 231                            | 0,10                      | 4,000 % éch. 06/11/2044                                                                           | € 200                               | 222                              | 0,01                      |
| 1,000 % éch. 31/07/2031              | 2 501                               | 2 528                            | 0,11                      | Severn Trent Utilities Finance PLC   |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 13/11/2032                                                                           | £ 600                               | 785                              | 0,03                      |
| Clarion Funding PLC                  |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 22/02/2033              | 1 900                               | 2 140                            | 0,09                      | Amazon.com, Inc.                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,250 % éch. 13/11/2032              | £ 700                               | 733                              | 0,03                      | 3,875 % éch. 04/08/2035              | € 2 000                             | 2 279                            | 0,10                      | 3,350 % éch. 16/03/2032                                                                           | € 2 600                             | 2 978                            | 0,13                      |
| 1,875 % éch. 22/01/2035              | 200                                 | 200                              | 0,01                      | 4,000 % éch. 05/03/2034              | 4 500                               | 5 218                            | 0,23                      | 4,000 % éch.                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| DS Smith PLC                         |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 04/04/2036              | £ 1 900                             | 2 422                            | 0,11                      | 12/06/2033 (h)                                                                                    | CAD 300                             | 213                              | 0,01                      |
| 4,375 % éch. 27/07/2027              | € 1 300                             | 1 504                            | 0,07                      | 5,875 % éch. 31/07/2038              | 2 600                               | 3 411                            | 0,15                      | 4,550 % éch. 13/03/2033                                                                           | \$ 3 500                            | 3 444                            | 0,15                      |
| DWR Cymru Financing UK PLC           |                                     |                                  |                           | Sibanye-Stillwater UK Financing PLC  |                                     |                                  |                           | American Assets Trust LP                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 08/09/2037              | £ 2 500                             | 3 322                            | 0,15                      | 6,250 % éch. 15/11/2031              | \$ 1 500                            | 1 485                            | 0,07                      | 3,375 % éch. 01/02/2031                                                                           | 400                                 | 366                              | 0,02                      |
| Ferguson Finance PLC                 |                                     |                                  |                           | South Eastern Power Networks PLC     |                                     |                                  |                           | American Homes 4 Rent LP                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 02/06/2030              | \$ 900                              | 848                              | 0,04                      | 4,102 % éch. 17/03/2038              | € 600                               | 694                              | 0,03                      | 5,500 % éch. 01/02/2034                                                                           | 200                                 | 203                              | 0,01                      |
| 4,650 % éch. 20/04/2032              | 2 850                               | 2 801                            | 0,12                      | South West Water Finance PLC         |                                     |                                  |                           | American Tower Corp.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Haleon UK Capital PLC                |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/09/2031              | £ 2 100                             | 2 762                            | 0,12                      | 0,875 % éch. 21/05/2029                                                                           | € 500                               | 536                              | 0,02                      |
| 4,625 % éch. 18/09/2033              | £ 900                               | 1 169                            | 0,05                      | SW Finance PLC                       |                                     |                                  |                           | 0,950 % éch. 05/10/2030                                                                           | 900                                 | 936                              | 0,04                      |
| HSBC Holdings PLC                    |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 14/11/2034              | 3 500                               | 4 650                            | 0,20                      | 1,000 % éch. 15/01/2032                                                                           | 3 100                               | 3 115                            | 0,14                      |
| 1,750 % éch. 24/07/2027              | 3 100                               | 4 108                            | 0,18                      | Thames Water Super Senior Issuer PLC |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 15/10/2030                                                                           | \$ 3 800                            | 3 378                            | 0,15                      |
| 3,973 % éch. 22/05/2030              | \$ 4 300                            | 4 196                            | 0,18                      | 9,750 % éch. 10/10/2027              | 49                                  | 69                               | 0,00                      | 2,100 % éch. 15/06/2030                                                                           | 1 000                               | 904                              | 0,04                      |
|                                      |                                     |                                  |                           | TP ICAP Finance PLC                  |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 15/09/2031                                                                           | 4 800                               | 4 236                            | 0,19                      |
|                                      |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 18/11/2028              | 400                                 | 501                              | 0,02                      | 3,625 % éch. 30/05/2032                                                                           | € 1 200                             | 1 382                            | 0,06                      |
|                                      |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 12/06/2032              | 1 900                               | 2 590                            | 0,11                      |                                                                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                      |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 17/04/2030              | 1 200                               | 1 710                            | 0,08                      |                                                                                                   |                                     |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Amgen, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Citigroup, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 2,650 % éch. 21/10/2032                     | \$ 900                              | \$ 801                           | 0,04                      |
| 5,250 % éch. 02/03/2030              | \$ 4 400                            | \$ 4 484                         | 0,20                      | 4,412 % éch. 31/03/2031                 | \$ 4 100                            | \$ 4 042                         | 0,18                      | 3,102 % éch. 24/02/2033                     | 1 100                               | 997                              | 0,04                      |
| 5,750 % éch. 02/03/2063 (i)          | 1 100                               | 1 067                            | 0,05                      | Comcast Corp.                           |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 25/07/2029                     | £ 400                               | 507                              | 0,02                      |
| Antares Holdings LP                  |                                     |                                  |                           | 3,969 % éch. 01/11/2047                 | 506                                 | 361                              | 0,02                      | 4,017 % éch. 31/10/2038                     | \$ 2 300                            | 2 019                            | 0,09                      |
| 6,625 % éch. 10/06/2031              | 2 850                               | 2 851                            | 0,12                      | 3,999 % éch. 01/11/2049                 | 967                                 | 686                              | 0,03                      | 5,536 % éch. 28/01/2036                     | 10 000                              | 10 160                           | 0,45                      |
| Apple, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 4,049 % éch. 01/11/2052                 | 1 320                               | 926                              | 0,04                      | Golub Capital BDC, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| 3,600 % éch. 31/07/2042              | £ 647                               | 681                              | 0,03                      | 5,500 % éch. 15/05/2064                 | 2 000                               | 1 712                            | 0,07                      | 7,050 % éch. 05/12/2028                     | 4 100                               | 4 213                            | 0,18                      |
| Ares Capital Corp.                   |                                     |                                  |                           | CommonSpirit Health                     |                                     |                                  |                           | Goodman U.S. Finance Five LLC               |                                     |                                  |                           |
| 5,100 % éch. 15/01/2031              | \$ 2 800                            | 2 710                            | 0,12                      | 2,782 % éch. 01/10/2030                 | 600                                 | 553                              | 0,02                      | 4,625 % éch. 04/05/2032                     | 4 100                               | 3 993                            | 0,18                      |
| Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | Community Preservation Corp.            |                                     |                                  |                           | Great-West Lifeco Finance LP                |                                     |                                  |                           |
| 3,600 % éch. 15/09/2051              | 1 000                               | 694                              | 0,03                      | 2,867 % éch. 01/02/2030                 | 1 225                               | 1 135                            | 0,05                      | 4,047 % éch. 17/05/2028                     | 500                                 | 495                              | 0,02                      |
| Astrazeneca Finance LLC              |                                     |                                  |                           | Continental Wind LLC                    |                                     |                                  |                           | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 26/02/2031              | 1 100                               | 1 115                            | 0,05                      | 6,000 % éch. 28/02/2033                 | 1 771                               | 1 788                            | 0,08                      | 5,950 % éch. 15/07/2033                     | 3 600                               | 3 617                            | 0,16                      |
| 5,000 % éch. 26/02/2034              | 1 500                               | 1 515                            | 0,07                      | CVS Health Corp.                        |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/03/2036                     | 750                                 | 740                              | 0,03                      |
| AT&T, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 25/03/2048                 | 600                                 | 530                              | 0,02                      | 6,375 % éch. 01/03/2034                     | 800                                 | 816                              | 0,04                      |
| 3,550 % éch. 15/09/2055              | 246                                 | 159                              | 0,01                      | CVS Pass-Through Trust                  |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/07/2035                     | 40                                  | 42                               | 0,00                      |
| 3,650 % éch. 15/09/2059              | 3 900                               | 2 494                            | 0,11                      | 4,163 % éch. 11/08/2036                 | 92                                  | 86                               | 0,00                      | Hanwha Energy USA Holdings Corp.            |                                     |                                  |                           |
| 3,800 % éch. 01/12/2057              | 600                                 | 401                              | 0,02                      | Discovery Communications LLC            |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 02/07/2028                     | 1 100                               | 1 097                            | 0,05                      |
| 3,850 % éch. 01/06/2060              | 2 200                               | 1 471                            | 0,06                      | 4,875 % éch. 01/04/2043                 | 1 900                               | 1 226                            | 0,05                      | Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp.      |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 30/04/2033              | 1 200                               | 1 175                            | 0,05                      | 5,200 % éch. 20/09/2047                 | 23                                  | 13                               | 0,00                      | 5,000 % éch. 27/07/2028                     | 3 300                               | 3 327                            | 0,15                      |
| 5,250 % éch. 30/10/2036              | 200                                 | 196                              | 0,01                      | Discovery Global Holdings, Inc.         |                                     |                                  |                           | HAT Holdings LLC                            |                                     |                                  |                           |
| Athene Global Funding                |                                     |                                  |                           | 4,279 % éch. 15/03/2032                 | 600                                 | 539                              | 0,02                      | 3,750 % éch. 15/09/2030                     | 3 200                               | 2 990                            | 0,13                      |
| 5,133 % éch. 01/06/2029              | 2 400                               | 2 405                            | 0,11                      | 5,141 % éch. 15/03/2052                 | 1 600                               | 900                              | 0,04                      | HCA, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |
| AutoZone, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Doris Duke Charitable Foundation        |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/06/2029                     | 4 700                               | 4 629                            | 0,20                      |
| 5,125 % éch. 15/06/2030              | 5 100                               | 5 168                            | 0,23                      | 2,345 % éch. 01/07/2050                 | 400                                 | 224                              | 0,01                      | 4,509 % éch. 01/03/2028                     | 8 064                               | 8 096                            | 0,36                      |
| Avangrid, Inc.                       |                                     |                                  |                           | DTE Electric Co.                        |                                     |                                  |                           | 6,100 % éch. 01/04/2064                     | 1 000                               | 995                              | 0,04                      |
| 3,800 % éch. 01/06/2029              | 2 058                               | 2 004                            | 0,09                      | 3,250 % éch. 01/04/2051                 | 1 100                               | 750                              | 0,03                      | Hilton Domestic Operating Co., Inc.         |                                     |                                  |                           |
| Bain Capital Specialty Finance, Inc. |                                     |                                  |                           | Duke Energy Florida LLC                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/09/2031                     | 2 300                               | 2 307                            | 0,10                      |
| 5,950 % éch. 15/03/2030              | 2 900                               | 2 825                            | 0,12                      | 3,000 % éch. 15/12/2051                 | 2 000                               | 1 293                            | 0,06                      | Host Hotels & Resorts LP                    |                                     |                                  |                           |
| Bank of America Corp.                |                                     |                                  |                           | Duke Energy Progress LLC                |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/12/2029                     | 4 300                               | 4 104                            | 0,18                      |
| 1,102 % éch. 24/05/2032              | € 300                               | 308                              | 0,01                      | 3,450 % éch. 15/03/2029                 | 1 300                               | 1 267                            | 0,06                      | 5,700 % éch. 01/07/2034                     | 6 500                               | 6 652                            | 0,29                      |
| 1,734 % éch. 22/07/2027              | \$ 300                              | 300                              | 0,01                      | 5,100 % éch. 15/03/2034                 | 2 450                               | 2 489                            | 0,11                      | IHG Finance LLC                             |                                     |                                  |                           |
| 1,898 % éch. 23/07/2031              | 2 700                               | 2 409                            | 0,11                      | Edison International                    |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 27/09/2031                     | € 2 000                             | 2 289                            | 0,10                      |
| 2,087 % éch. 14/06/2029              | 2 400                               | 2 286                            | 0,10                      | 5,000 % éch. 05/05/2028                 | 500                                 | 501                              | 0,02                      | IQVIA, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |
| 2,299 % éch. 21/07/2032              | 600                                 | 530                              | 0,02                      | 5,250 % éch. 15/11/2028                 | 2 500                               | 2 505                            | 0,11                      | 5,700 % éch. 15/05/2028                     | \$ 1 600                            | 1 627                            | 0,07                      |
| 2,687 % éch. 22/04/2032              | 6 600                               | 5 980                            | 0,26                      | Elevance Health, Inc.                   |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                        |                                     |                                  |                           |
| 2,884 % éch. 22/10/2030              | 1 100                               | 1 038                            | 0,05                      | 2,875 % éch. 15/09/2029                 | 1 812                               | 1 717                            | 0,08                      | 2,545 % éch. 08/11/2032                     | 8 750                               | 7 784                            | 0,34                      |
| 2,972 % éch. 04/02/2033              | 300                                 | 271                              | 0,01                      | 4,950 % éch. 01/11/2031                 | 1 500                               | 1 506                            | 0,07                      | 2,580 % éch. 22/04/2032                     | 7 400                               | 6 671                            | 0,29                      |
| 3,824 % éch. 20/01/2028              | 2 014                               | 2 007                            | 0,09                      | 5,375 % éch. 15/06/2034                 | 4 400                               | 4 470                            | 0,20                      | 3,109 % éch. 22/04/2051                     | 300                                 | 201                              | 0,01                      |
| 4,456 % éch. 06/02/2032              | 600                                 | 590                              | 0,03                      | Eli Lilly & Co.                         |                                     |                                  |                           | 3,588 % éch. 23/01/2036                     | € 3 400                             | 3 846                            | 0,17                      |
| 5,015 % éch. 22/07/2033              | 4 900                               | 4 909                            | 0,22                      | 1,375 % éch. 14/09/2061                 | € 700                               | 394                              | 0,02                      | 4,203 % éch. 23/07/2029                     | \$ 1 800                            | 1 785                            | 0,08                      |
| 5,288 % éch. 25/04/2034              | 700                                 | 710                              | 0,03                      | Equinix Europe Financing Corp. LLC      |                                     |                                  |                           | 4,912 % éch. 25/07/2033                     | 6 200                               | 6 194                            | 0,27                      |
| 5,468 % éch. 23/01/2035              | 4 600                               | 4 692                            | 0,21                      | 3,250 % éch. 19/05/2029                 | 500                                 | 572                              | 0,02                      | 5,294 % éch. 22/07/2035                     | 1 300                               | 1 314                            | 0,06                      |
| 5,511 % éch. 24/01/2036              | 10 000                              | 10 216                           | 0,45                      | 3,250 % éch. 15/03/2031                 | 2 900                               | 3 278                            | 0,14                      | 5,502 % éch. 24/01/2036                     | 4 000                               | 4 090                            | 0,18                      |
| Becton Dickinson & Co.               |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 22/11/2034                 | 1 700                               | 1 901                            | 0,08                      | 5,766 % éch. 22/04/2035                     | 10 000                              | 10 405                           | 0,46                      |
| 3,828 % éch. 07/06/2032              | € 400                               | 465                              | 0,02                      | 4,000 % éch. 19/05/2034                 | 3 900                               | 4 487                            | 0,20                      | 6,087 % éch. 23/10/2029                     | 2 900                               | 2 989                            | 0,13                      |
| Beignet Investor LLC                 |                                     |                                  |                           | Equinix, Inc.                           |                                     |                                  |                           | Kilroy Realty LP                            |                                     |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049              | \$ 20 565                           | 20 990                           | 0,93                      | 2,500 % éch. 15/05/2031                 | \$ 1 600                            | 1 434                            | 0,06                      | 2,650 % éch. 15/11/2033                     | 5 800                               | 4 720                            | 0,21                      |
| Blackstone Holdings Finance Co. LLC  |                                     |                                  |                           | Equitable Financial Life Global Funding |                                     |                                  |                           | 3,050 % éch. 15/02/2030                     | 400                                 | 370                              | 0,02                      |
| 2,850 % éch. 05/08/2051              | 600                                 | 367                              | 0,02                      | 0,600 % éch. 16/06/2028                 | € 1 300                             | 1 415                            | 0,06                      | Kraft Heinz Foods Co.                       |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 22/04/2033              | 900                                 | 952                              | 0,04                      | 1,300 % éch. 12/07/2026                 | \$ 4 450                            | 4 446                            | 0,20                      | 3,500 % éch. 21/05/2031                     | € 1 300                             | 1 482                            | 0,06                      |
| Blue Owl Capital Corp.               |                                     |                                  |                           | Essential Properties LP                 |                                     |                                  |                           | Lazard Group LLC                            |                                     |                                  |                           |
| 6,300 % éch. 15/08/2031              | 200                                 | 199                              | 0,01                      | 2,950 % éch. 15/07/2031                 | 200                                 | 181                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 15/03/2031                     | \$ 2 700                            | 2 801                            | 0,12                      |
| 6,450 % éch. 15/09/2028              | 3 325                               | 3 369                            | 0,15                      | F&G Global Funding                      |                                     |                                  |                           | Leland Stanford Junior University           |                                     |                                  |                           |
| BlueHub Loan Fund, Inc.              |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 11/04/2027                 | 700                                 | 686                              | 0,03                      | 4,146 % éch. 01/08/2030                     | 900                                 | 892                              | 0,04                      |
| 3,099 % éch. 01/01/2030              | 650                                 | 599                              | 0,03                      | Farmers Exchange Capital                |                                     |                                  |                           | 4,679 % éch. 01/03/2035                     | 3 500                               | 3 423                            | 0,15                      |
| BMW U.S. Capital LLC                 |                                     |                                  |                           | 5,454 % éch. 15/10/2054                 | 400                                 | 373                              | 0,02                      | Levi Strauss & Co.                          |                                     |                                  |                           |
| 4,600 % éch. 13/08/2027              | 100                                 | 100                              | 0,00                      | First American Financial Corp.          |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/03/2031 (i)                 | 800                                 | 742                              | 0,03                      |
| Bush Foundation                      |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 15/08/2031                 | 3 600                               | 3 139                            | 0,14                      | Low Income Investment Fund                  |                                     |                                  |                           |
| 2,754 % éch. 01/10/2050              | 375                                 | 233                              | 0,01                      | 4,000 % éch. 15/05/2030                 | 700                                 | 673                              | 0,03                      | 3,711 % éch. 01/07/2029                     | 300                                 | 288                              | 0,01                      |
| Capital One Financial Corp.          |                                     |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC               |                                     |                                  |                           | Mars, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,183 % éch. 30/01/2036              | 2 000                               | 2 047                            | 0,09                      | 4,970 % éch. 06/04/2029                 | 1 200                               | 1 188                            | 0,05                      | 5,200 % éch. 01/03/2035                     | 5 400                               | 5 423                            | 0,24                      |
| 6,377 % éch. 08/06/2034              | 800                                 | 847                              | 0,04                      | 5,125 % éch. 05/11/2026                 | 900                                 | 901                              | 0,04                      | Marsh & McLennan Cos., Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| CBRE Services, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 08/03/2029                 | 200                                 | 202                              | 0,01                      | 4,850 % éch. 15/11/2031                     | 2 100                               | 2 105                            | 0,09                      |
| 2,500 % éch. 01/04/2031              | 1 000                               | 898                              | 0,04                      | 6,532 % éch. 19/03/2032                 | 5 600                               | 5 790                            | 0,25                      | 5,000 % éch. 15/03/2035                     | 4 800                               | 4 755                            | 0,21                      |
| Centene Corp.                        |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 06/03/2030                 | 2 200                               | 2 327                            | 0,10                      | 5,150 % éch. 15/03/2034                     | 1 300                               | 1 311                            | 0,06                      |
| 2,450 % éch. 15/07/2028              | 600                                 | 570                              | 0,02                      | FS KKR Capital Corp.                    |                                     |                                  |                           | McLaren Health Care Corp.                   |                                     |                                  |                           |
| 2,625 % éch. 01/08/2031              | 900                                 | 785                              | 0,03                      | 3,125 % éch. 12/10/2028                 | 1 300                               | 1 224                            | 0,05                      | 4,386 % éch. 15/05/2048                     | 200                                 | 164                              | 0,01                      |
| 3,000 % éch. 15/10/2030              | 7 900                               | 7 154                            | 0,31                      | GA Global Funding Trust                 |                                     |                                  |                           | MidAmerican Energy Co.                      |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/02/2030              | 300                                 | 280                              | 0,01                      | 4,133 % éch. 16/09/2035                 | € 2 000                             | 2 249                            | 0,10                      | 2,700 % éch. 01/08/2052                     | 1 250                               | 770                              | 0,03                      |
| Charles Schwab Corp.                 |                                     |                                  |                           | Gartner, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/04/2050                     | 1 650                               | 1 112                            | 0,05                      |
| 5,853 % éch. 19/05/2034              | 600                                 | 627                              | 0,03                      | 5,600 % éch. 20/11/2035                 | \$ 1 900                            | 1 800                            | 0,08                      | 3,650 % éch. 01/08/2048                     | 4 629                               | 3 445                            | 0,15                      |
| Chpe LLC                             |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.               |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 01/08/2047                     | 1 060                               | 832                              | 0,04                      |
| 5,100 % éch. 30/06/2033              | 2 000                               | 1 995                            | 0,09                      | 1,250 % éch. 07/02/2029                 | € 1 800                             | 1 967                            | 0,09                      | 5,300 % éch. 01/02/2055                     | 4 000                               | 3 765                            | 0,17                      |
| Church & Dwight Co., Inc.            |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 07/12/2027                 | £ 800                               | 1 018                            | 0,04                      | Morgan Stanley                              |                                     |                                  |                           |
| 5,600 % éch. 15/11/2032              | 1 200                               | 1 255                            | 0,05                      | 1,992 % éch. 27/01/2032                 | \$ 5 600                            | 4 927                            | 0,22                      | 1,102 % éch. 29/04/2033                     | € 300                               | 299                              | 0,01                      |
| Citibank N.A.                        |                                     |                                  |                           | 2,615 % éch. 22/04/2032                 | 7 400                               | 6 648                            | 0,29                      | 1,928 % éch. 28/04/2032                     | \$ 8 900                            | 7 740                            | 0,34                      |
| 4,876 % éch. 19/11/2027              | 2 400                               | 2 405                            | 0,11                      | 2,640 % éch. 24/02/2028                 | 1 550                               | 1 531                            | 0,07                      | 3,772 % éch. 24/01/2029                     | 200                                 | 197                              | 0,01                      |
|                                      |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 5,123 % éch. 01/02/2029                     | 7 800                               | 7 848                            | 0,34                      |
|                                      |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 5,587 % éch. 18/01/2036                     | 10 000                              | 10 215                           | 0,45                      |



| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,342 % éch. 18/10/2033             | \$ 6 000                            | \$ 6 398                         | 0,28                      | Public Service Electric & Gas Co.                   |                                     |                                  |                           | Wisconsin Power & Light Co.                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,407 % éch. 01/11/2029             | 300                                 | 311                              | 0,01                      | 3,100 % éch. 15/03/2032                             | \$ 2 550                            | \$ 2 347                         | 0,10                      | 3,950 % éch. 01/09/2032                                              | \$ 2 700                            | \$ 2 571                         | 0,11                      |
| Morgan Stanley Bank N.A.            |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 15/03/2033                             | 1 200                               | 1 190                            | 0,05                      | 4,950 % éch. 01/04/2033                                              | 8 249                               | 8 253                            | 0,36                      |
| 4,447 % éch. 15/10/2027             | 800                                 | 800                              | 0,03                      | Public Storage Operating Co.                        |                                     |                                  |                           | Xylem, Inc.                                                          |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley Finance LLC          |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 20/01/2034                             | € 5 100                             | 5 734                            | 0,25                      | 2,250 % éch. 30/01/2031                                              | 4 080                               | 3 677                            | 0,16                      |
| 6,550 % éch. 05/01/2029             | £ 1 500                             | 1 980                            | 0,09                      | Quanta Services, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 01/06/2036                                              | 4 475                               | 4 560                            | 0,20                      |
| MSCI, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 01/10/2030                             | \$ 3 300                            | 3 071                            | 0,13                      | Yale University                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 15/08/2033             | \$ 1 200                            | 1 058                            | 0,05                      | Rayonier LP                                         |                                     |                                  |                           | 4,701 % éch. 15/04/2032                                              | 3 100                               | 3 125                            | 0,14                      |
| 3,625 % éch. 01/09/2030             | 500                                 | 473                              | 0,02                      | 2,750 % éch. 17/05/2031                             | 2 500                               | 2 247                            | 0,10                      | Zimmer Biomet Holdings, Inc.                                         |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/02/2031             | 200                                 | 189                              | 0,01                      | RD Michigan Property Owner LLC                      |                                     |                                  |                           | 3,518 % éch. 15/12/2032                                              | € 200                               | 228                              | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 15/11/2029             | 100                                 | 97                               | 0,00                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                             | 9 000                               | 8 975                            | 0,39                      |                                                                      | 626 132                             | 27,51                            |                           |
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding |                                     |                                  |                           | Realty Income Corp.                                 |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                               |                                     |                                  |                           |
| 5,450 % éch. 12/12/2028             | 600                                 | 610                              | 0,03                      | 1,750 % éch. 13/07/2033                             | £ 2 000                             | 2 111                            | 0,09                      | Discovery Global Holdings, Inc.                                      |                                     |                                  |                           |
| National Grid North America, Inc.   |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 30/07/2032 (b)                         | € 425                               | 484                              | 0,02                      | TBD % éch. 03/06/2033                                                | \$ 2 100                            | 2 408                            | 0,11                      |
| 3,631 % éch. 03/09/2031             | € 3 100                             | 3 581                            | 0,16                      | RGA Global Funding                                  |                                     |                                  |                           | TBD % éch. 03/06/2033                                                | \$ 981                              | 982                              | 0,04                      |
| 3,917 % éch. 03/06/2035             | 1 900                               | 2 179                            | 0,10                      | 2,700 % éch. 18/01/2029                             | \$ 1 000                            | 951                              | 0,04                      | Virgin Media Bristol LLC                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,061 % éch. 03/09/2036             | 1 800                               | 2 072                            | 0,09                      | SCE Recovery Funding LLC                            |                                     |                                  |                           | 6,967 % éch. 31/03/2031                                              | 600                                 | 534                              | 0,02                      |
| Netflix, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 4,697 % éch. 15/06/2042                             | 1 714                               | 1 691                            | 0,07                      | 6,990 % éch. 31/01/2029                                              | 296                                 | 284                              | 0,01                      |
| 3,875 % éch. 15/11/2029             | 3 200                               | 3 751                            | 0,16                      | ServiceNow, Inc.                                    |                                     |                                  |                           |                                                                      | 4 208                               | 0,18                             |                           |
| Neuberger Berman Group LLC          |                                     |                                  |                           | 1,400 % éch. 01/09/2030                             | 3 200                               | 2 806                            | 0,12                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETTS MUNICIPAUX</b>                            |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 15/04/2045             | \$ 200                              | 173                              | 0,01                      | Solar Star Funding LLC                              |                                     |                                  |                           | Obligations California Health Facilities Financing Authority Revenue |                                     |                                  |                           |
| New York Life Global Funding        |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 30/06/2035                             | 4 509                               | 4 493                            | 0,20                      | Bonds, Series 2022                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 20/04/2029             | 400                                 | 397                              | 0,02                      | Southern California Edison Co.                      |                                     |                                  |                           | 4,190 % éch. 01/06/2037                                              | 2 100                               | 1 965                            | 0,09                      |
| New York State Electric & Gas Corp. |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/06/2031                             | 200                                 | 179                              | 0,01                      | Billets California State General Obligation Notes, Series 2025       |                                     |                                  |                           |
| 2,150 % éch. 01/10/2031             | 400                                 | 351                              | 0,02                      | 2,750 % éch. 01/02/2032                             | 1 700                               | 1 513                            | 0,07                      | 5,100 % éch. 01/09/2035                                              | 750                                 | 762                              | 0,03                      |
| 5,050 % éch. 15/08/2035             | 4 000                               | 3 959                            | 0,17                      | 3,600 % éch. 01/02/2045                             | 3 400                               | 2 453                            | 0,11                      | Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series  |                                     |                                  |                           |
| 5,300 % éch. 15/08/2034             | 2 500                               | 2 525                            | 0,11                      | 3,650 % éch. 01/06/2051                             | 3 500                               | 2 409                            | 0,11                      | 2010                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 5,650 % éch. 15/08/2028             | 600                                 | 611                              | 0,03                      | 3,900 % éch. 01/12/2041                             | 100                                 | 78                               | 0,00                      | 6,630 % éch. 01/02/2035                                              | 1 385                               | 1 447                            | 0,06                      |
| 5,850 % éch. 15/08/2033             | 2 000                               | 2 093                            | 0,09                      | 4,125 % éch. 01/03/2048                             | 4 000                               | 3 018                            | 0,13                      | Obligations University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022        |                                     |                                  |                           |
| Niagara Mohawk Power Corp.          |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 01/02/2027                             | 300                                 | 301                              | 0,01                      | 3,504 % éch. 01/04/2052                                              | 1 300                               | 951                              | 0,04                      |
| 1,960 % éch. 27/06/2030             | 3 300                               | 2 974                            | 0,13                      | 4,875 % éch. 01/03/2049                             | 200                                 | 168                              | 0,01                      | Obligations University of Pittsburgh of the Commonwealth System of   |                                     |                                  |                           |
| 5,783 % éch. 16/09/2052             | 2 690                               | 2 624                            | 0,11                      | 4,950 % éch. 15/09/2031                             | 400                                 | 399                              | 0,02                      | Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017            |                                     |                                  |                           |
| Northern States Power Co.           |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 01/06/2029                             | 600                                 | 606                              | 0,03                      | 3,646 % éch. 15/09/2036                                              | 2 000                               | 1 817                            | 0,08                      |
| 2,250 % éch. 01/04/2031             | 1 000                               | 900                              | 0,04                      | 5,450 % éch. 01/06/2031                             | 400                                 | 408                              | 0,02                      |                                                                      | 6 942                               | 0,30                             |                           |
| 2,600 % éch. 01/06/2051             | 1 432                               | 873                              | 0,04                      | 5,650 % éch. 01/10/2028                             | 361                                 | 368                              | 0,02                      | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                             |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 01/03/2050             | 1 700                               | 1 123                            | 0,05                      | 5,950 % éch. 01/11/2032                             | 3 750                               | 3 907                            | 0,17                      | Freddie Mac                                                          |                                     |                                  |                           |
| Northwestern University             |                                     |                                  |                           | Southwestern Public Service Co.                     |                                     |                                  |                           | 1,137 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,940 % éch. 01/12/2035             | 3 000                               | 3 006                            | 0,13                      | 3,750 % éch. 15/06/2049                             | 600                                 | 443                              | 0,02                      | 25/08/2029 (a)                                                       | 2 074                               | 51                               | 0,00                      |
| NSTAR Electric Co.                  |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 01/06/2052                             | 2 000                               | 1 724                            | 0,08                      | 4,498 % éch. 25/12/2055                                              | 4 734                               | 4 748                            | 0,21                      |
| 3,100 % éch. 01/06/2051             | 275                                 | 182                              | 0,01                      | Starwood Property Trust, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)            |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 15/05/2029             | 1 889                               | 1 826                            | 0,08                      | 6,125 % éch. 01/06/2031                             | 4 200                               | 4 225                            | 0,19                      | 4,000 % éch. 01/12/2052 -                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 15/09/2052             | 3 600                               | 3 224                            | 0,14                      | 7,250 % éch. 01/04/2029                             | 1 000                               | 1 034                            | 0,05                      | 01/07/2053                                                           | 17 399                              | 16 321                           | 0,72                      |
| Nuveen LLC                          |                                     |                                  |                           | Stryker Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/07/2052 -                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/11/2028             | 300                                 | 296                              | 0,01                      | 1,950 % éch. 15/06/2030                             | 2 700                               | 2 445                            | 0,11                      | 01/06/2054                                                           | 55 064                              | 53 080                           | 2,33                      |
| NVR, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 11/09/2032                             | € 1 300                             | 1 484                            | 0,06                      | 5,000 % éch. 01/02/2053 -                                            | 78 700                              | 77 691                           | 3,41                      |
| 3,000 % éch. 15/05/2030             | 700                                 | 657                              | 0,03                      | Synopsys, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | 01/05/2054                                                           |                                     |                                  |                           |
| Oncor Electric Delivery Co. LLC     |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 01/04/2028                             | \$ 200                              | 200                              | 0,01                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA       |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 15/05/2031             | € 4 500                             | 5 193                            | 0,23                      | 5,000 % éch. 01/04/2032                             | 4 700                               | 4 710                            | 0,21                      | 4,500 % éch. 01/08/2056                                              | 12 100                              | 11 582                           | 0,51                      |
| 5,700 % éch. 24/06/2033             | AUD 5 100                           | 3 552                            | 0,16                      | T-Mobile USA, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/09/2056                                              | 21 000                              | 21 382                           | 0,94                      |
| OneMain Finance Corp.               |                                     |                                  |                           | 3,300 % éch. 15/02/2051                             | 900                                 | 587                              | 0,03                      |                                                                      | 184 855                             | 8,12                             |                           |
| 7,125 % éch.                        |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 15/11/2060                             | 300                                 | 194                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                               |                                     |                                  |                           |
| 15/11/2031 (i)                      | \$ 650                              | 664                              | 0,03                      | 4,700 % éch. 15/01/2035                             | 500                                 | 483                              | 0,02                      | Obligations du Trésor américain                                      |                                     |                                  |                           |
| Pacific Gas & Electric Co.          |                                     |                                  |                           | Tapestry, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,700 % éch. 01/04/2053             | 10 756                              | 11 197                           | 0,49                      | 5,500 % éch. 11/03/2035                             | 2 000                               | 2 015                            | 0,09                      | 15/02/2048 (i)                                                       | 20 500                              | 15 099                           | 0,66                      |
| Pacific Life Global Funding         |                                     |                                  |                           | Teachers Insurance & Annuity Association of America |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 2,450 % éch. 11/01/2032             | 2 000                               | 1 772                            | 0,08                      | 4,270 % éch. 15/05/2047                             | 400                                 | 320                              | 0,01                      | 15/08/2048 (i)                                                       | 13 800                              | 10 115                           | 0,45                      |
| 5,692 % éch. 22/04/2031             | AUD 1 700                           | 1 196                            | 0,05                      | Topaz Solar Farms LLC                               |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| Pacific LifeCorp                    |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 30/09/2039                             | 2 664                               | 2 625                            | 0,12                      | 15/08/2042 (i)                                                       | 9 700                               | 8 097                            | 0,36                      |
| 3,350 % éch. 15/09/2050             | \$ 200                              | 137                              | 0,01                      | U.S. Bancorp                                        |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| PacificCorp                         |                                     |                                  |                           | 5,836 % éch. 12/06/2034 (i)                         | 600                                 | 626                              | 0,03                      | 15/11/2042 (i)                                                       | 4 600                               | 4 152                            | 0,18                      |
| 2,900 % éch. 15/06/2052             | 1 000                               | 599                              | 0,03                      | Union Electric Co.                                  |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 01/12/2053             | 1 200                               | 1 077                            | 0,05                      | 5,125 % éch. 15/03/2055                             | 2 600                               | 2 374                            | 0,10                      | 15/02/2055 (i)                                                       | 8 900                               | 8 460                            | 0,37                      |
| Paychex, Inc.                       |                                     |                                  |                           | USAA Capital Corp.                                  |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 15/04/2032             | 400                                 | 405                              | 0,02                      | 2,125 % éch. 01/05/2030                             | 1 000                               | 914                              | 0,04                      | 15/05/2055 (j)                                                       | 13 900                              | 13 486                           | 0,59                      |
| Penn Mutual Life Insurance Co.      |                                     |                                  |                           | Veralto Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 3,800 % éch. 29/04/2061             | 1 800                               | 1 200                            | 0,05                      | 4,150 % éch. 19/09/2031                             | € 300                               | 353                              | 0,02                      | 15/08/2045 (i)                                                       | 9 486                               | 9 416                            | 0,41                      |
| PG&E Recovery Funding LLC           |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 15/01/2032                             | \$ 2 800                            | 2 796                            | 0,12                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)           |                                     |                                  |                           |
| 4,838 % éch. 01/06/2035             | 1 632                               | 1 637                            | 0,07                      | Verizon Communications, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/02/2051                                              | 3 581                               | 1 896                            | 0,09                      |
| Prologis Euro Finance LLC           |                                     |                                  |                           | 2,850 % éch. 03/09/2041                             | 2 050                               | 1 459                            | 0,06                      | 2,375 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 08/02/2034             | € 3 250                             | 3 187                            | 0,14                      | 4,780 % éch. 15/02/2035                             | 1 258                               | 1 217                            | 0,05                      | 15/02/2055 (i)                                                       | 7 728                               | 7 117                            | 0,31                      |
| Prologis LP                         |                                     |                                  |                           | 4,862 % éch. 21/08/2046                             | 2 000                               | 1 741                            | 0,08                      | 2,375 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 15/02/2033             | CAD 3 800                           | 2 700                            | 0,12                      | Vistra Corp.                                        |                                     |                                  |                           | 15/02/2056 (j)                                                       | 7 191                               | 6 631                            | 0,29                      |
| Protective Life Global Funding      |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/12/2026 (e)                         | 1 000                               | 1 009                            | 0,04                      | STRIPS du Trésor américain                                           |                                     |                                  |                           |
| 1,737 % éch. 21/09/2030             | \$ 800                              | 706                              | 0,03                      | VMware LLC                                          |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch.                                                         |                                     |                                  |                           |
| Public Service Co. of Colorado      |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/05/2030                             | 3 000                               | 3 007                            | 0,13                      | 15/05/2046 (c)(j)                                                    | 2 200                               | 811                              | 0,04                      |
| 2,700 % éch. 15/01/2051             | 2 025                               | 1 219                            | 0,05                      | Weyerhaeuser Co.                                    |                                     |                                  |                           |                                                                      | 88 273                              | 3,88                             |                           |
| 3,200 % éch. 01/03/2050             | 827                                 | 557                              | 0,02                      | 4,000 % éch. 15/04/2030                             | 1 100                               | 1 070                            | 0,05                      | Total États-Unis                                                     | 933 443                             | 41,00                            |                           |
| Public Service Co. of Oklahoma      |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/12/2033                             | 70                                  | 77                               | 0,00                      | Total des Valeurs mobilières                                         | \$ 2 304 220                        | 101,20                           |                           |
| 2,200 % éch. 15/08/2031             | 2 800                               | 2 465                            | 0,11                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,150 % éch. 15/08/2051             | 3 900                               | 2 548                            | 0,11                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION                              | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |           |                                  |                           |
| <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |           |                                  |                           |
| PIMCO Funds: Global                      |           |                                  |                           |
| Investors Series plc -                   |           |                                  |                           |
| Fonds PIMCO                              |           |                                  |                           |
| Climate                                  |           |                                  |                           |
| Bond Fund (f)                            | 3 234 468 | 36 122                           | 1,59                      |
| Total des Fonds d'investissement         | \$        | 36 122                           | 1,59                      |

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

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

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Court | 09/2026              | 365                   | \$ (384)                                | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 2 ans septembre       | Long  | 09/2026              | 804                   | 217                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 304                   | (396)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 188                   | (115)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 624                   | (959)                                   | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Long  | 09/2026              | 33                    | 85                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026              | 686                   | 64                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 36                    | (70)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 1 943                 | (304)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 1 558                 | 308                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 389                   | (19)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026              | 278                   | (354)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 1 475                 | 3 292                                   | 0,15                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Court | 09/2026              | 434                   | (572)                                   | (0,02)                 |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 793                                  | 0,03                   |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime    | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | \$ 108,000         | 24/07/2026           | 27                    | \$ (8)   | \$ (2)          | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,500            | 24/07/2026           | 25                    | (9)      | (3)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 109,500            | 24/07/2026           | 32                    | (7)      | (11)            | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026     | 111,000            | 24/07/2026           | 84                    | (22)     | (9)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,250            | 02/07/2026           | 26                    | (4)      | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 02/07/2026           | 56                    | (10)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 02/07/2026           | 26                    | (5)      | (1)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500            | 02/07/2026           | 56                    | (10)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000            | 10/07/2026           | 25                    | (4)      | (2)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750            | 10/07/2026           | 25                    | (4)      | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 17/07/2026           | 33                    | (8)      | (4)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250            | 17/07/2026           | 32                    | (5)      | (7)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 17/07/2026           | 33                    | (7)      | (7)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 17/07/2026           | 32                    | (6)      | (2)             | 0,00                   |
|                                                                                                           |                    |                      |                       | \$ (109) | \$ (50)         | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                                |                    |                      |                       |          | \$ 743          | 0,03                   |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Ally Financial, Inc.               | 5,000 %                 | 20/12/2027         | \$ 1 100                            | \$ (50)                                 | 0,00                   |
| American International Group, Inc. | 1,000                   | 20/12/2026         | 900                                 | (11)                                    | 0,00                   |
| American International Group, Inc. | 1,000                   | 20/12/2027         | 1 000                               | (6)                                     | 0,00                   |
| AT&T, Inc.                         | 1,000                   | 20/06/2028         | 700                                 | 1                                       | 0,00                   |
| British Telecommunications PLC     | 1,000                   | 20/12/2027         | € 300                               | 0                                       | 0,00                   |
| Crédit Agricole S.A.               | 1,000                   | 20/12/2030         | 4 700                               | 32                                      | 0,00                   |
| Ford Motor Credit Co. LLC          | 5,000                   | 20/06/2027         | \$ 600                              | (40)                                    | 0,00                   |
| Goldman Sachs Group, Inc.          | 1,000                   | 20/12/2026         | 3 000                               | (28)                                    | 0,00                   |
| MetLife, Inc.                      | 1,000                   | 20/06/2028         | 1 700                               | 1                                       | 0,00                   |
| MetLife, Inc.                      | 1,000                   | 20/06/2031         | 1 000                               | 6                                       | 0,00                   |
| Oracle Corp.                       | 1,000                   | 20/06/2031         | 3 400                               | 43                                      | 0,00                   |
| Prudential Financial, Inc.         | 1,000                   | 20/12/2030         | 2 000                               | 9                                       | 0,00                   |

| Entité de référence          | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Prudential Financial, Inc.   | 1,000 %              | 20/06/2031      | \$ 1 200                         | \$ 8                              | 0,00                |
| Telefonica Emisiones S.A.    | 1,000                | 20/06/2028      | € 1 000                          | 2                                 | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 2 200                         | (15)                              | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2027      | 700                              | (1)                               | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/06/2028      | 6 700                            | 15                                | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2028      | 1 700                            | 8                                 | 0,00                |
|                              |                      |                 |                                  | \$ (26)                           | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                        | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans         | 5,000 %              | 20/06/2031      | \$ 5 445                         | \$ 244                            | 0,01                |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans         | 1,000                | 20/12/2030      | 24 020                           | 58                                | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans         | 1,000                | 20/06/2031      | 103 340                          | 213                               | 0,01                |
| Indice iTraxx Europe Senior 44 à 5 ans | 1,000                | 20/12/2030      | € 10 400                         | 35                                | 0,00                |
| Indice iTraxx Europe Senior 45 à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 10 200                           | 114                               | 0,01                |
|                                        |                      |                 |                                  | \$ 664                            | 0,03                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 22 070          | \$ (623)                          | (0,03)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,785     | 12/08/2051      | \$ 800            | 57                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030      | 60 000            | (128)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2030      | 31 600            | 321                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,300     | 15/11/2053      | 3 700             | 565                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,363     | 15/11/2049      | 4 700             | 630                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,368     | 15/11/2049      | 2 000             | 267                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,370     | 15/11/2049      | 3 100             | 413                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,375     | 15/11/2049      | 1 900             | 251                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,395     | 15/11/2049      | 4 400             | 568                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,461     | 15/11/2049      | 5 000             | 595                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 25 000            | 2 239                             | 0,10                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,667     | 31/05/2028      | 9 700             | 61                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 03/03/2036      | 2 340             | 53                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 15 073            | 175                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      | 1 350             | 28                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,842     | 04/03/2030      | 3 300             | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2056      | 13 900            | 447                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 14 200            | (157)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 12,867    | 02/01/2031      | 42 200            | (264)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 12,905    | 02/01/2029      | 5 700             | (27)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,291    | 02/01/2029      | 120 900           | (680)                             | (0,03)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,320    | 02/01/2029      | 1 900             | (8)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,899    | 02/01/2031      | 52 600            | (29)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,926    | 04/01/2027      | 12 000            | (19)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,927    | 04/01/2027      | 98 000            | (155)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,035    | 02/01/2031      | 40 500            | 73                                | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,375    | 02/01/2031      | 10 100            | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | 31 700            | (92)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2034      | 3 400             | (7)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 134 600         | (14)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,450     | 05/05/2035      | 1 200             | 50                                | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 84 600            | (921)                             | (0,04)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,550     | 16/04/2035      | 400               | 13                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 2 200             | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 18 760            | (40)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                           | 2,475     | 16/06/2031      | \$ 2 600          | 73                                | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 3 748                          | 0,16                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 4 386                          | 0,19                |

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

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

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

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

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

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

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 4 119                            | \$ 42  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 7 295                            | 50     | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 09/07/2026        | 10 608                           | 98     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 10 572                           | 85     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 275 | \$ 0         | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 4 119                            | \$ (15) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 7 295                            | (16)    | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 09/07/2026        | 10 608                           | (33)    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 10 572                           | (27)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (91) | \$ 0         | 0,00                |

#### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004 %         | 08/07/2026        | 1 300                            | \$ (3)  | \$ (3)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 1 300                            | (3)     | 0            | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,875           | 24/07/2026        | 1 500                            | (4)     | (2)          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,135           | 24/07/2026        | 1 500                            | (4)     | (4)          | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (14) | \$ (9)       | 0,00                |

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                               | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 2 300                         | \$ 11                  | \$ 0                             | \$ 11        | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 4 400                          | \$ 1 012               | \$ (76)                          | \$ 936       | 0,04                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 13 480                           | 2 937                  | (69)                             | 2 868        | 0,13                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 000                            | 453                    | (27)                             | 426          | 0,02                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 4 750                            | 967                    | 44                               | 1 011        | 0,04                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 27 290                           | 5 969                  | (162)                            | 5 807        | 0,26                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 11 338              | \$ (290)                         | \$ 11 048    | 0,49                |

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

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

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |      |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|------|
| AZD          | 07/2026              | AUD                | 26 078               | \$ 18 648             | \$ 581                   | \$ 0                                          | \$ 581                 | 0,03 |
|              | 07/2026              | NZD                | 3 521                | 2 080                 | 77                       | 0                                             | 77                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 876                  | CAD 1 246             | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 1 786                | NZD 3 161             | 12                       | 0                                             | 12                     | 0,00 |
|              | 08/2026              | CAD                | 1 244                | 876                   | 0                        | (2)                                           | (2)                    | 0,00 |
| BOA          | 08/2026              | NZD                | 3 161                | 1 788                 | 0                        | (12)                                          | (12)                   | 0,00 |
|              | 07/2026              | BRL                | 17 431               | 3 420                 | 52                       | 0                                             | 52                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | £                  | 49                   | 65                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | ¥                  | 21 652               | 136                   | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | KRW                | 188 431              | 124                   | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | NOK                | 183                  | 20                    | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 67                   | INR 6 313             | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 09/2026              | INR                | 6 354                | \$ 67                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 09/2026              | \$                 | 317                  | INR 30 100            | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | AUD                | 3 696                | \$ 2 569              | 8                        | 0                                             | 8                      | 0,00 |
| BPS          | 07/2026              | BRL                | 259                  | 50                    | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | CHF                | 168                  | 214                   | 5                        | 0                                             | 5                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | €                  | 14 725               | 16 760                | 0                        | (75)                                          | (75)                   | 0,00 |
|              | 07/2026              | IDR                | 37 885 183           | 2 113                 | 2                        | (1)                                           | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | INR                | 58 177               | 606                   | 0                        | (9)                                           | (9)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | ¥                  | 73 187               | 460                   | 10                       | 0                                             | 10                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | THB                | 16 971               | 518                   | 8                        | (1)                                           | 7                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 45                   | BRL 232               | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 1 632                | INR 155 282           | 8                        | (2)                                           | 6                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 1 182                | KRW 1 810 015         | 0                        | (12)                                          | (12)                   | 0,00 |
|              | 07/2026              | ZAR                | 6 146                | \$ 375                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 09/2026              | IDR                | 8 028 089            | 442                   | 0                        | (3)                                           | (3)                    | 0,00 |
|              | 09/2026              | THB                | 11 083               | 342                   | 6                        | 0                                             | 6                      | 0,00 |
|              | 09/2026              | \$                 | 1 570                | IDR 27 817 098        | 2                        | (30)                                          | (28)                   | 0,00 |
|              | 09/2026              |                    | 323                  | INR 30 694            | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 09/2026              |                    | 90                   | THB 2 937             | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 12/2026              |                    | 237                  | IDR 4 321 950         | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | NZD                | 5 115                | \$ 3 025              | 115                      | 0                                             | 115                    | 0,01 |
|              | 07/2026              | PEN                | 2 876                | 845                   | 6                        | (4)                                           | 2                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | TRY                | 3 412                | 71                    | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 2 646                | TRY 126 271           | 21                       | 0                                             | 21                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | ZAR                | 30 352               | \$ 1 869              | 20                       | 0                                             | 20                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | €                  | 8 179                | 9 533                 | 182                      | 0                                             | 182                    | 0,01 |
|              | 07/2026              | £                  | 1 064                | 1 428                 | 15                       | 0                                             | 15                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | INR                | 78 069               | 827                   | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | PEN                | 1 699                | 495                   | 4                        | (7)                                           | (3)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | SEK                | 49 493               | 5 357                 | 243                      | 0                                             | 243                    | 0,01 |
|              | 07/2026              | \$                 | 10                   | BRL 52                | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 598                  | IDR 10 737 333        | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 806                  | INR 78 069            | 19                       | 0                                             | 19                     | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 49                   | KRW 74 676            | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 225                  | PLN 822               | 0                        | (6)                                           | (6)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | ZAR                | 2 316                | \$ 139                | 0                        | (2)                                           | (2)                    | 0,00 |
|              | 09/2026              | IDR                | 24 134 372           | 1 337                 | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 09/2026              | THB                | 13 761               | 415                   | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00 |
|              | 09/2026              | \$                 | 348                  | IDR 6 212 510         | 0                        | (4)                                           | (4)                    | 0,00 |
|              | 09/2026              |                    | 161                  | INR 15 465            | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 12/2026              |                    | 738                  | IDR 13 424 661        | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | IDR                | 1 619 236            | \$ 91                 | 0                        | 0                                             | 0                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | INR                | 45 987               | 487                   | 2                        | 0                                             | 2                      | 0,00 |
| DUB          | 07/2026              | NOK                | 454                  | 49                    | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 325                  | INR 31 347            | 6                        | 0                                             | 6                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 1 098                | PEN 3 712             | 0                        | (9)                                           | (9)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 225                  | PLN 834               | 0                        | (3)                                           | (3)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | ZAR                | 14 114               | \$ 872                | 12                       | 0                                             | 12                     | 0,00 |
|              | 09/2026              | IDR                | 9 941 333            | 552                   | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 09/2026              | PEN                | 3 724                | 1 098                 | 9                        | 0                                             | 9                      | 0,00 |
|              | 09/2026              | \$                 | 214                  | IDR 3 882 673         | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 09/2026              |                    | 487                  | INR 46 299            | 0                        | (2)                                           | (2)                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | £                  | 142 231              | \$ 191 105            | 2 331                    | 0                                             | 2 331                  | 0,10 |
| FAR          | 07/2026              | INR                | 38 657               | 410                   | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | ¥                  | 9 002                | 57                    | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | SGD                | 9 401                | 7 369                 | 101                      | 0                                             | 101                    | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 405                  | INR 38 657            | 3                        | 0                                             | 3                      | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 3 412                | ¥ 552 080             | 0                        | (15)                                          | (15)                   | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 1 342                | PLN 4 920             | 0                        | (33)                                          | (33)                   | 0,00 |
|              | 07/2026              |                    | 3 043                | SEK 29 524            | 8                        | 0                                             | 8                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | ZAR                | 20 106               | \$ 1 218              | 0                        | (6)                                           | (6)                    | 0,00 |
|              | 08/2026              | ¥                  | 550 635              | 3 412                 | 15                       | 0                                             | 15                     | 0,00 |
|              | 08/2026              | SEK                | 29 471               | 3 043                 | 0                        | (8)                                           | (8)                    | 0,00 |
| GLM          | 09/2026              | \$                 | 198                  | INR 18 968            | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | BRL                | 2 745                | \$ 544                | 13                       | 0                                             | 13                     | 0,00 |
|              | 07/2026              | KRW                | 386 884              | 251                   | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |
|              | 07/2026              | \$                 | 16 550               | BRL 89 592            | 760                      | 0                                             | 760                    | 0,03 |
|              | 07/2026              |                    | 84 260               | CAD 119 901           | 252                      | 0                                             | 252                    | 0,01 |
|              | 07/2026              |                    | 179                  | IDR 3 205 651         | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00 |



# Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |         |        |      |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|---------|--------|------|
| JPM          | 07/2026              | \$                 | 251                  | KRW                   | 386 829                  | \$ 0                                          | \$ (1)                 | \$ (1)  | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | CAD                | 119 731              | \$                    | 84 260                   | 0                                             | (254)                  | (254)   | (0,01) |      |
|              | 08/2026              | \$                 | 256                  | INR                   | 24 575                   | 2                                             | 0                      | 2       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | IDR                | 3 224 424            | \$                    | 179                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | THB                | 15 383               |                       | 477                      | 11                                            | 0                      | 11      | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | \$                 | 997                  | IDR                   | 17 905 933               | 2                                             | (7)                    | (5)     | 0,00   |      |
|              | 09/2026              |                    | 1 048                | INR                   | 100 816                  | 10                                            | 0                      | 10      | 0,00   |      |
|              | 09/2026              |                    | 396                  | MXN                   | 6 896                    | 0                                             | (4)                    | (4)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | AUD                | 112 876              | \$                    | 80 469                   | 2 269                                         | 0                      | 2 269   | 0,10   |      |
|              | 07/2026              | BRL                | 69 315               |                       | 13 470                   | 78                                            | 0                      | 78      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | INR                | 77 842               |                       | 824                      | 2                                             | 0                      | 2       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | KRW                | 119 550              |                       | 77                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 4 778                | CHF                   | 3 746                    | 0                                             | (134)                  | (134)   | (0,01) |      |
|              | 07/2026              |                    | 54                   | £                     | 40                       | 0                                             | (1)                    | (1)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 99                   | IDR                   | 1 770 881                | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 825                  | INR                   | 77 842                   | 0                                             | (3)                    | (3)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 93                   | KRW                   | 142 779                  | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 130                  | NOK                   | 1 285                    | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 1 800                | PLN                   | 6 557                    | 0                                             | (55)                   | (55)    | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 398                  | THB                   | 13 303                   | 3                                             | 0                      | 3       | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | NOK                | 1 286                | \$                    | 130                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | IDR                | 1 780 722            |                       | 99                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | MXN                | 2 406                |                       | 137                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | THB                | 21 080               |                       | 640                      | 5                                             | (4)                    | 1       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | \$                 | 2 366                | INR                   | 225 500                  | 1                                             | (2)                    | (1)     | 0,00   |      |
|              | 09/2026              |                    | 6 980                | MXN                   | 121 324                  | 0                                             | (80)                   | (80)    | 0,00   |      |
|              | 10/2026              |                    | 13 470               | BRL                   | 70 842                   | 0                                             | (78)                   | (78)    | 0,00   |      |
|              | MBC                  | 12/2026            | MXN                  | 432                   | \$                       | 25                                            | 0                      | 0       | 0      | 0,00 |
|              |                      | 12/2026            | \$                   | 613                   | MXN                      | 10 829                                        | 0                      | (2)     | (2)    | 0,00 |
| 07/2026      |                      | AUD                | 469                  | \$                    | 336                      | 11                                            | 0                      | 11      | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | CHF                | 5 805                |                       | 7 411                    | 214                                           | 0                      | 214     | 0,01   |      |
| 07/2026      |                      | €                  | 12 931               |                       | 14 991                   | 207                                           | 0                      | 207     | 0,01   |      |
| 07/2026      |                      | IDR                | 44 221               |                       | 2                        | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | INR                | 46 169               |                       | 489                      | 2                                             | 0                      | 2       | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | ¥                  | 158 692              |                       | 998                      | 22                                            | 0                      | 22      | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | KRW                | 3 243 336            |                       | 2 140                    | 45                                            | 0                      | 45      | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | NOK                | 1 078                |                       | 116                      | 7                                             | 0                      | 7       | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | SEK                | 109                  |                       | 12                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      | \$                 | 80 935               | AUD                   | 117 297                  | 328                                           | 0                      | 328     | 0,01   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 5 544                | €                     | 4 815                    | 0                                             | (39)                   | (39)    | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 1 248                | £                     | 927                      | 0                                             | (17)                   | (17)    | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 754                  | INR                   | 72 658                   | 13                                            | 0                      | 13      | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 42                   | NOK                   | 414                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
| 07/2026      |                      |                    | 1 852                | SEK                   | 18 029                   | 11                                            | 0                      | 11      | 0,00   |      |
| 08/2026      |                      | AUD                | 117 297              | \$                    | 80 884                   | 0                                             | (333)                  | (333)   | (0,01) |      |
| 08/2026      |                      | NOK                | 415                  |                       | 42                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
| 08/2026      |                      | SEK                | 17 997               |                       | 1 852                    | 0                                             | (11)                   | (11)    | 0,00   |      |
| 09/2026      |                      | MXN                | 1 037                |                       | 59                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
| 09/2026      |                      | THB                | 8 460                |                       | 253                      | 0                                             | (3)                    | (3)     | 0,00   |      |
| MYI          |                      | 09/2026            | \$                   | 1 737                 | INR                      | 166 140                                       | 7                      | (2)     | 5      | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            | £                    | 26                    | \$                       | 35                                            | 0                      | 0       | 0      | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            | \$                   | 144                   | €                        | 126                                           | 0                      | 0       | 0      | 0,00 |
| NSL          |                      | 07/2026            |                      | 1 187                 | £                        | 896                                           | 2                      | 0       | 2      | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            |                      | 166                   | IDR                      | 2 967 203                                     | 0                      | 0       | 0      | 0,00 |
|              |                      | 07/2026            |                      | 762                   | INR                      | 73 333                                        | 12                     | 0       | 12     | 0,00 |
| SCX          |                      | 09/2026            | IDR                  | 2 983 844             | \$                       | 166                                           | 1                      | 0       | 1      | 0,00 |
|              | 09/2026              | \$                 | 213                  | IDR                   | 3 792 880                | 0                                             | (3)                    | (3)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | €                  | 1 639                | \$                    | 1 907                    | 33                                            | 0                      | 33      | 0,00   |      |
| SOG          | 07/2026              | PEN                | 1 195                |                       | 349                      | 0                                             | (2)                    | (2)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 229                  | IDR                   | 4 107 431                | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 1 003                | INR                   | 96 158                   | 12                                            | 0                      | 12      | 0,00   |      |
|              | 08/2026              |                    | 637                  |                       | 61 041                   | 5                                             | 0                      | 5       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | IDR                | 9 314 416            | \$                    | 516                      | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | THB                | 5 360                |                       | 166                      | 4                                             | 0                      | 4       | 0,00   |      |
|              | 09/2026              | \$                 | 543                  | IDR                   | 9 755 286                | 0                                             | (3)                    | (3)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | CAD                | 323                  | \$                    | 229                      | 1                                             | 0                      | 1       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | €                  | 631 386              |                       | 736 537                  | 14 674                                        | 0                      | 14 674  | 0,65   |      |
|              | 07/2026              | ¥                  | 289 616              |                       | 1 823                    | 41                                            | 0                      | 41      | 0,00   |      |
| SSB          | 07/2026              | SGD                | 14                   |                       | 11                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | \$                 | 17 817               | AUD                   | 25 822                   | 72                                            | 0                      | 72      | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 39                   | CAD                   | 53                       | 0                                             | (1)                    | (1)     | 0,00   |      |
|              | 07/2026              |                    | 747 013              | €                     | 656 715                  | 3 810                                         | 0                      | 3 810   | 0,17   |      |
|              | 07/2026              |                    | 7 270                | SGD                   | 9 415                    | 9                                             | 0                      | 9       | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | AUD                | 25 822               | \$                    | 17 806                   | 0                                             | (73)                   | (73)    | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | €                  | 656 715              |                       | 748 026                  | 0                                             | (3 802)                | (3 802) | (0,17) |      |
|              | 08/2026              | SGD                | 9 393                |                       | 7 270                    | 0                                             | (9)                    | (9)     | 0,00   |      |
|              | 08/2026              | \$                 | 11                   | SGD                   | 14                       | 0                                             | 0                      | 0       | 0,00   |      |
|              | 07/2026              | CAD                | 122 982              | \$                    | 89 186                   | 2 504                                         | 0                      | 2 504   | 0,11   |      |
| 07/2026      | \$                   | 774                | CAD                  | 1 097                 | 0                        | (1)                                           | (1)                    | 0,00    |        |      |
| 07/2026      |                      | 188 201            | £                    | 142 376               | 767                      | 0                                             | 767                    | 0,03    |        |      |
| 08/2026      | CAD                  | 1 095              | \$                   | 774                   | 1                        | 0                                             | 1                      | 0,00    |        |      |
| 08/2026      | €                    | 7 330              |                      | 8 368                 | 0                        | (23)                                          | (23)                   | 0,00    |        |      |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |    |         |    |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|----|---------|----|---------|--------|
| UAG          | 08/2026           | £               | 142 376           | \$                 | 188 197               | \$                                      | 0                   | \$ | (768)   | \$ | (768)   | (0,03) |
|              | 07/2026           |                 | \$                | 229                | PLN                   | 836                                     | 0                   |    | (6)     |    | (6)     | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             | 53 527 138        | \$                 | 13 871                | 0                                       |                     |    | (1 386) |    | (1 386) | (0,06) |
|              | 09/2026           | THB             | 1 393             |                    | 42                    | 0                                       |                     |    | 0       |    | 0       | 0,00   |
| WST          | 09/2026           | \$              | 180               | MXN                | 3 160                 | 0                                       |                     |    | 0       |    | 0       | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 756             | CHF                | 2 225                 | 3                                       |                     |    | 0       |    | 3       | 0,00   |
|              | 08/2026           | CHF             | 2 217             | \$                 | 2 756                 | 0                                       |                     |    | (3)     |    | (3)     | 0,00   |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$                                      | 30 134              | \$ | (7 363) | \$ | 22 771  | 1,00   |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |        | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|--------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF             | 357    | \$ 442            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$              | 185    | CHF 145           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | CHF             | 5      | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 71 947 | CHF 56 237        | 0                  | (2 231)               | (2 231)                                 | (0,10)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 726    | \$ 911            | 13                 | (1)                   | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 80 459 | CHF 63 011        | 0                  | (2 344)               | (2 344)                                 | (0,10)              |
| MYI          | 08/2026           | CHF             | 34     | \$ 42             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 61 599 | 76 140            | 0                  | (223)                 | (223)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 76 140 | CHF 61 378        | 224                | 0                     | 224                                     | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | CHF             | 125    | \$ 154            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 78 157 | CHF 61 438        | 0                  | (1 993)               | (1 993)                                 | (0,09)              |
| UAG          | 07/2026           | CHF             | 56     | \$ 71             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           |                 | 61 364 | 76 003            | 0                  | (69)                  | (69)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 76 003 | CHF 61 144        | 71                 | 0                     | 71                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |        |                   | \$ 309             | \$ (6 867)            | \$ (6 558)                              | (0,29)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|
| BOA          | 07/2026              | \$ 242             | € 208                | \$ 0                  | \$ (4)                   | \$ (4)                                        | 0,00                   |
| BPS          | 07/2026              | € 1 421            | \$ 1 614             | 0                     | (10)                     | (10)                                          | 0,00                   |
|              | 07/2026              | \$ 397 172         | € 340 915            | 0                     | (7 403)                  | (7 403)                                       | (0,32)                 |
| CBK          | 07/2026              | 11 047             | 9 472                | 0                     | (218)                    | (218)                                         | (0,01)                 |
| FAR          | 07/2026              | € 318 563          | \$ 363 321           | 0                     | (893)                    | (893)                                         | (0,04)                 |
|              | 08/2026              | \$ 363 811         | € 318 563            | 891                   | 0                        | 891                                           | 0,04                   |
| MBC          | 07/2026              | € 347 249          | \$ 394 532           | 87                    | (2 565)                  | (2 478)                                       | (0,11)                 |
|              | 07/2026              | \$ 541             | € 466                | 0                     | (8)                      | (8)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | € 440              | \$ 502               | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              | 08/2026              | \$ 388 907         | € 341 946            | 2 564                 | 0                        | 2 564                                         | 0,11                   |
| SCX          | 07/2026              | 369 746            | 317 808              | 0                     | (6 397)                  | (6 397)                                       | (0,28)                 |
| SOG          | 07/2026              | € 341 965          | \$ 388 986           | 0                     | (1 983)                  | (1 983)                                       | (0,09)                 |
|              | 07/2026              | \$ 396 756         | € 340 113            | 0                     | (7 904)                  | (7 904)                                       | (0,35)                 |
|              | 08/2026              | 389 492            | 341 946              | 1 979                 | 0                        | 1 979                                         | 0,09                   |
| SSB          | 07/2026              | 245                | 215                  | 1                     | 0                        | 1                                             | 0,00                   |
|              | 08/2026              | € 215              | \$ 246               | 0                     | (1)                      | (1)                                           | 0,00                   |
|              |                      |                    |                      | \$ 5 522              | \$ (27 387)              | \$ (21 865)                                   | (0,96)                 |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |          |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|----------|--------|
| AZD          | 07/2026              | \$                 | 49 121               | £                     | 36 589                   | \$ 0                                          | \$ (559)               | \$ (559) | (0,02) |
| BOA          | 07/2026              |                    | 43                   |                       | 32                       | 0                                             | 0                      | 0        | 0,00   |
| BPS          | 07/2026              | £                  | 32 046               | \$                    | 42 263                   | 0                                             | (271)                  | (271)    | (0,01) |
|              | 07/2026              | \$                 | 59 504               | £                     | 44 404                   | 1                                             | (570)                  | (569)    | (0,03) |
|              | 08/2026              |                    | 42 262               |                       | 32 046                   | 271                                           | 0                      | 271      | 0,01   |
| BRC          | 07/2026              | £                  | 849                  | \$                    | 1 122                    | 0                                             | (5)                    | (5)      | 0,00   |
| CBK          | 07/2026              |                    | 352                  |                       | 473                      | 6                                             | 0                      | 6        | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 977                  | £                     | 739                      | 4                                             | 0                      | 4        | 0,00   |
| FAR          | 07/2026              | £                  | 4 162                | \$                    | 5 596                    | 73                                            | 0                      | 73       | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 9                    | £                     | 7                        | 0                                             | 0                      | 0        | 0,00   |
| JPM          | 07/2026              |                    | 55 427               |                       | 41 306                   | 0                                             | (603)                  | (603)    | (0,03) |
| MBC          | 07/2026              | £                  | 139                  | \$                    | 186                      | 2                                             | 0                      | 2        | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 107                  | £                     | 80                       | 0                                             | (1)                    | (1)      | 0,00   |
| NSL          | 07/2026              | £                  | 6 886                | \$                    | 9 062                    | 0                                             | (77)                   | (77)     | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 9 061                | £                     | 6 886                    | 77                                            | 0                      | 77       | 0,00   |

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois<br>de règlement | Devise<br>à livrer | Devise<br>à recevoir | Plus-value<br>latente | (Moins-value)<br>latente | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente nette | En % de<br>l'actif net |    |         |    |        |        |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|----|---------|----|--------|--------|
| SCX          | 07/2026              | £                  | 40 324               | \$                    | 53 418                   | \$                                            | 35                     | \$ | (137)   | \$ | (102)  | 0,00   |
|              | 07/2026              | \$                 | 65                   | £                     | 49                       |                                               | 0                      |    | (1)     |    | (1)    | 0,00   |
|              | 08/2026              |                    | 49 598               |                       | 37 474                   |                                               | 138                    |    | 0       |    | 138    | 0,01   |
| SOG          | 07/2026              | £                  | 37 260               | \$                    | 49 220                   |                                               | 0                      |    | (233)   |    | (233)  | (0,01) |
|              | 08/2026              | \$                 | 49 219               | £                     | 37 260                   |                                               | 233                    |    | 0       |    | 233    | 0,01   |
| SSB          | 07/2026              | £                  | 431                  | \$                    | 569                      |                                               | 0                      |    | (2)     |    | (2)    | 0,00   |
|              | 08/2026              | \$                 | 569                  | £                     | 431                      |                                               | 2                      |    | 0       |    | 2      | 0,00   |
|              |                      |                    |                      | \$                    | 842                      | \$                                            | (2 459)                | \$ | (1 617) |    | (0,07) |        |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |    |          |    |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|----|----------|----|---------|--------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 140 617           | SEK                | 1 300 433             | \$                                      | 0                   | \$ | (6 249)  | \$ | (6 249) | (0,27) |
| BPS          | 07/2026           | SEK             | 10 299            | \$                 | 1 075                 |                                         | 11                  |    | 0        |    | 11      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 244               | SEK                | 2 317                 |                                         | 0                   |    | (5)      |    | (5)     | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           | SEK             | 5 583             | \$                 | 604                   |                                         | 27                  |    | 0        |    | 27      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 23 000            | SEK                | 215 159               |                                         | 0                   |    | (768)    |    | (768)   | (0,03) |
| FAR          | 07/2026           | SEK             | 1 032 342         | \$                 | 106 388               |                                         | 0                   |    | (279)    |    | (279)   | (0,01) |
|              | 08/2026           | \$              | 106 388           | SEK                | 1 030 511             |                                         | 280                 |    | 0        |    | 280     | 0,01   |
| MBC          | 07/2026           | SEK             | 1 570 617         | \$                 | 161 345               |                                         | 11                  |    | (951)    |    | (940)   | (0,04) |
|              | 07/2026           | \$              | 135 189           | SEK                | 1 255 711             |                                         | 1                   |    | (5 443)  |    | (5 442) | (0,24) |
| MYI          | 08/2026           |                 | 160 548           |                    | 1 560 222             |                                         | 950                 |    | 0        |    | 950     | 0,04   |
|              | 07/2026           | SEK             | 10 228            | \$                 | 1 082                 |                                         | 25                  |    | 0        |    | 25      | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 268             | SEK                | 12 244                |                                         | 3                   |    | (6)      |    | (3)     | 0,00   |
| SOG          | 07/2026           |                 | 180 000           |                    | 1 663 495             |                                         | 0                   |    | (8 118)  |    | (8 118) | (0,37) |
| SSB          | 08/2026           |                 | 1 304             |                    | 12 658                |                                         | 6                   |    | 0        |    | 6       | 0,00   |
| UAG          | 07/2026           |                 | 70 285            |                    | 649 109               |                                         | 0                   |    | (3 215)  |    | (3 215) | (0,14) |
|              |                   |                 |                   | \$                 | 1 314                 | \$                                      | (25 034)            | \$ | (23 720) |    | (1,05)  |        |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (19 939) (0,88)

Total des Investissements

\$ 2 325 532 102,13

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (48 490) (2,13)

Actif net

\$ 2 277 042 100,00

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

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

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

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

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Alphabet, Inc.            | 4,000 % | 15/05/2033      | 05/05/2026   | \$ 3 372 | \$ 3 289     | 0,14                |
| Amazon.com, Inc.          | 4,000   | 12/06/2033      | 08/06/2026   | 215      | 213          | 0,01                |
|                           |         |                 |              | \$ 3 587 | \$ 3 502     | 0,15                |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 77 111 \$ (31 décembre 2025 : 25 109 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 14 297 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 360 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de transactions à terme au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 853 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 43 930 \$ (31 décembre 2025 : 43 285 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 32 710 \$ (31 décembre 2025 : 4 870 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 2 277 195                                         | \$ 27 025                                         | \$ 2 304 220        |
| Fonds d'investissement                        | 36 122                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 36 122              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (2 130)                                                                           | (12 680)                                             | 0                                                 | (14 810)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 33 992</b>                                                                  | <b>\$ 2 264 515</b>                                  | <b>\$ 27 025</b>                                  | <b>\$ 2 325 532</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 2 406 554                                         | \$ 18 126                                         | \$ 2 424 680        |
| Fonds d'investissement                        | 35 700                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 35 700              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 787                                                                             | 32 200                                               | 0                                                 | 33 987              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 37 487</b>                                                                  | <b>\$ 2 438 754</b>                                  | <b>\$ 18 126</b>                                  | <b>\$ 2 494 367</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,500 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (593)         | \$ (593)                                 | (0,03)              |
|                                               | 3,520          | 24/06/2026        | 08/09/2026         | (1 215)          | (1 216)                                  | (0,05)              |
|                                               | 3,530          | 24/06/2026        | 08/09/2026         | (675)            | (676)                                    | (0,03)              |
|                                               | 3,600          | 24/06/2026        | 08/09/2026         | (1 031)          | (1 031)                                  | (0,05)              |
| BRC                                           | 1,950          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (6 564)        | (7 511)                                  | (0,33)              |
| JML                                           | 1,550          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (1 488)          | (1 702)                                  | (0,07)              |
|                                               | 3,500          | 29/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | £ (982)          | (1 311)                                  | (0,06)              |
| JPS                                           | 3,710          | 03/06/2026        | 01/07/2026         | \$ (21 311)      | (21 373)                                 | (0,94)              |
|                                               | 3,720          | 08/06/2026        | 06/07/2026         | (10 528)         | (10 553)                                 | (0,46)              |
|                                               | 3,720          | 11/06/2026        | 09/07/2026         | (3 557)          | (3 564)                                  | (0,16)              |
|                                               | 3,720          | 22/06/2026        | 06/07/2026         | (6 925)          | (6 931)                                  | (0,30)              |
|                                               | 3,740          | 23/06/2026        | 07/07/2026         | (8 398)          | (8 405)                                  | (0,37)              |
|                                               | 3,760          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (1 710)          | (1 710)                                  | (0,08)              |
| MYI                                           | 3,250          | 26/05/2026        | 08/07/2026         | £ (216)          | (288)                                    | (0,01)              |
|                                               | 3,490          | 10/04/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (318)         | (321)                                    | (0,01)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | (10 177)         | (10 178)                                 | (0,45)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (77 363)</b>                       | <b>(3,40)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                                             | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                                                      | 3,720 %        | 04/06/2026        | 02/07/2026      | \$ (13 397)      | \$ (13 435)                                                                        | (0,59)              |
|                                                                          | 3,760          | 24/06/2026        | 01/07/2026      | (806)            | (806)                                                                              | (0,04)              |
| <b>Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (14 241)</b>                                                                 | <b>(0,63)</b>       |

<sup>(1)</sup> Le montant à payer sur opération de financement par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 \$ de baisse de prix différée.

## Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 99                                                      | \$ 30                   | \$ 129                            | \$ 1 861                                                   | \$ (2 040)              | \$ (179)                          |
| BOA          | (5 249)                                                    | 5 820                   | 571                               | 1 236                                                      | (1 220)                 | 16                                |
| BPS          | (5 198)                                                    | 5 740                   | 542                               | 2 425                                                      | (2 430)                 | (5)                               |
| BRC          | 152                                                        | (150)                   | 2                                 | 6 755                                                      | (7 450)                 | (695)                             |
| CBK          | (76)                                                       | 0                       | (76)                              | 640                                                        | (510)                   | 130                               |
| DUB          | 20                                                         | 0                       | 20                                | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |
| FAR          | 2 471                                                      | (2 740)                 | (269)                             | (15)                                                       | 0                       | (15)                              |
| GLM          | 783                                                        | (770)                   | 13                                | 851                                                        | (1 010)                 | (159)                             |
| GST          | 1 011                                                      | (960)                   | 51                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 4 966                                                      | (5 250)                 | (284)                             | 3 485                                                      | (3 510)                 | (25)                              |
| MBC          | (7 224)                                                    | 7 920                   | 696                               | 8 846                                                      | (9 510)                 | (664)                             |
| MYC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| MYI          | 24                                                         | 20                      | 44                                | (6)                                                        | 20                      | 14                                |
| NSL          | 10                                                         | 0                       | 10                                | 6 118                                                      | (6 800)                 | (682)                             |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 7                                                          | 0                       | 7                                 |
| SCX          | (6 313)                                                    | 6 750                   | 437                               | (21)                                                       | 30                      | 9                                 |
| SOG          | (1 303)                                                    | 1 660                   | 357                               | (4 737)                                                    | 4 800                   | 63                                |
| SSB          | 492                                                        | (530)                   | (38)                              | 1 293                                                      | (1 540)                 | (247)                             |
| UAG          | (4 606)                                                    | 4 770                   | 164                               | 61                                                         | 0                       | 61                                |
| WST          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | (12)                                                       | 20                      | 8                                 |

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

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 64,93            | 70,18                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 23,02            | 21,69                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,35             | 0,43                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,40             | 1,36                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,15             | 0,11                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,30             | 0,27                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,91             | 1,90                 |
| Autres actifs                                                    | 6,94             | 4,06                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 4,21             | 2,28                 |
| Autriche                          | 0,19             | 0,05                 |
| Belgique                          | 0,66             | 0,78                 |
| Bésil                             | 0,38             | 0,25                 |
| Canada                            | 3,88             | 3,60                 |
| Îles Caïmans                      | 0,20             | 0,02                 |
| Chili                             | 0,72             | 0,41                 |
| Colombie                          | 0,96             | 0,46                 |
| Costa Rica                        | 0,28             | 0,24                 |
| République tchèque                | 0,33             | 0,30                 |
| Danemark                          | 0,63             | 0,74                 |
| Finlande                          | 0,07             | 0,32                 |
| France                            | 4,39             | 5,01                 |
| Allemagne                         | 3,55             | 3,83                 |
| Guernesey, Îles Anglo-Normandes   | 0,05             | 0,27                 |
| Hong Kong                         | 0,42             | 0,38                 |
| Hongrie                           | 0,33             | 0,29                 |
| Inde                              | 0,46             | 0,15                 |
| Indonésie                         | 0,20             | 0,03                 |
| Irlande                           | 1,89             | 1,03                 |
| Italie                            | 1,04             | 1,22                 |
| Japon                             | 2,78             | 2,63                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | S/O              | 0,18                 |
| Lettonie                          | 0,26             | S/O                  |
| Luxembourg                        | 2,30             | 1,82                 |
| Île Maurice                       | 0,08             | 0,08                 |
| Mexique                           | 0,66             | 0,62                 |
| Multinationales                   | S/O              | 0,01                 |
| Pays-Bas                          | 9,12             | 8,97                 |
| Nouvelle-Zélande                  | 0,08             | 0,08                 |
| Norvège                           | 0,35             | 0,44                 |



| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Pérou                                                                                                    | 0,20             | 0,15                 |
| Pologne                                                                                                  | 0,21             | 0,19                 |
| Roumanie                                                                                                 | 0,49             | 0,47                 |
| Serbie                                                                                                   | 0,12             | 0,02                 |
| Singapour                                                                                                | 0,66             | 0,70                 |
| Slovénie                                                                                                 | 0,24             | 0,23                 |
| Afrique du Sud                                                                                           | 0,25             | 0,12                 |
| Corée du Sud                                                                                             | 0,46             | 0,71                 |
| Espagne                                                                                                  | 1,97             | 1,96                 |
| Supranationales                                                                                          | 1,30             | 1,76                 |
| Suède                                                                                                    | 0,89             | 0,77                 |
| Suisse                                                                                                   | 0,96             | 0,99                 |
| Émirats arabes unis                                                                                      | 0,62             | 0,03                 |
| Royaume-Uni                                                                                              | 11,36            | 11,72                |
| États-Unis                                                                                               | 41,00            | 40,13                |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 1,59             | 1,42                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,03             | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,03             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,16             | 0,21                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,49             | 0,27                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 1,00             | (0,79)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (2,37)           | 1,65                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (2,13)           | 0,79                 |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund

| DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                      |                                     |                                  |                           | FRANCE                                                                   |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                                                                 |                                     |                                  |                           |
| AUSTRALIE                                                                               |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                              |                                     |                                  |                           | 3,468 % éch. 20/10/2039 € 5 100 \$ 5 835 0,27                                    |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | Auto ABS French Loans 2,829 % éch. 24/07/2036 € 1 777 \$ 2 033 0,10      |                                     |                                  |                           | 3,478 % éch. 20/07/2036 1 500 1 716 0,08                                         |                                     |                                  |                           |
| Project Cashmere                                                                        |                                     |                                  |                           | Bavarian Sky S.A. 2,846 % éch. 20/08/2032 4 359 4 991 0,23               |                                     |                                  |                           | Palmer Square European Loan Funding DAC 3,054 % éch. 15/10/2034 2 756 3 150 0,15 |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (a) AUD 25 000 \$ 17 263 0,81                                   |                                     |                                  |                           | Cars Alliance Auto Loans France 2,885 % éch. 23/10/2034 1 897 2 171 0,10 |                                     |                                  |                           | 3,253 % éch. 15/08/2033 2 231 2 554 0,12                                         |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           | FCT Noria 2,812 % éch. 25/07/2043 4 700 5 373 0,25                       |                                     |                                  |                           | 3,273 % éch. 15/05/2034 1 597 1 828 0,09                                         |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement australien                                    |                                     |                                  |                           | Red & Black Auto Lease France 2,513 % éch. 27/06/2039 2 343 2 680 0,13   |                                     |                                  |                           | 3,433 % éch. 15/02/2035 5 867 6 712 0,32                                         |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 21/11/2027 14 323 9 844 0,46                                               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC 3,415 % éch. 20/11/2038 3 500 4 004 0,19                        |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 21/06/2031 56 900 34 373 1,61                                              |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           | Sculptor European CLO DAC 3,254 % éch. 15/10/2034 2 892 3 312 0,16               |                                     |                                  |                           |
| New South Wales Treasury Corp.                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           | St. Paul's CLO DAC 2,995 % éch. 25/04/2030 3 363 3 847 0,18                      |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 20/03/2034 8 700 4 753 0,22                                                |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           | Tikehau CLO DAC 3,404 % éch. 15/10/2038 1 200 1 374 0,06                         |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 08/03/2033 14 500 8 370 0,39                                               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           | Trinitas Euro CLO DAC 3,414 % éch. 15/07/2039 2 600 2 978 0,14                   |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 20/09/2035 4 000 2 673 0,13                                                |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Queensland Treasury Corp.                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 22/08/2033 11 400 6 479 0,31                                               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Total Australie 83 755 3,93                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| CANADA                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien                                    |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 01/12/2026 (b) CAD 2 869 2 055 0,10                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| CHILI                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement chilien                                       |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 09/07/2031 € 3 800 4 438 0,21                                              |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| COLOMBIE                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                                     |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 21/01/2031 \$ 400 404 0,02                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 26/11/2038 € 1 800 2 167 0,10                                              |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Total Colombie 2 571 0,12                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| DANEMARK                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Jyske Realkredit A/S                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 01/10/2053 DKK 0 0 0,00                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 3 1 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 01/10/2043 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 12 2 0,00                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/10/2056 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Nykredit Realkredit A/S                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2056 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2052 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 2 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/04/2053 2 588 385 0,02                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/10/2056 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Realkredit Danmark A/S                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 01/10/2056 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/04/2047 8 1 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/10/2056 0 0 0,00                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Total Danemark 389 0,02                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| E-Carat DE                                                                                     |                                     |                                  |                           | BBVA Consumer Auto                                                                             |                                     |                                  |                           | RMAC Securities PLC                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,919 % éch. 25/05/2034                                                                        | € 7 200                             | \$ 8 249                         | 0,39                      | 2,879 % éch. 19/05/2042                                                                        | € 4 089                             | \$ 4 680                         | 0,22                      | 4,016 % éch. 12/06/2044                                                                        | £ 897                               | \$ 1 181                         | 0,06                      |
| FACT S.A.                                                                                      |                                     |                                  |                           | BBVA Consumer FTA                                                                              |                                     |                                  |                           | Rochester Financing PLC                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 2,935 % éch. 22/09/2031                                                                        | 1 613                               | 1 848                            | 0,09                      | 2,931 % éch. 21/08/2038                                                                        | 5 470                               | 6 265                            | 0,29                      | 5,046 % éch. 18/12/2044                                                                        | 1 291                               | 1 715                            | 0,08                      |
| First Mobility SARL                                                                            |                                     |                                  |                           | FTA Santander Consumo                                                                          |                                     |                                  |                           | Stratton BTL Mortgage Funding PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,809 % éch. 14/10/2032                                                                        | 1 953                               | 2 237                            | 0,10                      | 2,974 % éch. 21/01/2040                                                                        | 7 200                               | 8 256                            | 0,39                      | 4,477 % éch. 20/01/2054                                                                        | 1 060                               | 1 408                            | 0,07                      |
| Pony S.A., Compartment German Auto Loans                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 29 250                           | 1,37                      | Stratton Mortgage Funding PLC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,769 % éch. 14/11/2032                                                                        | 1 916                               | 2 194                            | 0,10                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,896 % éch. 20/06/2060                                                                        | 1 597                               | 2 123                            | 0,10                      |
| SC Germany S.A., Compartment Consumer                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     |                                  |                           | Twin Bridges PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 2,849 % éch. 15/09/2037                                                                        | 1 246                               | 1 428                            | 0,07                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,407 % éch. 12/09/2055                                                                        | 1 221                               | 1 621                            | 0,08                      |
| Total Luxembourg                                                                               |                                     | 19 317                           | 0,91                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 79 850                           | 3,75                      |
| <b>MEXIQUE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement espagnol                                             |                                     |                                  |                           | Bon du Trésor britannique                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                                             |                                     |                                  |                           | 0,650 % éch. 30/11/2027 (b)                                                                    | 12 599                              | 14 379                           | 0,68                      | 0,125 % éch. 10/08/2028 (b)                                                                    | 12 612                              | 16 646                           | 0,78                      |
| 5,625 % éch. 22/09/2035                                                                        | \$ 3 100                            | 3 018                            | 0,14                      | 0,700 % éch. 30/11/2033 (b)                                                                    | 4 785                               | 5 305                            | 0,25                      | 0,125 % éch. 22/03/2029 (b)                                                                    | 19 893                              | 25 974                           | 1,22                      |
| <b>PAYS-BAS</b>                                                                                |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 30/11/2030 (b)                                                                    | 3 682                               | 4 228                            | 0,20                      | 0,125 % éch. 10/08/2031 (b)                                                                    | 15 522                              | 19 764                           | 0,93                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch. 31/10/2036                                                                        | 8 600                               | 9 877                            | 0,46                      | 1,125 % éch. 22/11/2037 (b)                                                                    | 6 555                               | 8 044                            | 0,38                      |
| Bumper NL BV                                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,450 % éch. 31/10/2034                                                                        | 39 600                              | 46 217                           | 2,17                      | 1,250 % éch. 22/11/2032 (b)                                                                    | 51 977                              | 69 749                           | 3,28                      |
| 2,925 % éch. 21/03/2036                                                                        | € 2 156                             | 2 469                            | 0,12                      | 4,200 % éch. 31/01/2037                                                                        | 16 700                              | 20 490                           | 0,96                      | 1,250 % éch. 22/11/2032 (b)                                                                    | 8 205                               | 10 921                           | 0,51                      |
| Hill FL BV                                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 100 496                          | 4,72                      | 2,000 % éch. 26/01/2035                                                                        | 1 869                               | 2 573                            | 0,12                      |
| 2,939 % éch. 18/02/2032                                                                        | 946                                 | 1 082                            | 0,05                      |                                                                                                |                                     | 129 746                          | 6,09                      | 4,000 % éch. 22/10/2031                                                                        | 19 100                              | 24 946                           | 1,17                      |
|                                                                                                |                                     | 3 551                            | 0,17                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 22/07/2029                                                                        | 9 200                               | 12 183                           | 0,57                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>SUPRANATIONALES</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 07/03/2031                                                                        | 13 000                              | 17 126                           | 0,80                      |
| Domi BV                                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 07/03/2030                                                                        | 33 300                              | 44 400                           | 2,09                      |
| 2,892 % éch. 15/02/2057                                                                        | 7 714                               | 8 816                            | 0,41                      | Union européenne                                                                               |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 31/07/2054                                                                        | 2 100                               | 2 343                            | 0,11                      |
| Dutch Property Finance BV                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 05/12/2028                                                                        | 17 000                              | 19 655                           | 0,92                      |                                                                                                |                                     | 254 669                          | 11,96                     |
| 3,063 % éch. 28/04/2064                                                                        | 1 109                               | 1 272                            | 0,06                      | 3,250 % éch. 04/07/2034                                                                        | 5 700                               | 6 598                            | 0,31                      | Total Royaume-Uni                                                                              |                                     | 357 874                          | 16,81                     |
| Jubilee Place BV                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 12/12/2036                                                                        | 9 900                               | 11 264                           | 0,53                      | <b>ÉTATS-UNIS</b>                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 17/10/2061                                                                        | 7 914                               | 9 041                            | 0,43                      | 3,375 % éch. 12/12/2035                                                                        | 10 500                              | 12 178                           | 0,57                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           |
| 3,127 % éch. 18/09/2062                                                                        | 3 019                               | 3 455                            | 0,16                      | 4,000 % éch. 12/10/2055                                                                        | 12 600                              | 14 358                           | 0,68                      | Structured Asset Investment Loan Trust                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     | 22 584                           | 1,06                      | Total Supranationales                                                                          |                                     | 64 053                           | 3,01                      | 4,713 % éch. 25/10/2033                                                                        | \$ 471                              | 474                              | 0,02                      |
| Total Pays-Bas                                                                                 |                                     | 26 135                           | 1,23                      | <b>SUÈDE</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC                                                                 |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement suédois                                              |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                                                                        | 4 000                               | 3 989                            | 0,19                      |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais                                        |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 01/12/2027 SEK                                                                    | 5 495                               | 561                              | 0,03                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 20/09/2030 NZD                                                                    | 1 388                               | 837                              | 0,04                      | 0,125 % éch. 01/06/2039                                                                        | 34 801                              | 3 238                            | 0,15                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 20/09/2050                                                                        | 3 800                               | 2 282                            | 0,11                      | Total Suède                                                                                    |                                     | 3 799                            | 0,18                      | 4,234 % éch. 19/04/2035                                                                        | 155                                 | 152                              | 0,01                      |
| Total Nouvelle-Zélande                                                                         |                                     | 3 119                            | 0,15                      | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                                                                     |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>POLOGNE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           | 4,343 % éch. 25/07/2045                                                                        | 288                                 | 278                              | 0,01                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/07/2045                                                                        | 56                                  | 54                               | 0,00                      |
| Obligation internationale du gouvernement polonais                                             |                                     |                                  |                           | 4,789 % éch. 03/06/2031                                                                        | \$ 2 300                            | 2 303                            | 0,11                      |                                                                                                |                                     | 484                              | 0,02                      |
| 2,375 % éch. 18/01/2036                                                                        | € 2 400                             | 2 505                            | 0,12                      | <b>ROYAUME-UNI</b>                                                                             |                                     |                                  |                           | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| <b>QATAR</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae                                                                                     |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           | Network Rail Infrastructure Finance PLC                                                        |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 20/06/2052                                                                        | 28 314                              | 25 808                           | 1,21                      |
| QatarEnergy                                                                                    |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 22/11/2027                                                                        | £ 17 361                            | 23 355                           | 1,10                      | 4,409 % éch. 20/08/2072 -                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 23/06/2029                                                                        | \$ 1 900                            | 1 888                            | 0,09                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | 20/04/2073                                                                                     | 5 893                               | 5 943                            | 0,28                      |
| <b>ROUMANIE</b>                                                                                |                                     |                                  |                           | Alba PLC                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,461 % éch. 20/08/2066                                                                        | 13                                  | 13                               | 0,00                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,036 % éch. 17/03/2039                                                                        | 486                                 | 643                              | 0,03                      | 4,509 % éch. 20/10/2072                                                                        | 4 808                               | 4 869                            | 0,23                      |
| Obligation internationale du gouvernement roumain                                              |                                     |                                  |                           | Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                              |                                     |                                  |                           | 4,609 % éch. 20/03/2073                                                                        | 5 635                               | 5 721                            | 0,27                      |
| 5,125 % éch. 24/09/2031                                                                        | € 1 900                             | 2 222                            | 0,10                      | 4,587 % éch. 18/02/2068                                                                        | 9 000                               | 11 939                           | 0,56                      | 4,709 % éch. 20/05/2073                                                                        | 2 969                               | 3 038                            | 0,14                      |
| 5,625 % éch. 30/05/2037 (d)                                                                    | 1 100                               | 1 241                            | 0,06                      | 4,596 % éch. 18/12/2066                                                                        | 6 018                               | 7 992                            | 0,38                      | 4,927 % éch. 20/08/2068                                                                        | 892                                 | 896                              | 0,04                      |
| 5,875 % éch. 11/07/2032 (d)                                                                    | 9 600                               | 11 511                           | 0,54                      | Avon Finance PLC                                                                               |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                                      |                                     |                                  |                           |
| Total Roumanie                                                                                 |                                     | 14 974                           | 0,70                      | Bletchley Park Funding PLC                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/08/2052 -                                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,604 % éch. 27/07/2070                                                                        | 4 485                               | 5 963                            | 0,28                      | 01/09/2052                                                                                     | 815                                 | 788                              | 0,04                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | Braccan Mortgage Funding PLC                                                                   |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien                                             |                                     |                                  |                           | 4,588 % éch. 17/05/2067                                                                        | 5 845                               | 7 762                            | 0,36                      | 4,000 % éch. 01/07/2056 -                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 13/01/2031                                                                        | \$ 1 400                            | 1 430                            | 0,07                      | Canada Square Funding PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                                                     | 42 250                              | 39 467                           | 1,85                      |
| <b>ESPAGNE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | 4,597 % éch. 17/01/2059                                                                        | 2 723                               | 3 616                            | 0,17                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                                                      |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | 5,409 % éch. 17/06/2058                                                                        | 99                                  | 132                              | 0,01                      | 01/08/2056                                                                                     | 88 400                              | 84 623                           | 3,98                      |
| Auto ABS Spanish Loans                                                                         |                                     |                                  |                           | Elstree PLC                                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                        | 65 500                              | 64 369                           | 3,02                      |
| 2,521 % éch. 28/02/2032                                                                        | € 756                               | 865                              | 0,04                      | 4,454 % éch. 21/01/2065                                                                        | 2 933                               | 3 890                            | 0,18                      | 5,500 % éch. 01/07/2056 -                                                                      |                                     |                                  |                           |
| Autonoria Spain                                                                                |                                     |                                  |                           | Harbour PLC                                                                                    |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                                                     | 56 900                              | 57 075                           | 2,68                      |
| 2,882 % éch. 30/04/2043                                                                        | 6 800                               | 7 787                            | 0,37                      | Hops Hill PLC                                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 292 610                          | 13,74                     |
| 2,942 % éch. 30/09/2041                                                                        | 1 220                               | 1 397                            | 0,06                      | 4,464 % éch. 21/06/2056                                                                        | 3 367                               | 4 457                            | 0,21                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | Lanebrook Mortgage Transaction PLC                                                             |                                     |                                  |                           | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,397 % éch. 20/07/2058                                                                        | 537                                 | 713                              | 0,03                      | 0,125 % éch. 15/10/2026                                                                        | 27 657                              | 27 509                           | 1,29                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | Polaris PLC                                                                                    |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/04/2027                                                                        | 50 113                              | 49 139                           | 2,31                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 27/03/2069                                                                        | 6 800                               | 9 038                            | 0,42                      | 0,125 % éch. 15/01/2030                                                                        | 58 101                              | 54 576                           | 2,56                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,505 % éch. 25/08/2068                                                                        | 5 683                               | 7 536                            | 0,35                      | 0,125 % éch. 15/07/2030                                                                        | 13 764                              | 12 864                           | 0,60                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | RMAC PLC                                                                                       |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/01/2031                                                                        | 31 078                              | 28 712                           | 1,35                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,947 % éch. 15/02/2047                                                                        | 1 567                               | 2 080                            | 0,10                      |                                                                                                |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

| DESCRIPTION                 |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                 |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                       |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------|----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------|----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 0,125 % éch. 15/07/2031     | \$ | 5 316                               | 4 882                            | 0,23                      | 1,125 % éch. 15/01/2033     | \$ | 8 047                               | 7 614                            | 0,36                      | 2,375 % éch. 15/10/2028           | \$ | 50 543                              | 51 099                           | 2,40                      |
| 0,125 % éch. 15/01/2032     |    | 26 302                              | 23 819                           | 1,12                      | 1,250 % éch. 15/04/2028 (d) |    | 94 234                              | 92 735                           | 4,35                      | 2,375 % éch. 15/02/2055           |    | 7 491                               | 6 899                            | 0,32                      |
| 0,250 % éch. 15/07/2029     |    | 55 966                              | 53 394                           | 2,51                      | 1,250 % éch. 15/04/2031     |    | 29 619                              | 28 705                           | 1,35                      |                                   |    |                                     | 1 516 403                        | 71,20                     |
| 0,250 % éch. 15/02/2050     |    | 518                                 | 292                              | 0,01                      | 1,375 % éch. 15/02/2044     |    | 1 286                               | 1 050                            | 0,05                      | Total États-Unis                  |    |                                     | 1 813 960                        | 85,17                     |
| 0,375 % éch. 15/01/2027 (d) |    | 66 156                              | 65 291                           | 3,06                      | 1,625 % éch. 15/10/2027     |    | 47 203                              | 46 984                           | 2,21                      | Total des Valeurs mobilières      |    | \$                                  | 3 075 899                        | 144,44                    |
| 0,375 % éch. 15/07/2027 (d) |    | 108 063                             | 106 266                          | 4,99                      | 1,625 % éch. 15/10/2029 (d) |    | 100 940                             | 100 265                          | 4,71                      | ACTIONS                           |    |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % éch. 15/01/2028 (d) |    | 75 989                              | 74 067                           | 3,48                      | 1,625 % éch. 15/04/2030 (d) |    | 140 876                             | 139 204                          | 6,54                      | FONDS D'INVESTISSEMENT            |    |                                     |                                  |                           |
| 0,625 % éch. 15/07/2032     |    | 7 906                               | 7 325                            | 0,34                      | 1,750 % éch. 15/01/2023 (d) |    | 80 094                              | 79 564                           | 3,74                      | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF |    |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 15/07/2028 (d) |    | 75 865                              | 74 197                           | 3,48                      | 1,750 % éch. 15/01/2034     |    | 15 705                              | 15 349                           | 0,72                      | PIMCO Select Funds plc -          |    |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 15/02/2042     |    | 589                                 | 450                              | 0,02                      | 1,875 % éch. 15/07/2035 (d) |    | 29 550                              | 28 904                           | 1,36                      | Fonds PIMCO US Dollar             |    |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 15/02/2045     |    | 707                                 | 502                              | 0,02                      | 2,125 % éch. 15/04/2029 (d) |    | 72 977                              | 73 203                           | 3,44                      | Short-Term Floating               |    |                                     |                                  |                           |
| 0,875 % éch. 15/01/2029     |    | 65 794                              | 64 022                           | 3,01                      | 2,125 % éch. 15/01/2035     |    | 16 035                              | 16 002                           | 0,75                      | NAV Fund (c)                      |    | 38 649                              | 385                              | 0,02                      |
| 0,875 % éch. 15/02/2047     |    | 828                                 | 582                              | 0,03                      | 2,125 % éch. 15/02/2040     |    | 154                                 | 149                              | 0,01                      | Total des Fonds d'investissement  |    | \$                                  | 385                              | 0,02                      |
| 1,125 % éch. 15/10/2030 (d) |    | 175 588                             | 170 546                          | 8,00                      | 2,125 % éch. 15/02/2054     |    | 11 716                              | 10 242                           | 0,48                      |                                   |    |                                     |                                  |                           |

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

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

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Long  | 09/2026              | 289                   | \$ 108                                  | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026              | 251                   | (269)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Long  | 09/2026              | 530                   | 342                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026              | 455                   | 545                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026              | 84                    | (123)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026              | 290                   | (773)                                   | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 849                   | (447)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026              | 965                   | 80                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026              | 32                    | (68)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 74                    | (2)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 756                   | 138                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026              | 54                    | 43                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026              | 812                   | (1 123)                                 | (0,05)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Court | 09/2026              | 338                   | (857)                                   | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 141                   | 60                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Court | 09/2026              | 106                   | (139)                                   | (0,01)                 |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ (2 485)                              | (0,12)                 |

## OPTIONS VENDUES

**OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR MATIÈRES PREMIÈRES**

| Description                                                                   | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|----------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor septembre 2026 | € 97 625        | 14/09/2026        | 1 190              | \$ (321) | \$ (60)      | 0,00                |

|                                                                            |            |        |
|----------------------------------------------------------------------------|------------|--------|
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | \$ (2 545) | (0,12) |
|----------------------------------------------------------------------------|------------|--------|

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)**

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

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000 %   | 16/09/2036      | £ 4 700          | \$ 29                             | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 16/06/2029      | ¥ 1 952 000      | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/03/2036      | 3 278 200        | 712                               | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,237     | 21/11/2053      | \$ 8 700         | 2 662                             | 0,13                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 129 440          | 2 259                             | 0,11                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 32 160           | (123)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 54 000           | 818                               | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 9 100            | (294)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | € 41 690         | 98                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2046      | 8 500            | (266)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 48 600           | 223                               | 0,01                |
| À payer                          | CPTFEMU                           | 1,375     | 15/02/2040      | 1 600            | (118)                             | (0,01)              |
| À recevoir                       | CPTFEMU                           | 1,529     | 15/05/2027      | 16 100           | 297                               | 0,01                |
| À recevoir                       | CPTFEMU                           | 1,843     | 15/02/2031      | 10 100           | 190                               | 0,01                |
| À payer                          | CPTFEMU                           | 1,946     | 15/03/2048      | 800              | (83)                              | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,000 %   | 15/02/2027      | € 15 900          | \$ 177                            | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,034     | 15/09/2034      | 1 100             | 20                                | 0,00                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,280     | 15/04/2046      | 7 500             | 73                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,359     | 15/08/2030      | 9 500             | 219                               | 0,01                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,400     | 15/02/2044      | 3 900             | 158                               | 0,01                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,590     | 15/12/2052      | 1 700             | 147                               | 0,01                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,700     | 15/04/2053      | 5 500             | 752                               | 0,03                |
| À payer                                            | CPTFEMU                 | 2,763     | 15/09/2053      | 2 400             | 363                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 2,870     | 15/03/2028      | 82 300            | (70)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 3,000     | 15/05/2027      | 5 400             | 132                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                 | 3,130     | 15/05/2027      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 1,954     | 03/06/2029      | \$ 4 700          | (291)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 1,998     | 25/07/2029      | 4 300             | (266)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 2,311     | 24/02/2031      | 6 600             | 380                               | 0,02                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,335     | 05/02/2028      | 6 110             | (403)                             | (0,02)              |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,353     | 09/05/2028      | 960               | (62)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,364     | 10/05/2028      | 60                | (4)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,379     | 09/07/2028      | 1 900             | (122)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 3,434     | 27/08/2026      | 1 100             | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                 | 3,435     | 01/08/2026      | 11 000            | (87)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,346     | 15/05/2030      | £ 550             | (43)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 3,365     | 15/09/2027      | 15 900            | (340)                             | (0,02)              |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 3,391     | 15/08/2027      | 19 700            | (19)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,466     | 15/09/2034      | 2 000             | 38                                | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 3,500     | 15/08/2034      | 4 800             | 96                                | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,040     | 15/04/2029      | 4 400             | 124                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 4,530     | 15/04/2028      | 1 600             | (34)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 4,615     | 15/02/2027      | 3 700             | 38                                | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ 7 375                          | 0,35                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ 7 375                          | 0,35                |

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

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

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

#### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description                      | Indice initial | Taux variable                                                 | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM          | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 78,177      | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035        | 1 500                            | \$ (69) | \$ (31)      | 0,00                |

#### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,440 %         | 25/01/2027        | 4 400                            | \$ (39)    | \$ (7)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,440           | 25/01/2027        | 4 400                            | (39)       | (35)         | 0,00                |
| CBK          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 173 800                          | (627)      | (758)        | (0,04)              |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,350           | 07/01/2027        | 18 600                           | (169)      | (22)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,350           | 07/01/2027        | 18 600                           | (169)      | (176)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,500           | 14/01/2027        | 26 700                           | (245)      | (52)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500           | 14/01/2027        | 26 700                           | (245)      | (187)        | (0,01)              |
| GST          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 82 000                           | (281)      | (358)        | (0,02)              |
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 27/08/2026        | 21 100                           | (122)      | (99)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 21 100                           | (122)      | (33)         | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   | \$ (2 058)                       | \$ (1 727) | (0,08)       |                     |

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500 %              | 17/10/2057      | \$ 7                             | \$ 0                   | \$ 0                              | \$ 0         | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                | 17/08/2061      | 1 400                            | (3)                    | 7                                 | 4            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index  | 0,500                | 17/09/2058      | 20                               | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              |                             |                      |                 |                                  | \$ (3)                 | \$ 7                              | \$ 4         | 0,00                |

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

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

# Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 19 315            | \$ 13 811          | \$ 430                | \$ 430                                  | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH             | 17 773            | 2 632              | 13                    | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 15 327            | 9 052              | 333                   | 333                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 505             | CAD 2 139          | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 7 470             | NZD 13 224         | 52                    | 52                                      | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | CAD             | 2 136             | \$ 1 505           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 13 224            | 7 479              | 0                     | (52)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 261               | 50                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 572 239           | 3 598              | 77                    | 77                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 85 901            | 56                 | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | NOK             | 5 290             | 535                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 21                | 17                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 658             | CNH 11 211         | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 727            | € 11 793           | 0                     | (243)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 2 169             | ¥ 345 100          | 0                     | (46)                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 1 828             | NOK 16 989         | 0                     | (111)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 185               | PLN 697            | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 469             | \$ 830             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 3 950             | 223                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 637               | INR 60 567         | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL             | 5 298             | \$ 1 023           | 3                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 429             | 1 817              | 45                    | 45                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 9 344             | 1 381              | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY             | 1 713             | 251                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 24 253            | 28 177             | 455                   | 448                                     | 0,02                |
| BRC          | 07/2026           | £               | 8 151             | 10 796             | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 194 589 656       | 10 858             | 9                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 3 748             | 1 272              | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 355 371           | 3 700              | 0                     | (54)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 934 243         | 12 165             | 264                   | 264                                     | 0,01                |
| BRC          | 07/2026           | KRW             | 847 543           | 556                | 8                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 155             | 117                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 50 982            | 1 554              | 21                    | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 229             | AUD 1 783          | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 241               | BRL 1 215          | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 10 124            | £ 7 554            | 0                     | (98)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10 602            | INR 1 005 093      | 21                    | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 236             | ¥ 200 100          | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 587             | KRW 3 968 503      | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 466               | ZAR 7 652          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 08/2026           | ILS             | 674               | \$ 226             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 521             | BRL 7 748          | 0                     | (36)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 19 953 882        | \$ 1 099           | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 45 089            | 1 390              | 24                    | 24                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 5 832             | IDR 103 493 079    | 7                     | (103)                                   | 0,00                |
| BRC          | 09/2026           |                 | 667               | INR 63 386         | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 269               | THB 8 832          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 680               | IDR 12 389 032     | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 4 669             | \$ 1 577           | 10                    | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 198 351           | 1 227              | 7                     | 7                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | NZD             | 22 263            | 13 166             | 502                   | 502                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 558             | TRY 311 431        | 11                    | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 327             | ZAR 37 790         | 0                     | (25)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 227             | ¥ 197 831          | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 3 314             | \$ 2 337           | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £               | 187               | 251                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 16 144            | 5 553              | 133                   | 133                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | INR             | 190 638           | 2 020              | 7                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 6 030             | 650                | 41                    | 41                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 52 547            | 5 687              | 258                   | 258                                     | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 1 054             | BRL 5 325          | 0                     | (25)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 261             | € 1 082            | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 070             | IDR 37 133 648     | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 967             | INR 190 638        | 47                    | 47                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 277               | KRW 418 183        | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 158               | PEN 536            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 772               | PLN 2 822          | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 208             | SEK 38 890         | 0                     | (190)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 7 051             | \$ 2 450           | 82                    | 82                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 564               | ILS 1 675          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| DUB          | 09/2026           | IDR             | 73 121 088        | \$ 4 050           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 23 169            | 241                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 54 440            | 1 644              | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 455             | IDR 25 952 447     | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 11                | INR 1 059          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 09/2026           |                 | 477               | MXN 8 538          | 8                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 1 981             | IDR 36 012 884     | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 4 947 653         | \$ 277             | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 75 926            | 804                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 057             | BRL 5 392          | 0                     | (15)                                    | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | \$              | 537               | INR 51 754         | \$ 9                  | \$ 0                                    | 9 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 137               | NOK 1 277          | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 771               | PLN 2 863          | 0                     | (10)                                    | (10) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 1 086             | ZAR 17 573         | 0                     | (15)                                    | (15) 0,00           |
|              | 09/2026           | IDR             | 48 326 516        | \$ 2 682           | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 893               | IDR 16 219 597     | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 804               | INR 76 441         | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 07/2026           | CNH             | 9 296             | \$ 1 374           | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | £               | 255 099           | 342 759            | 4 178                 | 0                                       | 4 178 0,20          |
|              | 07/2026           | INR             | 135 465           | 1 436              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 237 918           | 1 497              | 33                    | 0                                       | 33 0,00             |
|              | 07/2026           | SGD             | 38 252            | 29 983             | 410                   | 0                                       | 410 0,02            |
|              | 07/2026           | \$              | 3 705             | CNH 25 204         | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 129 816           | £ 98 130           | 427                   | 0                                       | 427 0,02            |
|              | 07/2026           |                 | 1 420             | INR 135 465        | 12                    | 0                                       | 12 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 88 046            | ¥ 14 245 826       | 0                     | (393)                                   | (393) (0,02)        |
|              | 07/2026           |                 | 5 165             | PLN 18 927         | 0                     | (130)                                   | (130) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 1 922             | SEK 18 649         | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 517             | ZAR 25 034         | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 08/2026           | CNH             | 25 148            | \$ 3 705           | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | £98 130           | 129 812            | 0                     | (428)                                   | (428) (0,02)        |
|              | 08/2026           | ILS             | 3 918             | 1 368              | 52                    | 0                                       | 52 0,00             |
|              | 08/2026           | ¥               | 14 208 548        | 88 046             | 395                   | 0                                       | 395 0,02            |
|              | 08/2026           | SEK             | 18 616            | 1 922              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 09/2026           | \$              | 25 497            | BRL 131 095        | 0                     | (545)                                   | (545) (0,03)        |
| GLM          | 09/2026           |                 | 694               | INR 66 468         | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 387               | MXN 6 841          | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | KRW             | 792 298           | \$ 513             | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 2 676             | BRL 14 227         | 85                    | (12)                                    | 73 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 20 763            | CAD 29 546         | 62                    | 0                                       | 62 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 1 979             | IDR 35 485 532     | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 513               | KRW 792 185        | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           | CAD             | 29 504            | \$ 20 763          | 0                     | (62)                                    | (62) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 2 474             | BRL 12 642         | 0                     | (50)                                    | (50) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 529               | INR 50 750         | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 09/2026           | IDR             | 35 693 339        | \$ 1 979           | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | MXN             | 4 840             | 277                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 09/2026           | THB             | 137 332           | 4 256              | 96                    | 0                                       | 96 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 3 294             | BRL 16 955         | 0                     | (67)                                    | (67) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 4 166             | IDR 74 801 039     | 8                     | (28)                                    | (20) 0,00           |
|              | 09/2026           |                 | 2 372             | INR 228 137        | 23                    | 0                                       | 23 0,00             |
| JPM          | 09/2026           |                 | 791               | MXN 13 791         | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
|              | 07/2026           | AUD             | 83 601            | \$ 59 599          | 1 680                 | 0                                       | 1 680 0,08          |
|              | 07/2026           | BRL             | 22 856            | 4 442              | 26                    | 0                                       | 26 0,00             |
|              | 07/2026           | ILS             | 11 897            | 3 984              | 0                     | (9)                                     | (9) 0,00            |
|              | 07/2026           | INR             | 2 239             | 24                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | KRW             | 244 826           | 158                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | NOK             | 6 616             | 668                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | NZD             | 335               | 198                | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 9 162             | £ 6 828            | 0                     | (100)                                   | (100) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 303               | IDR 5 442 478      | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 24                | INR 2 239          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 237               | KRW 364 326        | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 7 758             | PLN 28 282         | 1                     | (235)                                   | (234) (0,01)        |
|              | 07/2026           |                 | 1 106             | THB 36 974         | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|              | 08/2026           | ILS             | 12 510            | \$ 4 310           | 107                   | 0                                       | 107 0,01            |
|              | 08/2026           | \$              | 668               | NOK 6 619          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| MBC          | 09/2026           | IDR             | 5 656 819         | \$ 313             | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | MXN             | 9 902             | 561                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 09/2026           | THB             | 108 125           | 3 312              | 48                    | (11)                                    | 37 0,00             |
|              | 09/2026           | TWD             | 1 341             | 42                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 3 376             | INR 322 080        | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 2 270             | MXN 39 634         | 0                     | (16)                                    | (16) 0,00           |
|              | 10/2026           |                 | 4 442             | BRL 23 359         | 0                     | (26)                                    | (26) 0,00           |
|              | 12/2026           |                 | 26 018            | MXN 456 467        | 0                     | (245)                                   | (245) (0,01)        |
|              | 07/2026           | AUD             | 348               | \$ 249             | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 07/2026           | CHF             | 14 010            | 17 786             | 433                   | (14)                                    | 419 0,02            |
|              | 07/2026           | €               | 12 753            | 14 699             | 119                   | 0                                       | 119 0,01            |
|              | 07/2026           | £               | 4 579             | 6 053              | 0                     | (25)                                    | (25) 0,00           |
|              | 07/2026           | IDR             | 487 751           | 27                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | INR             | 76 226            | 807                | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 07/2026           | ¥               | 4 194 047         | 26 384             | 578                   | 0                                       | 578 0,03            |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 478 572         | 975                | 20                    | 0                                       | 20 0,00             |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 181             | 220                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | SEK             | 116               | 12                 | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 761             | 2 155              | 20                    | 0                                       | 20 0,00             |
|              | 07/2026           | \$              | 70 065            | AUD 101 480        | 279                   | (39)                                    | 240 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 17 281            | € 15 159           | 82                    | (29)                                    | 53 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 1 244             | INR 119 960        | 21                    | 0                                       | 21 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 327               | NOK 3 034          | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 1 013             | NZD 1 796          | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 170             | SEK 11 389         | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |

## Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 08/2026           | AUD             | 98 250            | \$ 67 750          | \$ 0                  | \$ (278)                                | (0,01)              |
|              | 08/2026           | €               | 10 966            | 12 472             | 0                     | (82)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 11 368            | 1 170              | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 80                | NOK 796            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 32 430            | \$ 971             | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 385             | INR 323 851        | 16                    | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2 647             | MXN 46 665         | 6                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | €               | 31                | \$ 36              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 54                | 71                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 17 560            | 1 879              | 64                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 957             | € 1 707            | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 667             | £ 2 757            | 5                     | (12)                                    | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 1 842             | IDR 32 846 128     | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 259             | INR 121 075        | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 33 030 336        | \$ 1 842           | 11                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 890               | IDR 15 844 543     | 0                     | (12)                                    | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           |                 | 1 353             | £ 1 024            | 6                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | CNY             | 4 011             | \$ 588             | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 2 830             | 3 292              | 57                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 6 626             | 8 915              | 121                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 703               | IDR 12 623 518     | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 656             | INR 158 760        | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 316             | 126 056            | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 37 894 066        | \$ 2 099           | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 48 915            | 1 515              | 33                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 270             | IDR 40 752 257     | 3                     | (14)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | €               | 605 053           | \$ 705 818         | 14 061                | 0                                       | 0,66                |
|              | 07/2026           | ¥               | 7 654 240         | 48 180             | 1 084                 | 0                                       | 0,05                |
|              | 07/2026           | SGD             | 60                | 47                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 702 439           | € 617 529          | 3 582                 | 0                                       | 0,17                |
|              | 07/2026           |                 | 31 733            | SGD 41 095         | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 617 529           | \$ 703 392         | 0                     | (3 575)                                 | (0,17)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 41 003            | 31 733             | 0                     | (40)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 47                | SGD 60             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 30 372            | \$ 22 025          | 618                   | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | CHF             | 492               | 625                | 16                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 191               | CAD 270            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 270               | \$ 191             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | £               | 203               | 273                | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 902             | € 2 500            | 0                     | (44)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 785               | PLN 2 870          | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 3 997             | \$ 228             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 5 953             | 181                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$              | 19 279            | CHF 15 566         | 18                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 15 510            | \$ 19 279          | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 32 017          | \$ (7 887)            | \$ 24 130                               | 1,13                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$              | 140               | CHF 110            | \$ 0                  | \$ (4)                                  | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 29 857            | 23 337             | 0                     | (926)                                   | (0,04)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 2                 | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 32 997            | CHF 25 846         | 1                     | (956)                                   | (0,05)              |
| MYI          | 08/2026           | CHF             | 52                | 64                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 25 242            | 31 200             | 0                     | (92)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 31 200            | CHF 25 151         | 92                    | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF             | 3                 | \$ 4               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 32 072            | CHF 25 211         | 0                     | (818)                                   | (0,04)              |
| WST          | 07/2026           | CHF             | 25 159            | \$ 31 161          | 0                     | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 31 161            | CHF 25 069         | 29                    | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 122             | \$ (2 824)            | \$ (2 702)                              | (0,13)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | €               | 252               | \$ 293             | \$ 5                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 3 922             | 4 476              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 282 503           | € 242 498          | 3                     | (5 258)                                 | (0,25)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 3 743             | 3 210              | 0                     | (73)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | 230 415           | \$ 262 788         | 0                     | (646)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | \$              | 263 142           | € 230 415          | 644                   | 0                                       | 0,03                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MBC          | 07/2026           | € 244 156       | \$ 277 381        | \$ 27              | \$ (1 790)            | \$ (1 763)                              | (0,08)              |
|              | 07/2026           | \$ 5 621        | € 4 846           | 0                  | (81)                  | (81)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 23            | \$ 27             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 271 508      | € 238 723         | 1 790              | 0                     | 1 790                                   | 0,08                |
| SCX          | 07/2026           | 261 207         | 224 515           | 0                  | (4 519)               | (4 519)                                 | (0,21)              |
| SOG          | 07/2026           | € 238 723       | \$ 271 547        | 0                  | (1 385)               | (1 385)                                 | (0,07)              |
|              | 07/2026           | \$ 282 470      | € 242 143         | 0                  | (5 627)               | (5 627)                                 | (0,26)              |
| SSB          | 08/2026           | 271 916         | 238 723           | 1 382              | 0                     | 1 382                                   | 0,06                |
|              | 07/2026           | 292             | 256               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 256           | \$ 293            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 852           | \$ (19 388)           | \$ (15 536)                             | (0,73)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 78 902       | £ 58 771          | \$ 0               | \$ (897)              | \$ (897)                                | (0,04)              |
| BOA          | 07/2026           | 134             | 100               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 53 734        | \$ 70 865         | 1                  | (454)                 | (453)                                   | (0,02)              |
| BPS          | 07/2026           | \$ 89 082       | £ 66 481          | 2                  | (847)                 | (845)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | £ 52            | \$ 69             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 70 770       | £ 53 664          | 453                | 0                     | 453                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | 203             | 153               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | £ 111           | \$ 150            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 142          | £ 106             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 5             | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 439        | £ 3 301           | 0                  | (58)                  | (58)                                    | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | 7               | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 86 378          | 64 372            | 0                  | (940)                 | (940)                                   | (0,05)              |
| JPM          | 07/2026           | £ 351           | \$ 472            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 27           | £ 20              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 13 910        | \$ 18 306         | 0                  | (156)                 | (156)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 18 305       | £ 13 910          | 156                | 0                     | 156                                     | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | £ 62 354        | \$ 82 532         | 1                  | (228)                 | (227)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 44           | £ 33              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           | 82 516          | 62 345            | 229                | 0                     | 229                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 62 099        | \$ 82 033         | 0                  | (388)                 | (388)                                   | (0,02)              |
| SSB          | 08/2026           | \$ 82 031       | £ 62 099          | 388                | 0                     | 388                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | £ 765           | \$ 1 011          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 244           | \$ (3 975)            | \$ (2 731)                              | (0,13)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 174 508      | SGD 222 532       | \$ 0               | \$ (2 463)            | \$ (2 463)                              | (0,11)              |
| BOA          | 07/2026           | SGD 99 937      | \$ 77 213         | 0                  | (51)                  | (51)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 150 422      | SGD 192 095       | 0                  | (1 908)               | (1 908)                                 | (0,09)              |
| FAR          | 08/2026           | 77 213          | 99 707            | 51                 | 0                     | 51                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 121 446     | \$ 93 643         | 0                  | (250)                 | (250)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 179 288      | SGD 228 731       | 0                  | (2 450)               | (2 450)                                 | (0,11)              |
|              | 08/2026           | 93 643          | 121 167           | 250                | 0                     | 250                                     | 0,01                |
| NSL          | 07/2026           | SGD 24 273      | \$ 18 746         | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 18 746       | SGD 24 217        | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 235 847     | \$ 182 122        | 0                  | (218)                 | (218)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 24 543       | SGD 31 298        | 0                  | (346)                 | (346)                                   | (0,02)              |
|              |                   |                 |                   | 228                | 0                     | 228                                     | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 548             | \$ (7 706)            | \$ (7 158)                              | (0,33)              |

|                                                    |              |         |
|----------------------------------------------------|--------------|---------|
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | \$ (5 751)   | (0,27)  |
| Total des Investissements                          | \$ 3 075 363 | 144,42  |
| Autres actifs et passifs à court terme             | \$ (945 929) | (44,42) |
| Actif net                                          | \$ 2 129 434 | 100,00  |

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

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

- Titre vendu avant l'émission.
- Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- Affilié au Fonds.
- Des titres d'une juste valeur globale de 806 286 \$ (31 décembre 2025 : 899 929 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

Des titres d'une juste valeur globale de 1 183 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 90 \$ (31 décembre 2025 : 390 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 21 366 \$ (31 décembre 2025 : 14 962 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 18 020 \$ (31 décembre 2025 : 9 200 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 3 054 177                                         | \$ 21 722                                         | \$ 3 075 899        |
| Fonds d'investissement                        | 385                                                                               | 0                                                    | 0                                                 | 385                 |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (804)                                                                             | (117)                                                | 0                                                 | (921)               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (419)</b>                                                                   | <b>\$ 3 054 060</b>                                  | <b>\$ 21 722</b>                                  | <b>\$ 3 075 363</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 2 635 971                                         | \$ 16 671                                         | \$ 2 652 642        |
| Fonds d'investissement                        | 1 179                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 1 179               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 320                                                                             | 12 361                                               | 0                                                 | 13 681              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 2 499</b>                                                                   | <b>\$ 2 648 332</b>                                  | <b>\$ 16 671</b>                                  | <b>\$ 2 667 502</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOM                                           | 3,750 %        | 23/06/2026        | 14/07/2026         | \$ (230 409)     | \$ (230 600)                             | (10,83)             |
| BRC                                           | 2,000          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (492)          | (563)                                    | (0,03)              |
| CIB                                           | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026         | \$ (128 021)     | (128 377)                                | (6,03)              |
| DEU                                           | 3,750          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | (14 170)         | (14 171)                                 | (0,66)              |
| JPS                                           | 3,720          | 16/06/2026        | 07/07/2026         | (17 146)         | (17 172)                                 | (0,81)              |
|                                               | 3,740          | 24/06/2026        | 15/07/2026         | (3 888)          | (3 891)                                  | (0,18)              |
| SOG                                           | 2,370          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (3 714)        | (4 250)                                  | (0,20)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026         | \$ (323 985)     | (324 019)                                | (15,21)             |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (723 043)</b>                      | <b>(33,95)</b>      |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (2 584)                                                 | \$ 3 030                | \$ 446                            | \$ 1 648                                                   | \$ (1 800)              | \$ (152)                          |
| BOA          | (2 234)                                                    | 2 500                   | 266                               | 37                                                         | 0                       | 37                                |
| BPS          | (5 629)                                                    | 6 130                   | 501                               | 154                                                        | 0                       | 154                               |
| BRC          | 457                                                        | (530)                   | (73)                              | 4 248                                                      | (4 630)                 | (382)                             |
| CBK          | (542)                                                      | 690                     | 148                               | 218                                                        | (280)                   | (62)                              |
| DUB          | (29)                                                       | 0                       | (29)                              | 37                                                         | 0                       | 37                                |
| FAR          | 1 526                                                      | (2 120)                 | (594)                             | (32)                                                       | 0                       | (32)                              |
| GLM          | (406)                                                      | (650)                   | (1 056)                           | 42                                                         | (1 040)                 | (998)                             |
| GST          | (358)                                                      | 350                     | (8)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (633)                                                      | 420                     | (213)                             | (722)                                                      | 700                     | (22)                              |
| MBC          | 89                                                         | 50                      | 139                               | 4 028                                                      | (4 310)                 | (282)                             |
| MYI          | 53                                                         | 0                       | 53                                | 1 098                                                      | (1 250)                 | (152)                             |
| NSL          | 12                                                         | 0                       | 12                                | 5                                                          | 0                       | 5                                 |
| RYL          | 6                                                          | 0                       | 6                                 | (5)                                                        | 0                       | (5)                               |
| SAL          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 9                                                          | 0                       | 9                                 |
| SCX          | (4 291)                                                    | 4 570                   | 279                               | 450                                                        | (550)                   | (100)                             |
| SOG          | 9 052                                                      | (9 140)                 | (88)                              | (7 278)                                                    | 7 530                   | 252                               |
| SSB          | (184)                                                      | 280                     | 96                                | 149                                                        | (60)                    | 89                                |
| UAG          | (61)                                                       | 0                       | (61)                              | (557)                                                      | 920                     | 363                               |
| WST          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | (44)                                                       | 50                      | 6                                 |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 76,94            | 73,13                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 14,84            | 12,02                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,27             | 0,31                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,01             | 0,04                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,04             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,30             | 0,38                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,13             | 0,74                 |
| Autres actifs                                                    | 6,47             | 13,30                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                   | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|---------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                           | 3,93             | 3,47                 |
| Canada                                                              | 0,10             | 0,61                 |
| Îles Caïmans                                                        | S/O              | 0,11                 |
| Chili                                                               | 0,21             | S/O                  |
| Colombie                                                            | 0,12             | S/O                  |
| Danemark                                                            | 0,02             | 1,05                 |
| France                                                              | 6,72             | 8,48                 |
| Allemagne                                                           | 2,46             | 5,37                 |
| Hongrie                                                             | S/O              | 0,13                 |
| Irlande                                                             | 3,58             | 4,56                 |
| Italie                                                              | 8,04             | 9,07                 |
| Japon                                                               | 4,48             | 4,38                 |
| Luxembourg                                                          | 0,91             | 3,52                 |
| Mexique                                                             | 0,14             | S/O                  |
| Pays-Bas                                                            | 1,23             | 0,60                 |
| Nouvelle-Zélande                                                    | 0,15             | 0,18                 |
| Pérou                                                               | S/O              | 0,01                 |
| Pologne                                                             | 0,12             | S/O                  |
| Qatar                                                               | 0,09             | S/O                  |
| Roumanie                                                            | 0,70             | 0,73                 |
| Arabie saoudite                                                     | 0,07             | 0,53                 |
| Espagne                                                             | 6,09             | 5,28                 |
| Supranationales                                                     | 3,01             | 4,02                 |
| Suède                                                               | 0,18             | 0,36                 |
| Émirats arabes unis                                                 | 0,11             | 0,26                 |
| Royaume-Uni                                                         | 16,81            | 18,56                |
| États-Unis                                                          | 85,17            | 84,55                |
| Fonds d'investissement                                              | 0,02             | 0,07                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé    |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                       | (0,12)           | 0,07                 |
| Options vendues                                                     |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur matières premières | 0,00             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                            |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                             | 0,35             | 0,53                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                            |                  |                      |
| Options vendues                                                     |                  |                      |
| Options plafonnées sur l'inflation                                  | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                             | (0,08)           | (0,07)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection    | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                          | 1,13             | (0,93)               |
| Contrats de change à terme couverts                                 | (1,32)           | 1,21                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                              | (44,42)          | (56,71)              |
| Actif net                                                           | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |       |       |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
| AUSTRALIE                                                                              |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
| Project Cashmere                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/10/2056                          | DKK                                 | 0                                | \$ 0                      | 0,00                                        | BNPP AM Euro CLO DAC                   |                                  |                           |       |       |      |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (a)                                                            | AUD 28 400                          | \$ 19 611                        | 0,77                      | 5,000 % éch. 01/10/2053                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | 3,014 % éch. 22/07/2032                | € 2 803                          | \$ 3 204                  | 0,13  |       |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                  |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
| Obligation internationale du gouvernement australien                                   |                                     |                                  |                           | Realkredit Danmark A/S                           |                                     |                                  |                           | Carlyle Euro CLO DAC                        |                                        |                                  |                           |       |       |      |
| 0,250 % éch. 21/11/2032                                                                | 25 731                              | 15 826                           | 0,62                      | 1,000 % éch. 01/01/2027                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | 3,173 % éch. 15/08/2032                | 1 020                            | 1 167                     | 0,05  |       |      |
| 0,750 % éch. 21/11/2027                                                                | 21 419                              | 14 720                           | 0,58                      | 1,000 % éch. 01/10/2050                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | CVC Cordatus Loan Fund DAC             |                                  |                           |       |       |      |
| 1,500 % éch. 21/06/2031                                                                | 69 700                              | 42 106                           | 1,66                      | 1,000 % éch. 01/10/2053                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | 3,130 % éch. 29/07/2034                | 4 300                            | 4 916                     | 0,19  |       |      |
| 2,000 % éch. 21/08/2035                                                                | 5 387                               | 3 609                            | 0,14                      | 1,000 % éch. 01/10/2056                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | 3,259 % éch. 20/08/2034                | 1 792                            | 2 053                     | 0,08  |       |      |
| 2,500 % éch. 20/09/2030                                                                | 6 072                               | 4 331                            | 0,17                      | 1,500 % éch. 01/10/2050                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | 3,285 % éch. 23/01/2039                | 3 200                            | 3 664                     | 0,15  |       |      |
| New South Wales Treasury Corp.                                                         |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 01/10/2053                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC |                                  |                           |       |       |      |
| 4,750 % éch. 20/09/2035                                                                | 7 400                               | 4 945                            | 0,20                      | 2,500 % éch. 01/04/2047                          | 8                                   | 1                                | 0,00                      | 3,123 % éch. 15/08/2033                     | 1 290                                  | 1 475                            | 0,06                      |       |       |      |
| Queensland Treasury Corp.                                                              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/10/2056                          |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                        | Dryden Euro CLO DAC                    |                                  |                           |       |       |      |
| 2,000 % éch. 22/08/2033                                                                | 5 400                               | 3 069                            | 0,12                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                            |                                     |                                  |                           | 2,864 % éch. 15/04/2033                     | 1 297                                  | 1 483                            | 0,06                      |       |       |      |
| 3,375 % éch. 18/03/2036                                                                | € 600                               | 687                              | 0,03                      | Obligation internationale du gouvernement danois |                                     |                                  |                           | 3,143 % éch. 15/05/2034                     | 695                                    | 794                              | 0,03                      |       |       |      |
| Treasury Corp. of Victoria                                                             |                                     |                                  |                           | 0,100 % éch. 15/11/2030 (b)                      |                                     | 5 032                            | 0,20                      | Euro-Galaxy CLO DAC                         |                                        |                                  |                           |       |       |      |
| 2,250 % éch. 20/11/2034                                                                | AUD 16 200                          | 8 980                            | 0,35                      | Total Danemark                                   |                                     | 13 321                           | 0,52                      | 2,781 % éch. 24/04/2034                     | 3 157                                  | 3 608                            | 0,14                      |       |       |      |
| 4,250 % éch. 20/12/2032                                                                | 17 000                              | 11 332                           | 0,45                      | FRANCE                                           |                                     |                                  |                           | Grosvenor Place CLO DAC                     |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                       |                                     |                                  |                           | 3,383 % éch. 15/08/2039                     |                                        |                                  |                           | 3 200 | 3 662 | 0,14 |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | Auto ABS French Loans                            |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 2,829 % éch. 24/07/2036                          |                                     | € 3 308                          | 3 783                     | 0,15                                        | 3,054 % éch. 15/01/2032                | 2 113                            | 2 417                     | 0,10  |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | BPCE Consumer Loans FCT                          |                                     |                                  |                           | 3,523 % éch. 25/07/2037 (a)                 |                                        |                                  |                           | 5 375 | 6 145 | 0,24 |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 2,879 % éch. 31/10/2042                          |                                     | 4 041                            | 4 628                     | 0,18                                        | Invesco Euro CLO DAC                   |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | FCT Noria                                        |                                     |                                  |                           | 3,224 % éch. 15/01/2034                     | 991                                    | 1 134                            | 0,05                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 2,812 % éch. 25/07/2043                          |                                     | 6 000                            | 6 860                     | 0,27                                        | Madison Park Euro Funding DAC          |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,004 % éch. 15/07/2032                     | 10 256                                 | 11 740                           | 0,46                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,085 % éch. 25/10/2034                     | 4 200                                  | 4 799                            | 0,19                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                            |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,158 % éch. 20/04/2035                     | 2 000                                  | 2 289                            | 0,09                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,478 % éch. 20/07/2036                     | 1 800                                  | 2 060                            | 0,08                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,513 % éch. 15/04/2037                     | 6 500                                  | 7 431                            | 0,29                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Palmer Square European Loan Funding DAC     |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,253 % éch. 15/08/2033                     | 303                                    | 346                              | 0,01                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,273 % éch. 15/05/2034                     | 912                                    | 1 044                            | 0,04                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Penta CLO DAC                               |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,015 % éch. 25/07/2036                     | 1 400                                  | 1 602                            | 0,06                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC                            |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,374 % éch. 15/07/2038                     | 500                                    | 572                              | 0,02                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,415 % éch. 20/11/2038                     | 3 600                                  | 4 118                            | 0,16                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Sculptor European CLO DAC                   |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,254 % éch. 15/10/2034                     | 6 082                                  | 6 966                            | 0,27                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,365 % éch. 27/04/2038                     | 5 700                                  | 6 527                            | 0,26                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Tikehau CLO DAC                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/10/2038                     | 1 500                                  | 1 718                            | 0,07                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Toro European CLO DAC                       |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,093 % éch. 15/02/2034                     | 7 492                                  | 8 573                            | 0,34                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,474 % éch. 15/04/2037                     | 10 000                                 | 11 446                           | 0,45                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Voya Euro CLO DAC                           |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 3,164 % éch. 15/07/2035                     | 2 300                                  | 2 631                            | 0,10                      |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                             |                                        |                                  |                           |       |       |      |



| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>JAPON</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>POLOGNE</b>                                           |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                             |                                     |                                  |                           | <b>Network Rail Infrastructure Finance PLC</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais       |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 22/11/2027                                                                        | £ 5 047                             | \$ 6 789                         | 0,27                      |
| 0,005 % éch.                                                                                   |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 18/01/2036                                  | € 2 300                             | \$ 2 400                         | 0,09                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| 10/03/2034 (b)                                                                                 | ¥ 749 817                           | 4 424                            | 0,17                      | <b>PORTUGAL</b>                                          |                                     |                                  |                           | <b>Alba PLC</b>                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 0,005 % éch.                                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                       |                                     |                                  |                           | 4,036 % éch. 17/03/2039                                                                        | 1 158                               | 1 530                            | 0,06                      |
| 10/03/2035 (b)                                                                                 | 1 845 450                           | 10 730                           | 0,42                      | <b>GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A.</b> |                                     |                                  |                           | Aldbrook Mortgage Transaction PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 0,100 % éch.                                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,158 % éch. 23/12/2036                                  | 6 900                               | 7 900                            | 0,31                      | 4,587 % éch. 18/02/2068                                                                        | 11 100                              | 14 725                           | 0,58                      |
| 10/03/2028 (b)                                                                                 | 4 189 167                           | 25 879                           | 1,02                      | <b>QATAR</b>                                             |                                     |                                  |                           | Avon Finance PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 0,100 % éch.                                                                                   |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                     |                                     |                                  |                           | 4,646 % éch. 28/12/2049                                                                        | 3 653                               | 4 850                            | 0,19                      |
| 10/03/2029 (b)                                                                                 | 10 475 972                          | 64 425                           | 2,54                      | <b>QatarEnergy</b>                                       |                                     |                                  |                           | Brants Bridge PLC                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 1,300 % éch. 20/09/2030                                                                        | 2 400 000                           | 14 466                           | 0,57                      | 4,625 % éch. 23/06/2029                                  | \$ 2 200                            | 2 187                            | 0,09                      | 4,647 % éch. 14/06/2066                                                                        | 1 265                               | 1 681                            | 0,06                      |
| 1,800 % éch. 20/03/2054                                                                        | 93 000                              | 368                              | 0,01                      | <b>ROUMANIE</b>                                          |                                     |                                  |                           | Canada Square Funding PLC                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,200 % éch. 20/06/2054                                                                        | 108 000                             | 471                              | 0,02                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                             |                                     |                                  |                           | 4,597 % éch. 17/01/2059                                                                        | 6 289                               | 8 351                            | 0,33                      |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                                                                        | 108 000                             | 481                              | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement roumain        |                                     |                                  |                           | Harbour PLC                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                                                                        | 217 100                             | 990                              | 0,04                      | 5,125 % éch. 24/09/2031                                  | € 3 100                             | 3 625                            | 0,14                      | 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                        | 4 709                               | 6 269                            | 0,25                      |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                                                                        | 395 650                             | 2 137                            | 0,08                      | 5,875 % éch. 11/07/2032                                  | 23 700                              | 28 418                           | 1,12                      | Harvest Funding PLC                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 20/12/2055                                                                        | 1 160 000                           | 6 514                            | 0,26                      | 6,375 % éch. 18/09/2033                                  | 11 100                              | 13 533                           | 0,53                      | 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                        | 7 600                               | 10 089                           | 0,40                      |
| Total Japon                                                                                    |                                     | 130 885                          | 5,15                      | Total Roumanie                                           |                                     | 45 576                           | 1,79                      | Hops Hill PLC                                                                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                                                              |                                     |                                  |                           | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                   |                                     |                                  |                           | 4,464 % éch. 21/06/2056                                                                        | 3 763                               | 4 981                            | 0,19                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                             |                                     |                                  |                           | Polaris PLC                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| E-Carat DE                                                                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement saoudien       |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 27/03/2069                                                                        | 8 400                               | 11 165                           | 0,44                      |
| 2,919 % éch. 25/05/2034                                                                        | € 8 000                             | 9 166                            | 0,36                      | 5,375 % éch. 13/01/2031                                  | \$ 2 400                            | 2 451                            | 0,10                      | 4,505 % éch. 25/08/2068                                                                        | 6 646                               | 8 814                            | 0,35                      |
| SC Germany S.A., Compartiment Consumer                                                         |                                     |                                  |                           | <b>ESPAGNE</b>                                           |                                     |                                  |                           | RMAC PLC                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 2,779 % éch. 14/01/2038                                                                        | 3 264                               | 3 736                            | 0,15                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                       |                                     |                                  |                           | 4,947 % éch. 15/02/2047                                                                        | 2 872                               | 3 814                            | 0,15                      |
| 2,849 % éch. 15/09/2037                                                                        | 2 407                               | 2 757                            | 0,11                      | Auto ABS Spanish Loans                                   |                                     |                                  |                           | Rochester Financing PLC                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Total Luxembourg                                                                               |                                     | 15 659                           | 0,62                      | 3,059 % éch. 28/09/2038                                  | € 4 424                             | 5 070                            | 0,20                      | 5,046 % éch. 18/12/2044                                                                        | 2 926                               | 3 887                            | 0,15                      |
| <b>MEXIQUE</b>                                                                                 |                                     |                                  |                           | Autonoria Spain                                          |                                     |                                  |                           | Stratton BTL Mortgage Funding PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 2,942 % éch. 30/09/2041                                  | 2 440                               | 2 795                            | 0,11                      | 4,477 % éch. 20/01/2054                                                                        | 1 082                               | 1 437                            | 0,06                      |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                                             |                                     |                                  |                           | BBVA Consumer Auto                                       |                                     |                                  |                           | Twin Bridges PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 22/09/2035                                                                        | \$ 2 900                            | 2 823                            | 0,11                      | 2,879 % éch. 19/05/2042                                  | 4 889                               | 5 595                            | 0,22                      | 4,407 % éch. 12/09/2055                                                                        | 2 687                               | 3 566                            | 0,14                      |
| <b>PAYS-BAS</b>                                                                                |                                     |                                  |                           | FTA Santander Consumer Spain Auto                        |                                     |                                  |                           |                                                                                                |                                     | 85 159                           | 3,35                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | 3,236 % éch. 22/09/2039                                  | 2 474                               | 2 836                            | 0,11                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Domi BV                                                                                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                             |                                     |                                  |                           | Bon du Trésor britannique                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,892 % éch. 15/02/2057                                                                        | € 7 714                             | 8 816                            | 0,35                      | Obligation internationale du gouvernement espagnol       |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 10/08/2028 (b)                                                                    | 48 814                              | 64 429                           | 2,54                      |
| Dutch Property Finance BV                                                                      |                                     |                                  |                           | 0,700 % éch.                                             |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 10/08/2031 (b)                                                                    | 18 626                              | 23 716                           | 0,93                      |
| 2,913 % éch. 28/10/2059                                                                        | 8 445                               | 9 662                            | 0,38                      | 30/11/2033 (b)                                           | 23 148                              | 25 664                           | 1,01                      | 0,125 % éch. 22/03/2039 (b)                                                                    | 4 049                               | 4 226                            | 0,17                      |
| Total Pays-Bas                                                                                 |                                     | 18 478                           | 0,73                      | 1,000 % éch.                                             |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 10/08/2041 (b)                                                                    | 17 039                              | 16 795                           | 0,66                      |
| <b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>                                                                        |                                     |                                  |                           | 30/11/2030 (b)                                           | 3 498                               | 4 017                            | 0,16                      | 0,125 % éch. 22/03/2044 (b)                                                                    | 9 456                               | 8 627                            | 0,34                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch. 31/10/2036                                  | 1 800                               | 2 067                            | 0,08                      | 0,125 % éch. 22/03/2046 (b)                                                                    | 6 428                               | 5 570                            | 0,22                      |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais                                        |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 31/01/2041                                  | 46 200                              | 51 783                           | 2,04                      | 0,125 % éch. 10/08/2048 (b)                                                                    | 6 227                               | 5 109                            | 0,20                      |
| 3,000 % éch. 20/09/2030                                                                        | NZD 58                              | 35                               | 0,00                      | 4,200 % éch. 31/01/2037                                  | 14 400                              | 17 668                           | 0,69                      | 0,125 % éch. 22/03/2051 (b)                                                                    | 14 213                              | 11 005                           | 0,43                      |
| 3,250 % éch. 20/09/2050                                                                        | 8 100                               | 4 864                            | 0,19                      | <b>Total Espagne</b>                                     |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 22/03/2056 (b)                                                                    | 4 925                               | 3 471                            | 0,14                      |
| Total Nouvelle-Zélande                                                                         |                                     | 4 899                            | 0,19                      |                                                          |                                     | 101 199                          | 3,98                      | 0,125 % éch. 22/03/2058 (b)                                                                    | 12 078                              | 8 335                            | 0,33                      |
| <b>ROYAUME-UNI</b>                                                                             |                                     |                                  |                           | <b>SUPRANATIONALES</b>                                   |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 22/11/2065 (b)                                                                    | 13 123                              | 8 130                            | 0,32                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                             |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 22/03/2068 (b)                                                                    | 11 780                              | 7 136                            | 0,28                      |
| Curzon Mortgages PLC                                                                           |                                     |                                  |                           | Union européenne                                         |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 22/03/2073 (b)                                                                    | 2 956                               | 1 857                            | 0,07                      |
| 4,592 % éch. 28/07/2049                                                                        | £ 5 000                             | 6 639                            | 0,26                      | 3,250 % éch. 12/12/2036                                  | 17 200                              | 19 569                           | 0,77                      | 0,250 % éch. 22/03/2052 (b)                                                                    | 8 057                               | 6 371                            | 0,25                      |
| <b>SUÈDE</b>                                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 12/12/2035                                  | 18 300                              | 21 224                           | 0,83                      | 0,375 % éch. 22/03/2062 (b)                                                                    | 19 887                              | 14 511                           | 0,57                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                   |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 12/10/2045                                  | 9 200                               | 10 384                           | 0,41                      | 0,500 % éch. 22/03/2050 (b)                                                                    | 20 734                              | 18 264                           | 0,72                      |
| Obligation internationale du gouvernement suédois                                              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 12/10/2055                                  | 14 400                              | 16 410                           | 0,65                      | 0,625 % éch. 22/03/2040 (b)                                                                    | 36 279                              | 39 767                           | 1,56                      |
| 0,125 % éch. 01/12/2027                                                                        | SEK 17 400                          | 1 775                            | 0,07                      | <b>Total Supranationales</b>                             |                                     |                                  |                           | 0,625 % éch. 22/11/2042 (b)                                                                    | 26 030                              | 27 142                           | 1,07                      |
| 0,125 % éch. 01/06/2032                                                                        | 72 942                              | 7 273                            | 0,29                      |                                                          |                                     | 67 587                           | 2,66                      | 0,625 % éch. 22/03/2045 (b)                                                                    | 11 498                              | 11 389                           | 0,45                      |
| 3,500 % éch. 01/12/2028                                                                        | 16 355                              | 1 787                            | 0,07                      | <b>SUÈDE</b>                                             |                                     |                                  |                           | 0,625 % éch. 22/10/2050                                                                        | 600                                 | 282                              | 0,01                      |
| Total Suède                                                                                    |                                     | 10 835                           | 0,43                      | <b>ROYAUME-UNI</b>                                       |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 22/11/2033 (b)                                                                    | 28 493                              | 36 143                           | 1,42                      |
| <b>ROYAUME-UNI</b>                                                                             |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                       |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 22/03/2034 (b)                                                                    | 18 019                              | 22 617                           | 0,89                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | <b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>                    |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 22/11/2047 (b)                                                                    | 19 701                              | 19 230                           | 0,76                      |
| 4,023 % éch. 25/09/2036                                                                        | \$ 168                              | 167                              | 0,01                      | <b>4,750 % éch. 22/10/2043</b>                           |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch. 22/11/2037 (b)                                                                    | 36 259                              | 44 493                           | 1,75                      |
| <b>Total Royaume-Uni</b>                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 22/11/2027 (b)                                                                    | 11 161                              | 14 977                           | 0,59                      |
|                                                                                                |                                     | 592 985                          | 23,34                     |                                                          |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 22/11/2032 (b)                                                                    | 56 125                              | 74 709                           | 2,94                      |
|                                                                                                |                                     | 691 572                          | 27,22                     |                                                          |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 22/11/2054 (b)                                                                    | 30 751                              | 31 715                           | 1,25                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch. 22/11/2055 (b)                                                                    | 1 724                               | 1 772                            | 0,07                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 22/09/2049 (b)                                                                    | 951                                 | 1 162                            | 0,05                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 26/01/2035                                                                        | 20 560                              | 28 299                           | 1,11                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/01/2060                                                                        | 898                                 | 928                              | 0,04                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/10/2063                                                                        | 198                                 | 203                              | 0,01                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 07/12/2055                                                                        | 15 200                              | 16 585                           | 0,65                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 31/07/2054                                                                        | 2 100                               | 2 343                            | 0,09                      |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 22/10/2043                                                                        | 9 400                               | 11 677                           | 0,46                      |

# Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                            |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 15/08/2032                                        | \$ 62                               | \$ 62                            | 0,00                      | 0,625 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/12/2033                                                                | \$ 761                              | \$ 788                           | 0,03                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                         |                                     |                                  |                           | 15/07/2032 (d)                                   | \$ 48 241                           | \$ 44 691                        | 1,76                      |
| Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through                          |                                     |                                  |                           | 4,453 % éch. 25/08/2036                                        | 1 850                               | 1 861                            | 0,07                      | 0,625 % éch. 15/02/2043                          | 24 299                              | 17 731                           | 0,70                      |
| Certificates                                                                           |                                     |                                  |                           | OBX Trust                                                      |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,723 % éch. 25/10/2035                                                                | 1 678                               | 1 616                            | 0,06                      | 4,413 % éch. 25/06/2057                                        | 83                                  | 82                               | 0,00                      | 15/07/2028 (d)                                   | 53 663                              | 52 483                           | 2,07                      |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                                                |                                     |                                  |                           | Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through     |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/10/2036                                                                | 4 539                               | 4 210                            | 0,17                      | Certificates                                                   |                                     |                                  |                           | 15/02/2042 (d)                                   | 32 856                              | 25 093                           | 0,99                      |
| Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           | 5,563 % éch. 25/04/2035                                        | 820                                 | 817                              | 0,03                      | 0,750 % éch. 15/02/2045                          | 23 455                              | 16 670                           | 0,66                      |
| 5,090 % éch. 15/04/2033                                                                | 69                                  | 69                               | 0,00                      | Sequoia Mortgage Trust                                         |                                     |                                  |                           | 0,875 % éch. 15/01/2029                          | 21 914                              | 21 324                           | 0,84                      |
| Carrington Mortgage Loan Trust                                                         |                                     |                                  |                           | 4,454 % éch. 19/10/2026                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 0,875 % éch. 15/02/2047                          | 24 550                              | 17 269                           | 0,68                      |
| 4,013 % éch. 25/04/2036                                                                | 10 146                              | 9 271                            | 0,36                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                 |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/02/2046                          | 30 898                              | 22 702                           | 0,89                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                    |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/08/2047                                        | 1 207                               | 1 154                            | 0,05                      | 1,000 % éch. 15/02/2048                          | 23 095                              | 16 446                           | 0,65                      |
| 4,053 % éch. 25/09/2036                                                                | 225                                 | 221                              | 0,01                      | 4,882 % éch. 25/09/2034                                        | 158                                 | 155                              | 0,01                      | 1,000 % éch. 15/02/2049                          | 43 131                              | 30 308                           | 1,19                      |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust          |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,723 % éch. 25/02/2036                                                                | 2 251                               | 2 218                            | 0,09                      | 4,113 % éch. 25/03/2035                                        | 142                                 | 130                              | 0,01                      | 15/10/2030 (d)                                   | 55 476                              | 53 883                           | 2,12                      |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                                   |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                  |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,049 % éch. 25/01/2032                                                                | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/12/2045                                        | 12                                  | 12                               | 0,00                      | 15/01/2033 (d)                                   | 60 913                              | 57 634                           | 2,27                      |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           | 1,250 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,863 % éch. 25/05/2037                                                                | 388                                 | 379                              | 0,01                      |                                                                |                                     | 8 988                            | 0,35                      | 15/04/2031 (d)                                   | 30 641                              | 29 695                           | 1,17                      |
| Encore Credit Receivables Trust                                                        |                                     |                                  |                           | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                              |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,663 % éch. 25/01/2036                                                                | 1 000                               | 980                              | 0,04                      | Fannie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | 15/07/2033 (d)                                   | 37 162                              | 35 657                           | 1,40                      |
| First Franklin Mortgage Loan Trust                                                     |                                     |                                  |                           | 4,967 % éch. 01/09/2044 -                                      |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,073 % éch. 25/07/2036                                                                | 567                                 | 550                              | 0,02                      | 01/10/2044                                                     | 12                                  | 13                               | 0,00                      | 15/02/2044 (d)                                   | 38 241                              | 31 243                           | 1,23                      |
| Home Equity Asset Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 6,133 % éch. 01/12/2030                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 1,500 % éch. 15/02/2053                          | 15 792                              | 12 010                           | 0,47                      |
| 4,618 % éch. 25/08/2034                                                                | 26                                  | 26                               | 0,00                      | Freddie Mac                                                    |                                     |                                  |                           | 1,625 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| Lehman XS Trust                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,022 % éch. 25/09/2031                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 15/10/2027 (d)                                   | 64 061                              | 63 764                           | 2,51                      |
| 6,063 % éch. 25/12/2037                                                                | 1 129                               | 1 171                            | 0,05                      | 4,023 % éch. 25/08/2031                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 1,625 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| Massachusetts Educational Financing Authority                                          |                                     |                                  |                           | 4,307 % éch. 15/12/2037                                        | 86                                  | 86                               | 0,00                      | 15/10/2029 (d)                                   | 87 820                              | 87 232                           | 3,43                      |
| 4,880 % éch. 25/04/2038                                                                | 14                                  | 14                               | 0,00                      | 4,944 % éch. 25/10/2044                                        | 139                                 | 130                              | 0,01                      | 1,625 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                                 |                                     |                                  |                           | 5,957 % éch. 01/07/2036                                        | 25                                  | 25                               | 0,00                      | 15/04/2030 (d)                                   | 53 443                              | 52 809                           | 2,08                      |
| 4,423 % éch. 25/01/2035                                                                | 794                                 | 778                              | 0,03                      | 6,181 % éch. 01/10/2036                                        | 10                                  | 11                               | 0,00                      | 1,750 % éch. 15/01/2034                          | 21 336                              | 20 853                           | 0,82                      |
| Saxon Asset Securities Trust                                                           |                                     |                                  |                           | 6,195 % éch. 01/09/2036                                        | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 1,875 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,073 % éch. 25/09/2037                                                                | 434                                 | 422                              | 0,02                      | Ginnie Mae                                                     |                                     |                                  |                           | 15/07/2034 (d)                                   | 52 626                              | 51 884                           | 2,04                      |
|                                                                                        |                                     | 22 881                           | 0,90                      | 3,500 % éch. 20/06/2052 -                                      |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | 20/01/2056                                                     | 55 548                              | 50 372                           | 1,98                      | 15/07/2035 (d)                                   | 54 434                              | 53 244                           | 2,10                      |
| Lehman Brothers Holdings, Inc.                                                         |                                     |                                  |                           | 4,927 % éch. 20/08/2068                                        | 1 474                               | 1 481                            | 0,06                      | 1,875 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 05/03/2010 ^                                                              | € 950                               | 4                                | 0,00                      | 5,625 % éch. 20/04/2030 -                                      |                                     |                                  |                           | 15/01/2036 (d)                                   | 54 508                              | 52 950                           | 2,08                      |
| 0,000 % éch. 05/04/2011 ^                                                              | 10                                  | 0                                | 0,00                      | 20/06/2030                                                     | 2                                   | 1                                | 0,00                      | 2,125 % éch. 15/04/2029                          | 28 201                              | 28 288                           | 1,11                      |
| RD Michigan Property Owner LLC                                                         |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 20/05/2030                                        | 11                                  | 12                               | 0,00                      | 2,125 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                                                | \$ 4 000                            | 3 989                            | 0,16                      | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | 15/01/2035 (d)                                   | 53 380                              | 53 271                           | 2,10                      |
|                                                                                        |                                     | 3 993                            | 0,16                      | 3,500 % éch. 01/07/2056                                        | 4 000                               | 3 593                            | 0,14                      | 2,125 % éch. 15/02/2040                          | 7 763                               | 7 492                            | 0,30                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 15/02/2041                          | 14 093                              | 13 467                           | 0,53                      |
| Banc of America Funding Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/09/2052 -                                      |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 15/02/2054                          | 22 130                              | 19 346                           | 0,76                      |
| 4,239 % éch. 20/01/2047                                                                | 733                                 | 635                              | 0,02                      | 01/11/2052                                                     | 1 607                               | 1 552                            | 0,06                      | 2,375 % éch. 15/10/2028                          | 16 848                              | 17 033                           | 0,67                      |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                                               |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 15/02/2055                          | 15 510                              | 14 283                           | 0,56                      |
| 4,642 % éch. 25/09/2035                                                                | 45                                  | 23                               | 0,00                      | 4,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 15/02/2056                          | 4 109                               | 3 789                            | 0,15                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                    |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                     | 33 950                              | 31 732                           | 1,25                      | 3,625 % éch.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,445 % éch. 25/09/2037                                                                | 153                                 | 147                              | 0,01                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           | 15/04/2028 (d)                                   | 63 566                              | 65 191                           | 2,57                      |
| 5,510 % éch. 25/09/2035                                                                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 01/08/2056                                                     | 196 100                             | 187 726                          | 7,39                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                     |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           | Total États-Unis                                 |                                     | 1 558 145                        | 61,32                     |
| 6,000 % éch. 25/04/2037                                                                | 636                                 | 536                              | 0,02                      | 01/08/2056                                                     | 10 200                              | 10 013                           | 0,39                      |                                                  |                                     | 1 906 041                        | 75,01                     |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                            |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                     | \$ 3 818 438                        | 150,27                           |                           |
| 3,509 % éch. 30/11/2037                                                                | 793                                 | 737                              | 0,03                      | 01/08/2056                                                     | 25 200                              | 25 275                           | 1,00                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                                  |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     | 312 034                          | 12,28                     | ACTIONS                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,334 % éch. 19/10/2045                                                                | 1 947                               | 1 785                            | 0,07                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                |                                     |                                  |                           | FONDS D'INVESTISSEMENT                           |                                     |                                  |                           |
| GSR Mortgage Loan Trust                                                                |                                     |                                  |                           | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)     |                                     |                                  |                           | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF                |                                     |                                  |                           |
| 4,837 % éch. 25/09/2035                                                                | 27                                  | 26                               | 0,00                      | 0,125 % éch. 15/10/2026                                        | 23 758                              | 23 631                           | 0,93                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds                   |                                     |                                  |                           |
| Impac CMB Trust                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/04/2027                                        | 21 107                              | 20 696                           | 0,81                      | PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c) | 2 714                               | 27                               | 0,00                      |
| 4,403 % éch. 25/03/2035                                                                | 726                                 | 717                              | 0,03                      | 0,125 % éch. 15/01/2030 (d)                                    | 31 962                              | 30 023                           | 1,18                      | FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE                         |                                     |                                  |                           |
| JPMorgan Mortgage Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/07/2030 (d)                                    | 45 708                              | 42 718                           | 1,68                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO                     |                                     |                                  |                           |
| 5,397 % éch. 25/07/2035                                                                | 106                                 | 104                              | 0,00                      | 0,125 % éch. 15/01/2031                                        | 24 811                              | 22 922                           | 0,90                      | Advantage Euro                                   |                                     |                                  |                           |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust                           |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/07/2031 (d)                                    | 96 132                              | 88 282                           | 3,47                      | Government Bond UCITS                            |                                     |                                  |                           |
| 4,394 % éch. 20/10/2029                                                                | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 0,125 % éch. 15/02/2032 (d)                                    | 49 362                              | 44 701                           | 1,76                      | ETF (c)                                          | 710 556                             | 20 620                           | 0,81                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/02/2051                                        | 12 545                              | 6 643                            | 0,26                      | Total des Fonds d'investissement                 | \$ 20 647                           | 0,81                             |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 15/07/2029 (d)                                    | 36 370                              | 34 698                           | 1,37                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 15/02/2050                                        | 5 957                               | 3 360                            | 0,13                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,375 % éch. 15/01/2027 (d)                                    | 35 503                              | 35 039                           | 1,38                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,375 % éch. 15/07/2027                                        | 7 513                               | 7 388                            | 0,29                      |                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 15/01/2028 (d)                                    | 111 119                             | 108 309                          | 4,26                      |                                                  |                                     |                                  |                           |

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

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

**CONTRATS À TERME STANDARDISÉS**

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Court | 09/2026           | 205                | \$ (82)                           | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Court | 09/2026           | 280                | (300)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre          | Long  | 09/2026           | 16                 | 13                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Long  | 09/2026           | 534                | 344                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 925                | 1 105                             | 0,04                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 301                | (453)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 178                | (475)                             | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 584                | (306)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Court | 09/2026           | 337                | (30)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026           | 22                 | (44)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 637                | 163                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 2 481              | 753                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026           | 1 811              | (1 699)                           | (0,07)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 54                 | 75                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 568                | 801                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Court | 09/2026           | 90                 | (118)                             | 0,00                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ (253)                          | (0,01)              |

**OPTIONS VENDUES****OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE**

| Description                                                                   | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|----------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor septembre 2026 | € 97,625        | 14/09/2026        | 1 148              | \$ (310) | \$ (57)      | 0,00                |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ (310) (0,01)

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)**

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

**SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT**

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(1)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 16/09/2031      | £ 43 510          | \$ (125)                          | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 16/06/2029      | ¥ 5 177 000       | (148)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 18/03/2036      | 3 987 800         | 575                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,237     | 21/11/2053      | \$ 2 000          | 612                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,865     | 13/02/2054      | 13 500            | 2 693                             | 0,11                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 267 570           | 3 411                             | 0,13                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 11 400            | 518                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 94 600            | (344)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 11 400            | 112                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 25 700            | (869)                             | (0,03)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 20 800            | 380                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,075     | 15/11/2053      | 21 636            | 369                               | 0,01                |
| À recevoir                        | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,465     | 08/12/2027      | € 17 700          | 59                                | 0,00                |
| À payer <sup>(1)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 55 070            | 749                               | 0,03                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2046      | 8 100             | (253)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 69 660            | (649)                             | (0,03)              |
| À recevoir                        | CPTFEMU                           | 1,529     | 15/05/2027      | 14 900            | 271                               | 0,01                |
| À recevoir                        | CPTFEMU                           | 1,843     | 15/02/2031      | 7 200             | 135                               | 0,01                |
| À recevoir                        | CPTFEMU                           | 1,998     | 15/07/2035      | 35 800            | (447)                             | (0,02)              |
| À recevoir                        | CPTFEMU                           | 2,178     | 15/10/2055      | 3 000             | 11                                | 0,00                |
| À payer                           | CPTFEMU                           | 2,280     | 15/04/2046      | 7 200             | 71                                | 0,00                |
| À recevoir                        | CPTFEMU                           | 2,359     | 15/08/2030      | 27 200            | 615                               | 0,02                |
| À payer                           | CPTFEMU                           | 2,680     | 15/04/2053      | 4 400             | 546                               | 0,02                |
| À recevoir                        | CPTFEMU                           | 2,720     | 15/06/2032      | 51 600            | (573)                             | (0,02)              |
| À payer                           | CPURNSA                           | 1,760     | 04/11/2029      | \$ 23 300         | (4 329)                           | (0,17)              |
| À payer                           | CPURNSA                           | 1,883     | 20/11/2029      | 300               | (53)                              | 0,00                |
| À payer                           | CPURNSA                           | 1,954     | 03/06/2029      | 6 200             | (1 033)                           | (0,04)              |
| À payer                           | CPURNSA                           | 1,998     | 25/07/2029      | 1 800             | (288)                             | (0,01)              |
| À payer                           | CPURNSA                           | 2,364     | 10/05/2028      | 800               | (94)                              | 0,00                |
| À payer                           | CPURNSA                           | 2,370     | 06/06/2028      | 12 900            | (1 530)                           | (0,06)              |
| À payer                           | CPURNSA                           | 2,379     | 09/07/2028      | 700               | (81)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | CPURNSA                           | 2,573     | 26/08/2028      | 2 200             | 196                               | 0,01                |
| À recevoir                        | CPURNSA                           | 2,645     | 10/09/2028      | 3 600             | 290                               | 0,01                |
| À recevoir                        | IPC Royaume-Uni                   | 3,105     | 15/12/2055      | £ 3 200           | (62)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | IPC Royaume-Uni                   | 3,391     | 15/08/2027      | 14 100            | (13)                              | 0,00                |
| À payer                           | IPC Royaume-Uni                   | 3,500     | 15/08/2034      | 5 400             | 179                               | 0,01                |
| À payer                           | IPC Royaume-Uni                   | 4,040     | 15/04/2029      | 11 500            | 325                               | 0,01                |
| À payer                           | IPC Royaume-Uni                   | 4,143     | 15/10/2032      | 7 800             | (14)                              | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 4,530 %   | 15/04/2028      | £ 15 700          | \$ (336)                          | (0,01)              |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni         | 4,615     | 15/02/2027      | 4 400             | 97                                | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ 973                            | 0,04                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ 973                            | 0,04                |

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

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

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

#### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description                      | Indice initial | Taux variable                                                 | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM          | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 78,177      | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035        | 7 800                            | \$ (356) | \$ (163)     | (0,01)              |

#### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,440 %         | 25/01/2027        | 7 400                            | \$ (66)    | \$ (12)      | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,440           | 25/01/2027        | 7 400                            | (66)       | (59)         | 0,00                |
| CBK          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 170 500                          | (615)      | (744)        | (0,03)              |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,350           | 07/01/2027        | 24 700                           | (225)      | (29)         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,350           | 07/01/2027        | 24 700                           | (225)      | (234)        | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,500           | 14/01/2027        | 50 400                           | (462)      | (99)         | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500           | 14/01/2027        | 50 400                           | (462)      | (352)        | (0,01)              |
| GST          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,450           | 03/03/2028        | 74 300                           | (254)      | (324)        | (0,01)              |
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000           | 27/08/2026        | 26 000                           | (150)      | (122)        | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 26 000                           | (150)      | (40)         | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (2 675) | \$ (2 015)   | (0,08)              |

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

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500 %              | 17/10/2057      | \$ 146                           | \$ (8)                 | \$ 8                              | \$ 0         | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                | 17/08/2061      | 2 500                            | (5)                    | 12                                | 7            | 0,00                |
|              |                             |                      |                 |                                  | \$ (13)                | \$ 20                             | \$ 7         | 0,00                |

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

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

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 31 207            | \$ 22 315          | \$ 695                | \$ 695                                  | 0,03                |
|              | 07/2026           | CNH             | 31 294            | 4 634              | 24                    | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 18 176            | 10 734             | 395                   | 395                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | SGD             | 340               | 267                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 555               | CAD 789            | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 989             | NZD 15 913         | 63                    | 63                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 788               | \$ 555             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 15 913            | 8 999              | 0                     | (63)                                    | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 313               | 60                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 245 270           | 1 542              | 33                    | 33                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 204 869           | 135                | 2                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 6 380             | 645                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 3 567             | 2 793              | 35                    | 35                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 092             | CNH 14 146         | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 183               | € 157              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 398             | NOK 12 975         | 0                     | (86)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 224               | PLN 847            | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 986             | \$ 1 004           | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 4 796             | 271                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 09/2026           | \$              | 3 724             | INR 353 926        | \$ 0                  | \$ (10)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 6 473             | \$ 1 251           | 4                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 3 960             | 2 869              | 78                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 776             | 2 258              | 56                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 17 244            | 2 548              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 21 346            | 24 348             | 0                     | (57)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 503 814           | 675 088            | 6 432                 | (30)                                    | 0,25                |
|              | 07/2026           | IDR             | 238 850 005       | 13 328             | 11                    | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 4 376             | 1 485              | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 439 892           | 4 580              | 0                     | (67)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 829 655           | 5 218              | 113                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 913 619           | 599                | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 430             | 145                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 62 584            | 1 908              | 26                    | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 839             | AUD 2 668          | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 299               | BRL 1 507          | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 23                | CAD 32             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 710               | CNY 4 844          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12 791            | INR 1 212 182      | 20                    | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 226             | ¥ 198 500          | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 155             | KRW 4 839 901      | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 559               | ZAR 9 175          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 819               | \$ 275             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 934             | BRL 9 848          | 0                     | (46)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 22 990 145        | \$ 1 266           | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 47 919            | 1 477              | 26                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 6 508             | IDR 115 731 932    | 10                    | (103)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 606               | INR 57 548         | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 280               | THB 9 176          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 829               | IDR 15 087 781     | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ILS             | 13 409            | \$ 4 599           | 97                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 196 055           | 1 213              | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 26 401            | 15 613             | 595                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | TRY             | 27 968            | 585                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 4 755             | TRY 225 557        | 50                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 790             | ZAR 45 311         | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
| BSH          | 08/2026           |                 | 1 213             | ¥ 195 541          | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 4 396 484         | \$ 27 652          | 600                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 14 386            | NZD 25 462         | 98                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 25 462            | \$ 14 402          | 0                     | (98)                                    | 0,00                |
| CBK          | 08/2026           | \$              | 32 408            | BRL 165 350        | 0                     | (710)                                   | 0,03                |
|              | 07/2026           | DKK             | 35 341            | \$ 5 515           | 110                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 6 555             | 7 645              | 151                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | £               | 3 816             | 5 119              | 54                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 17 461            | 6 006              | 144                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | INR             | 192 420           | 2 039              | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 7 570             | 816                | 51                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 219 015           | 23 704             | 1 074                 | 0                                       | 0,04                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 225             | € 1 051            | 0                     | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11 321            | £ 8 438            | 0                     | (122)                                   | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           |                 | 2 573             | IDR 46 170 537     | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 986             | INR 192 420        | 47                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 346               | KRW 522 729        | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 284               | PEN 966            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 037             | PLN 3 790          | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 9 791             | SEK 90 480         | 0                     | (442)                                   | 0,02                |
|              | 08/2026           | ILS             | 6 774             | \$ 2 342           | 66                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 683               | ILS 2 027          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 89 565 774        | \$ 4 961           | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 24 079            | 251                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 160 419           | 4 894              | 41                    | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 455             | IDR 25 955 372     | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 528               | MXN 9 445          | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 2 388             | IDR 43 417 841     | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 6 207 061         | \$ 347             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 67 542            | 715                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 409               | 320                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 477               | INR 46 039         | 8                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           |                 | 940               | NOK 8 733          | 0                     | (57)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 036             | PLN 3 844          | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 302             | ZAR 21 070         | 0                     | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 51 738 356        | \$ 2 871           | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 147             | IDR 20 831 061     | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 715               | INR 68 000         | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 01/2027           | DKK             | 13 174            | \$ 2 075           | 40                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 17 155            | 2 536              | 8                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 417 083           | 4 421              | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 101 975           | 642                | 14                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 43 816            | 34 345             | 469                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 8 346             | CNH 56 770         | 17                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 222 947           | £ 168 529          | 733                   | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           |                 | 4 371             | INR 417 083        | 36                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 122 868           | ¥ 19 880 019       | 0                     | (548)                                   | 0,02                |

# Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | \$              | 6 016             | PLN 22 058         | \$ 0                  | \$ (148)                                | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 6 065             | SEK 58 850         | 16                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 819             | ZAR 30 016         | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 56 645            | \$ 8 346           | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 168 529           | 222 940            | 0                     | (735)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 805             | 980                | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥               | 19 827 996        | 122 868            | 551                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | SEK             | 58 745            | 6 065              | 0                     | (16)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 136             | INR 204 647        | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 429               | MXN 7 567          | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 984 577           | \$ 638             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 882             | BRL 15 269         | 85                    | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 53 398            | CAD 75 985         | 160                   | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 2 450             | IDR 43 919 643     | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 638               | KRW 984 437        | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 75 877            | \$ 53 398          | 0                     | (160)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 3 144             | BRL 16 068         | 0                     | (64)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 480               | INR 46 076         | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 44 176 841        | \$ 2 450           | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 148             | 124                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 130 746           | 4 051              | 91                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4 187             | BRL 21 551         | 0                     | (85)                                    | 0,00                |
| IND JPM      | 09/2026           |                 | 5 089             | IDR 91 410 826     | 11                    | (33)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3 245             | INR 312 534        | 35                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3 966             | MXN 69 514         | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 21 968            | \$ 3 429           | 69                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 135 076           | 96 295             | 2 715                 | 0                                       | 0,11                |
|              | 07/2026           | BRL             | 19 481            | 3 786              | 22                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 5 220             | 773                | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 13 715            | 4 593              | 0                     | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 201 615           | 2 135              | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 304 241           | 197                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 7 402             | 748                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 089             | 643                | 24                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 874             | £ 4 377            | 0                     | (64)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 377               | IDR 6 772 582      | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 137             | INR 201 615        | 0                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 295               | KRW 453 616        | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 171             | MXN 20 884         | 23                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 8 043             | PLN 29 326         | 1                     | (242)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 373             | THB 45 908         | 9                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 11 082            | \$ 3 806           | 83                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 748               | NOK 7 405          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 7 007 312         | \$ 388             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 11 994            | 680                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| MBC          | 09/2026           | THB             | 113 462           | 3 469              | 46                    | (14)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | TWD             | 4 400             | 139                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 227             | INR 307 221        | 1                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2 830             | MXN 49 421         | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 3 786             | BRL 19 910         | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 26 273            | MXN 460 957        | 0                     | (247)                                   | (0,01)              |
|              | 01/2027           | DKK             | 11 896            | \$ 1 877           | 39                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 562               | 402                | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 17 358            | 22 404             | 538                   | (17)                                    | 0,02                |
|              | 07/2026           | €               | 28 334            | 32 879             | 485                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | IDR             | 604 188           | 34                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 67 809            | 718                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 4 096 630         | 25 782             | 576                   | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | KRW             | 3 526 286         | 2 326              | 49                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 444             | 247                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 482               | 52                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 63 127            | AUD 91 420         | 251                   | (43)                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 6 782             | DKK 44 457         | 17                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 382 570           | € 336 828          | 2 527                 | 0                                       | 0,10                |
|              | 07/2026           |                 | 1 107             | INR 106 714        | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 005             | ¥ 160 200          | 0                     | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 382               | NOK 3 544          | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 236             | NZD 2 190          | 10                    | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           |                 | 3 692             | SEK 35 938         | 22                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 87 694            | \$ 60 471          | 0                     | (248)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | DKK             | 44 380            | 6 782              | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 336 828           | 383 086            | 0                     | (2 527)                                 | (0,10)              |
|              | 08/2026           | ILS             | 327               | 109                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 35 874            | 3 692              | 0                     | (22)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 77                | NOK 764            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 39 245            | \$ 1 175           | 0                     | (13)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 3 058             | INR 292 618        | 15                    | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 7 996             | \$ 2 738           | 54                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 82                | € 72               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 145             | £ 2 352            | 2                     | (25)                                    | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 3 224             | SEK 30 145         | 0                     | (109)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 280             | IDR 40 652 915     | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 120             | INR 107 705        | 17                    | 0                                       | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SCX          | 07/2026           | \$              | 2 372 TRY         | 111 674            | \$ 11                 | \$ 0                                    | 11 0,00             |
|              | 09/2026           | IDR             | 40 880 905 \$     | 2 280              | 14                    | 0                                       | 14 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 1 144 IDR         | 20 349 381         | 0                     | (16)                                    | (16) 0,00           |
|              | 07/2026           | £               | 8 392 \$          | 11 292             | 153                   | 0                                       | 153 0,01            |
|              | 07/2026           | \$              | 1 312 BRL         | 6 790              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 662 CNY         | 11 346             | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 875 IDR           | 15 708 676         | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 473 INR         | 141 229            | 17                    | 0                                       | 17 0,00             |
|              | 07/2026           |                 | 1 856 ¥           | 294 900            | 0                     | (42)                                    | (42) 0,00           |
|              | 07/2026           |                 | 1 188 NZD         | 2 101              | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
| SOG          | 08/2026           |                 | 1 194 INR         | 114 446            | 10                    | 0                                       | 10 0,00             |
|              | 09/2026           | IDR             | 42 775 741 \$     | 2 370              | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | THB             | 46 458            | 1 439              | 32                    | 0                                       | 32 0,00             |
|              | 09/2026           | \$              | 2 916 IDR         | 52 338 734         | 4                     | (18)                                    | (14) 0,00           |
|              | 07/2026           | €               | 714 342 \$        | 833 309            | 16 601                | 0                                       | 16 601 0,65         |
|              | 07/2026           | ¥               | 10 667 563        | 67 148             | 1 511                 | 0                                       | 1 511 0,06          |
|              | 07/2026           | SGD             | 71                | 55                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 50 202 AUD        | 72 756             | 204                   | 0                                       | 204 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 547 CHF           | 442                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 473 501 €         | 416 264            | 2 414                 | 0                                       | 2 414 0,10          |
| SSB          | 07/2026           |                 | 90 179 £          | 68 183             | 317                   | 0                                       | 317 0,01            |
|              | 07/2026           |                 | 37 222 SGD        | 48 202             | 45                    | 0                                       | 45 0,00             |
|              | 08/2026           | AUD             | 72 756 \$         | 50 170             | 0                     | (206)                                   | (206) 0,01          |
|              | 08/2026           | CHF             | 441               | 547                | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 08/2026           | €               | 416 264           | 474 143            | 0                     | (2 410)                                 | (2 410) 0,09        |
|              | 08/2026           | £               | 68 183            | 90 176             | 0                     | (318)                                   | (318) 0,01          |
|              | 08/2026           | SGD             | 48 094            | 37 222             | 0                     | (47)                                    | (47) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 55 SGD            | 71                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | CAD             | 74 180 \$         | 53 795             | 1 510                 | 0                                       | 1 510 0,06          |
|              | 07/2026           | CHF             | 607               | 772                | 20                    | 0                                       | 20 0,00             |
| UAG          | 07/2026           | £               | 10 694            | 14 402             | 208                   | 0                                       | 208 0,01            |
|              | 07/2026           | \$              | 490 CAD           | 695                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | CAD             | 694 \$            | 490                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | €               | 16 277            | 18 582             | 0                     | (52)                                    | (52) 0,00           |
| WST          | 07/2026           | \$              | 1 055 PLN         | 3 854              | 0                     | (29)                                    | (29) 0,00           |
|              | 09/2026           | THB             | 7 410 \$          | 226                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
| WST          | 09/2026           | \$              | 3 038 MXN         | 53 279             | 0                     | (8)                                     | (8) 0,00            |
|              | 07/2026           | CHF             | 23 903            | 19 299             | 22                    | 0                                       | 22 0,00             |
|              | 08/2026           | CHF             | 19 229 \$         | 23 903             | 0                     | (22)                                    | (22) 0,00           |
|              |                   |                 |                   | \$ 44 419          | \$ (10 887)           | \$ 33 532                               | 1,32                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et Institutions en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 3 CHF             | 2                  | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 22 029            | 17 218             | 0                     | (683)                                   | (683) 0,03          |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 6 \$              | 7                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| SOG          | 07/2026           | \$              | 23 820 CHF        | 18 654             | 0                     | (694)                                   | (694) 0,03          |
|              | 07/2026           | CHF             | 18 450 \$         | 22 806             | 0                     | (67)                                    | (67) 0,00           |
| SSB          | 08/2026           | \$              | 22 806 CHF        | 18 384             | 67                    | 0                                       | 67 0,00             |
|              | 07/2026           | CHF             | 32 \$             | 40                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| WST          | 07/2026           | \$              | 23 487 CHF        | 18 463             | 0                     | (599)                                   | (599) 0,02          |
|              | 07/2026           | CHF             | 18 415 \$         | 22 808             | 0                     | (21)                                    | (21) 0,00           |
|              | 08/2026           | \$              | 22 808 CHF        | 18 349             | 22                    | 0                                       | 22 0,00             |
|              |                   |                 |                   | \$ 89              | \$ (2 064)            | \$ (1 975)                              | (0,08)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 2 219 €           | 1 906              | \$ 0                  | \$ (39)                                 | (39) 0,00           |
| BPS          | 07/2026           | €               | 413 \$            | 470                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 316 694 €         | 271 838            | 0                     | (5 902)                                 | (5 902) 0,23        |
| BSH          | 07/2026           |                 | 294 343           | 252 454            | 0                     | (5 712)                                 | (5 712) 0,23        |
| CBK          | 07/2026           |                 | 37 902            | 32 513             | 0                     | (730)                                   | (730) 0,03          |
| FAR          | 07/2026           | €               | 268 905 \$        | 306 686            | 0                     | (753)                                   | (753) 0,03          |
| MBC          | 08/2026           | \$              | 307 100 €         | 268 905            | 752                   | 0                                       | 752 0,03            |
|              | 07/2026           | €               | 283 076 \$        | 321 551            | 22                    | (2 112)                                 | (2 090) 0,08        |
| SOG          | 07/2026           | \$              | 3 971 €           | 3 418              | 0                     | (63)                                    | (63) 0,00           |
|              | 08/2026           |                 | 320 718           | 281 990            | 2 112                 | 0                                       | 2 112 0,08          |
|              | 07/2026           | €               | 281 541 \$        | 320 253            | 0                     | (1 633)                                 | (1 633) 0,06        |
|              | 07/2026           | \$              | 317 073 €         | 271 806            | 0                     | (6 318)                                 | (6 318) 0,25        |
|              | 08/2026           |                 | 320 688           | 281 541            | 1 631                 | 0                                       | 1 631 0,06          |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 517           | \$ (23 263)           | \$ (18 746)                             | (0,74)              |

## Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 12 503 £          | 9 313 \$           | 0                     | (142) \$                                | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | £               | 5 \$              | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 8 209             | 10 828             | 1                     | (69)                                    | (68)                |
|              | 07/2026           | \$              | 12 875 £          | 9 608              | 0                     | (123)                                   | (123)               |
|              | 08/2026           | £               | 16 \$             | 22                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 10 673 £          | 8 093              | 68                    | 0                                       | 68                  |
| BRC          | 07/2026           | £               | 4 \$              | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 108               | 145                | 2                     | 0                                       | 2                   |
| FAR          | 07/2026           | \$              | 904 £             | 672                | 0                     | (12)                                    | (12)                |
| JPM          | 07/2026           | £               | 15 \$             | 20                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 13 140 £          | 9 792              | 0                     | (143)                                   | (143)               |
| MBC          | 07/2026           | £               | 35 \$             | 47                 | 1                     | 0                                       | 1                   |
| MYI          | 07/2026           |                 | 2                 | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 2 079             | 2 735              | 0                     | (23)                                    | (23)                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 735 £           | 2 079              | 23                    | 0                                       | 23                  |
| SCX          | 07/2026           | £               | 9 467 \$          | 12 532             | 0                     | (34)                                    | (34)                |
|              | 08/2026           | \$              | 12 473 £          | 9 424              | 35                    | 0                                       | 35                  |
| SOG          | 07/2026           | £               | 9 353 \$          | 12 356             | 0                     | (58)                                    | (58)                |
|              | 08/2026           | \$              | 12 356 £          | 9 353              | 58                    | 0                                       | 58                  |
| SSB          | 07/2026           | £               | 106 \$            | 141                | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
|              | 08/2026           | \$              | 141 £             | 106                | 1                     | 0                                       | 1                   |
|              |                   |                 |                   | \$ 189             | \$ (605)              | \$ (416)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 68 831 SGD        | 87 767 \$          | 0                     | (976) \$                                | (0,04)              |
| BOA          | 07/2026           | SGD             | 74 693 \$         | 57 710             | 0                     | (38)                                    | (38)                |
|              | 07/2026           | \$              | 113 677 SGD       | 145 166            | 0                     | (1 445)                                 | (1 445)             |
|              | 08/2026           |                 | 57 710            | 74 522             | 38                    | 0                                       | 38                  |
| BRC          | 07/2026           |                 | 497               | 637                | 0                     | (5)                                     | (5)                 |
| DUB          | 07/2026           | SGD             | 91 029 \$         | 70 369             | 0                     | (8)                                     | (8)                 |
|              | 07/2026           | \$              | 78 424 SGD        | 100 035            | 0                     | (1 084)                                 | (1 084)             |
|              | 08/2026           |                 | 70 369            | 90 820             | 9                     | 0                                       | 9                   |
| FAR          | 07/2026           | SGD             | 90 674 \$         | 69 916             | 0                     | (186)                                   | (186)               |
|              | 07/2026           | \$              | 132 688 SGD       | 169 279            | 0                     | (1 814)                                 | (1 814)             |
|              | 08/2026           |                 | 69 916            | 90 466             | 187                   | 0                                       | 187                 |
| NSL          | 07/2026           | SGD             | 18 061 \$         | 13 949             | 0                     | (15)                                    | (15)                |
|              | 08/2026           | \$              | 13 949 SGD        | 18 019             | 14                    | 0                                       | 14                  |
| SOG          | 07/2026           | SGD             | 176 071 \$        | 135 962            | 0                     | (163)                                   | (163)               |
|              | 08/2026           | \$              | 135 962 SGD       | 175 675            | 170                   | 0                                       | 170                 |
|              |                   |                 |                   | \$ 418             | \$ (5 734)            | \$ (5 316)                              | (0,21)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 27                | 18                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 22                | 15                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 334 AUD         | 1 873              | 0                     | (36)                                    | (36)                |
|              | 07/2026           |                 | 479 NZD           | 820                | 0                     | (13)                                    | (13)                |
|              | 08/2026           |                 | 18 AUD            | 27                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 15 CAD            | 22                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           |                 | 25 ¥              | 3 900              | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
| BPS          | 07/2026           | £               | 2 748 \$          | 3 636              | 0                     | (11)                                    | (11)                |
|              | 07/2026           | ¥               | 37 690            | 234                | 2                     | 0                                       | 2                   |
|              | 07/2026           | \$              | 31 100 £          | 23 208             | 0                     | (297)                                   | (297)               |
|              | 07/2026           |                 | 83 ¥              | 13 192             | 0                     | (2)                                     | (2)                 |
|              | 08/2026           |                 | 57 DKK            | 373                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 50 £              | 38                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 32 NZD            | 54                 | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
| BSH          | 07/2026           | AUD             | 121 \$            | 84                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 440 ¥             | 69 904             | 0                     | (10)                                    | (10)                |
|              | 08/2026           |                 | 84 AUD            | 121                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 233 \$            | 164                | 2                     | 0                                       | 2                   |
|              | 07/2026           | \$              | 56 DKK            | 357                | 0                     | (1)                                     | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | 168 €             | 144                | 0                     | (3)                                     | (3)                 |
|              | 07/2026           |                 | 609 SEK           | 5 630              | 0                     | (28)                                    | (28)                |
|              | 08/2026           |                 | 0                 | 4                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           |                 | 9 AUD             | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD             | 56 \$             | 39                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 285 643           | 1 765              | 8                     | 0                                       | 8                   |
|              | 07/2026           | NZD             | 81                | 46                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 2 959             | 305                | 0                     | (1)                                     | (1)                 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |        | Devise à recevoir |         | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |         | Plus-value/ (moins-value) latente nette |         | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|--------|-------------------|---------|--------------------|-----|-----------------------|---------|-----------------------------------------|---------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | \$              | 78     | AUD               | 109     | \$                 | 0   | \$                    | (2)     | \$                                      | (2)     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10     | ¥                 | 1 621   |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 39     | AUD               | 56      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 765  | ¥                 | 284 896 |                    | 0   |                       | (8)     |                                         | (8)     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 46     | NZD               | 81      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 305    | SEK               | 2 954   |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 2 113  | \$                | 1 485   |                    | 0   |                       | (4)     |                                         | (4)     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 485  | CAD               | 2 110   |                    | 4   |                       | 0       |                                         | 4       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 100    | DKK               | 638     |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 533  | \$                | 1 072   |                    | 10  |                       | 0       |                                         | 10      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | \$              | 4      | NZD               | 7       |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 1 072  | AUD               | 1 533   |                    | 0   |                       | (10)    |                                         | (10)    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 27     | \$                | 18      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK             | 1 292  |                   | 197     |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)     | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 3 180  |                   | 3 646   |                    | 10  |                       | 0       |                                         | 10      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 794    |                   | 454     |                    | 3   |                       | 0       |                                         | 3       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 2 465  |                   | 254     |                    | 1   |                       | (1)     |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 198    | €                 | 170     |                    | 0   |                       | (3)     |                                         | (3)     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 410    | ¥                 | 65 137  |                    | 0   |                       | (9)     |                                         | (9)     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 18     | AUD               | 27      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
| NSL          | 08/2026           |                 | 197    | DKK               | 1 290   |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 455    | NZD               | 794     |                    | 0   |                       | (3)     |                                         | (3)     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 186    | SEK               | 1 804   |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 8      | \$                | 10      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 10     | £                 | 8       |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 21     | SEK               | 202     |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 287    | \$                | 203     |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 19 559 |                   | 25 888  |                    | 0   |                       | (71)    |                                         | (71)    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 25 887 | £                 | 19 559  |                    | 72  |                       | 0       |                                         | 72      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 24 063 | \$                | 27 372  |                    | 0   |                       | (140)   |                                         | (140)   | (0,01)              |
| SOG          | 07/2026           | £               | 894    |                   | 1 180   |                    | 0   |                       | (6)     |                                         | (6)     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1      | AUD               | 1       |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 104    | DKK               | 670     |                    | 0   |                       | (2)     |                                         | (2)     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 31 413 | €                 | 26 929  |                    | 0   |                       | (626)   |                                         | (626)   | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 068  | ¥                 | 169 615 |                    | 0   |                       | (24)    |                                         | (24)    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 12     | CAD               | 18      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 27 409 | €                 | 24 063  |                    | 139 |                       | 0       |                                         | 139     | 0,01                |
|              | 08/2026           |                 | 1 180  | £                 | 894     |                    | 6   |                       | 0       |                                         | 6       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 19     | \$                | 14      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 783  | CAD               | 2 459   |                    | 0   |                       | (50)    |                                         | (50)    | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           |                 | 14     |                   | 19      |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0       | 0,00                |
|              |                   |                 |        |                   |         | \$                 | 261 | \$                    | (1 366) | \$                                      | (1 105) | (0,04)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 3 803 0,15

Total des Investissements

\$ 3 843 551 151,26

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (1 302 470) (51,26)

Actif net

\$ 2 541 081 100,00

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

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

(c) Affilié au Fonds.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 1 148 332 \$ (31 décembre 2025 : 1 223 034 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 4 552 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 30 juin 2026.

Un titre d'une juste valeur globale de 580 \$ (31 décembre 2025 : 584 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 30 001 \$ (31 décembre 2025 : 20 708 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 11 360 \$ (31 décembre 2025 : 18 450 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 3 785 250                                         | \$ 33 188                                         | \$ 3 818 438        |
| Fonds d'investissement                        | 20 647                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 20 647              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (403)                                                                             | 4 869                                                | 0                                                 | 4 466               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 20 244</b>                                                                  | <b>\$ 3 790 119</b>                                  | <b>\$ 33 188</b>                                  | <b>\$ 3 843 551</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 3 206 938                                         | \$ 22 696                                         | \$ 3 229 634        |
| Fonds d'investissement                        | 60                                                                                | 9 518                                                | 0                                                 | 9 578               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 105                                                                             | (3 224)                                              | 0                                                 | (2 119)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 165</b>                                                                   | <b>\$ 3 213 232</b>                                  | <b>\$ 22 696</b>                                  | <b>\$ 3 237 093</b> |

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

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | 2,300 %        | 10/06/2026        | 29/07/2026      | € (43 694)       | \$ (50 022)                              | (1,97)              |
| BSN                                           | 3,720          | 09/06/2026        | 15/07/2026      | \$ (447 236)     | (448 252)                                | (17,64)             |
| CIB                                           | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026      | (177 200)        | (177 693)                                | (6,99)              |
| DEU                                           | 3,710          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (3 483)          | (3 483)                                  | (0,14)              |
|                                               | 3,730          | 26/06/2026        | 06/07/2026      | (596)            | (596)                                    | (0,02)              |
|                                               | 3,740          | 22/06/2026        | 06/07/2026      | (8 007)          | (8 015)                                  | (0,32)              |
| JPS                                           | 3,720          | 16/06/2026        | 07/07/2026      | (10 043)         | (10 058)                                 | (0,40)              |
|                                               | 3,740          | 23/06/2026        | 07/07/2026      | (1 908)          | (1 909)                                  | (0,07)              |
| NOM                                           | 3,720          | 11/06/2026        | 09/07/2026      | (35 609)         | (35 682)                                 | (1,40)              |
| STR                                           | 3,740          | 30/06/2026        | 01/07/2026      | (335 292)        | (335 327)                                | (13,20)             |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (1 071 037)</b>                    | <b>(42,15)</b>      |

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

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (49)                                                    | \$ 0                    | \$ (49)                           | \$ 382                                                     | \$ (270)                | \$ 112                            |
| BOA          | (1 523)                                                    | 1 760                   | 237                               | (10 854)                                                   | 11 580                  | 726                               |
| BPS          | 90                                                         | (1 070)                 | (980)                             | (194)                                                      | 310                     | 116                               |
| BRC          | 631                                                        | (700)                   | (69)                              | 3 477                                                      | (3 860)                 | (383)                             |
| BSH          | (5 832)                                                    | 6 280                   | 448                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| CBK          | (396)                                                      | 390                     | (6)                               | 157                                                        | 0                       | 157                               |
| DUB          | (1 106)                                                    | 1 320                   | 214                               | 63                                                         | 0                       | 63                                |
| FAR          | (1 372)                                                    | 1 290                   | (82)                              | (575)                                                      | 580                     | 5                                 |
| GLM          | (854)                                                      | (970)                   | (1 824)                           | (568)                                                      | (1 320)                 | (1 888)                           |
| GST          | (324)                                                      | 320                     | (4)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| IND          | 67                                                         | 0                       | 67                                | (1 048)                                                    | 1 330                   | 282                               |
| JPM          | 1 511                                                      | (1 820)                 | (309)                             | (881)                                                      | 850                     | (31)                              |
| MBC          | 856                                                        | (820)                   | 36                                | 2 397                                                      | (2 720)                 | (323)                             |
| MYI          | (78)                                                       | 0                       | (78)                              | 830                                                        | (1 130)                 | (300)                             |
| NSL          | 19                                                         | 0                       | 19                                | (8)                                                        | 0                       | (8)                               |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 7                                                          | 0                       | 7                                 |
| SAL          | 7                                                          | 0                       | 7                                 | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| SCX          | 171                                                        | (270)                   | (99)                              | 189                                                        | (20)                    | 169                               |
| SOG          | 10 983                                                     | (11 050)                | (67)                              | (2 587)                                                    | 2 660                   | 73                                |
| SSB          | 1 037                                                      | (1 160)                 | (123)                             | 31                                                         | 0                       | 31                                |
| UAG          | (36)                                                       | 0                       | (36)                              | (533)                                                      | 880                     | 347                               |
| WST          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | (175)                                                      | 260                     | 85                                |

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

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 74,12            | 66,86                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 14,53            | 13,14                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,25             | 0,28                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,48             | 0,24                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,08             | 0,05                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,28             | 0,41                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,16             | 0,48                 |
| Autres actifs                                                    | 9,10             | 18,54                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                             | 5,09             | 4,33                 |
| Canada                                                                                                | 1,18             | 1,35                 |
| Îles Caïmans                                                                                          | 0,01             | 0,23                 |
| Colombie                                                                                              | 0,12             | S/O                  |
| Danemark                                                                                              | 0,52             | 3,49                 |
| France                                                                                                | 8,70             | 9,74                 |
| Allemagne                                                                                             | 1,35             | 7,33                 |
| Hongrie                                                                                               | S/O              | 0,19                 |
| Irlande                                                                                               | 5,25             | 6,13                 |
| Italie                                                                                                | 8,93             | 10,23                |
| Japon                                                                                                 | 5,15             | 6,04                 |
| Luxembourg                                                                                            | 0,62             | 0,45                 |
| Mexique                                                                                               | 0,11             | S/O                  |
| Pays-Bas                                                                                              | 0,73             | S/O                  |
| Nouvelle-Zélande                                                                                      | 0,19             | 0,67                 |
| Pérou                                                                                                 | S/O              | 0,02                 |
| Pologne                                                                                               | 0,09             | S/O                  |
| Portugal                                                                                              | 0,31             | S/O                  |
| Qatar                                                                                                 | 0,09             | S/O                  |
| Roumanie                                                                                              | 1,79             | 0,59                 |
| Arabie saoudite                                                                                       | 0,10             | 0,80                 |
| Espagne                                                                                               | 4,62             | 6,37                 |
| Supranationales                                                                                       | 2,66             | 3,35                 |
| Suède                                                                                                 | 0,43             | 1,12                 |
| Émirats arabes unis                                                                                   | S/O              | 0,26                 |
| Royaume-Uni                                                                                           | 27,22            | 28,08                |
| États-Unis                                                                                            | 75,01            | 82,50                |
| Fonds d'investissement                                                                                | 0,81             | 0,51                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | (0,01)           | 0,06                 |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | 0,00             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                              |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                               | 0,04             | 0,36                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                              |                  |                      |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options plafonnées sur l'inflation                                                                    | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                           | (0,08)           | (0,08)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                      | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                                            | 1,32             | (1,29)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                   | (1,08)           | 0,85                 |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b>                                                         | <b>(51,26)</b>   | <b>(73,67)</b>       |
| <b>Actif net</b>                                                                                      | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

# Tableau des investissements Fonds Income Fund

| DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES              |                                     |                                  |                           | 11,039 % éch. 07/06/2028                                                 | \$ 11 400                           | \$ 11 389                        | 0,01                      | BGC Group, Inc.                                                                              |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS |                                     |                                  |                           | Ambac Assurance Corp.<br>5,100 %                                         |                                     | 0                                | 0,00                      | 6,600 % éch. 10/06/2029                                                                      | \$ 41 800                           | \$ 43 112                        | 0,04                      |
| Altice France S.A.              |                                     |                                  |                           | American Express Co.<br>4,009 % éch. 09/02/2029                          | 23 300                              | 23 098                           | 0,02                      | Blue Owl Capital Corp.<br>6,450 % éch. 15/09/2028                                            | 119 900                             | 121 471                          | 0,10                      |
| 6,579 % éch. 30/04/2028         | € 36 962                            | \$ 42 444                        | 0,03                      | 4,444 % éch. 03/05/2030                                                  | 58 800                              | 58 446                           | 0,05                      | Blue Ridge Re Ltd.<br>7,020 % éch. 08/01/2029                                                | 2 600                               | 2 601                            | 0,00                      |
| 6,579 % - 8,736 % éch           |                                     |                                  |                           | American Honda Finance Corp.<br>4,257 % éch. 11/12/2026                  | 3 500                               | 3 503                            | 0,00                      | 8,770 % éch. 08/01/2031                                                                      | 11 486                              | 11 587                           | 0,01                      |
| 30/10/2028                      | 59 518                              | 68 235                           | 0,05                      | 4,350 % éch. 22/10/2027                                                  | 500                                 | 500                              | 0,00                      | 9,520 % éch. 08/01/2029                                                                      | 900                                 | 903                              | 0,00                      |
| 6,579 % - 8,736 % éch           |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 12/03/2027                                                  | 5 200                               | 5 217                            | 0,00                      | BNP Paribas Issuance BV<br>0,000 % éch. 09/04/2029                                           | 10                                  | 1 750 567                        | 1,40                      |
| 30/10/2028                      | \$ 74 465                           | 74 512                           | 0,06                      | 5,250 % éch. 07/07/2026                                                  | 500                                 | 500                              | 0,00                      | BNP Paribas S.A.<br>1,904 % éch. 30/09/2028                                                  | 2 300                               | 2 225                            | 0,00                      |
| 7,798 % éch. 30/04/2028         | 38 693                              | 38 903                           | 0,03                      | American Tower Corp.<br>3,650 % éch. 15/03/2027                          | 300                                 | 298                              | 0,00                      | 3,132 % éch. 20/01/2033 (l)                                                                  | 8 200                               | 7 430                            | 0,01                      |
| 9,048 % éch. 14/05/2029         | 23 684                              | 23 790                           | 0,02                      | Armor Holdco, Inc.<br>8,500 % éch. 15/11/2029                            | 800                                 | 805                              | 0,00                      | 4,892 % éch. 30/06/2030                                                                      | 102 600                             | 102 601                          | 0,08                      |
| 9,079 % éch. 30/05/2031         | € 39 374                            | 46 004                           | 0,04                      | Armor RE Ltd.<br>8,810 % éch. 07/06/2033                                 | 1 400                               | 1 399                            | 0,00                      | 5,497 % éch. 20/05/2030                                                                      | 39 700                              | 40 421                           | 0,03                      |
| 10,548 % éch. 31/05/2031        | \$ 261 956                          | 267 981                          | 0,21                      | 12,050 % éch. 07/01/2032                                                 | 2 700                               | 2 850                            | 0,00                      | Bonanza RE Ltd.<br>3,510 % éch. 08/01/2027                                                   | 3 000                               | 2 730                            | 0,00                      |
| Avolon TLB Borrower U.S. LLC    |                                     |                                  |                           | 13,750 % éch. 07/05/2031                                                 | 6 800                               | 7 073                            | 0,01                      | BPCE S.A.<br>2,277 % éch. 20/01/2032                                                         | 7 500                               | 6 633                            | 0,01                      |
| 5,389 % éch. 24/06/2030         | 4 021                               | 4 026                            | 0,00                      | 18,560 % éch. 07/06/2033                                                 | 2 900                               | 2 886                            | 0,00                      | 4,760 % éch. 13/01/2032                                                                      | 74 400                              | 73 357                           | 0,06                      |
| Discovery Global Holdings, Inc. | 381 323                             | 381 903                          | 0,31                      | Army Hawaii Family Housing Trust Certificates<br>4,140 % éch. 15/06/2050 | 98 745                              | 70 770                           | 0,06                      | 5,184 % éch. 02/06/2032 (l)                                                                  | 68 800                              | 68 702                           | 0,06                      |
| 6,144 % éch. 03/06/2033         |                                     |                                  |                           | Athene Global Funding<br>3,204 % éch. 23/02/2027                         | € 98 000                            | 112 268                          | 0,09                      | 5,876 % éch. 14/01/2031                                                                      | 7 350                               | 7 553                            | 0,01                      |
| Ecopetrol S.A.                  | 90 450                              | 90 778                           | 0,07                      | Avolon Holdings Funding Ltd.<br>2,528 % éch. 18/11/2027                  | \$ 72 685                           | 70 551                           | 0,06                      | 5,936 % éch. 30/05/2035                                                                      | 73 000                              | 74 928                           | 0,06                      |
| 5,843 % éch. 18/12/2027         |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 15/02/2027                                                  | 7 900                               | 7 834                            | 0,01                      | 6,293 % éch. 14/01/2036                                                                      | 49 120                              | 51 341                           | 0,04                      |
| Envalior Finance GmbH           | € 62 100                            | 66 080                           | 0,05                      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>4,150 % éch. 03/03/2029          | 39 800                              | 39 227                           | 0,03                      | 6,612 % éch. 19/10/2027                                                                      | 208 250                             | 209 506                          | 0,17                      |
| 7,650 % éch. 29/03/2030         | € 110 060                           | 96 126                           | 0,08                      | 4,968 % éch. 08/05/2031                                                  | 147 000                             | 146 805                          | 0,12                      | 6,714 % éch. 19/10/2029                                                                      | 192 850                             | 200 463                          | 0,16                      |
| 9,163 % éch. 29/03/2030         | \$ 110 060                          | 96 126                           | 0,08                      | 5,381 % éch. 13/03/2029                                                  | 84 800                              | 86 449                           | 0,07                      | 7,003 % éch. 19/10/2034                                                                      | 152 500                             | 166 118                          | 0,13                      |
| Flutter Financing BV            |                                     |                                  |                           | 6,138 % éch. 14/09/2028                                                  | 17 200                              | 17 517                           | 0,01                      | Buttonwood RE Ltd.<br>8,550 % éch. 29/05/2029                                                | 400                                 | 400                              | 0,00                      |
| 5,482 % éch. 30/11/2030         | 9 848                               | 9 777                            | 0,01                      | Banco Espirito Santo S.A.<br>2,625 % éch. 08/05/2017 ^                   | € 16 200                            | 4 353                            | 0,00                      | 9,050 % éch. 29/05/2029                                                                      | 500                                 | 500                              | 0,00                      |
| Forward Air Corp.               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^                                                | 8 100                               | 2 176                            | 0,00                      | 10,050 % éch. 29/05/2029                                                                     | 700                                 | 700                              | 0,00                      |
| 8,163 % éch. 19/12/2030         | 119                                 | 113                              | 0,00                      | Banco Santander S.A.<br>1,722 % éch. 14/09/2027                          | \$ 4 800                            | 4 773                            | 0,00                      | 11,550 % éch. 29/05/2029                                                                     | 800                                 | 800                              | 0,00                      |
| FPS Finance Co. LLC             | 23 000                              | 23 000                           | 0,02                      | 3,250 % éch. 02/04/2029                                                  | € 40 400                            | 46 328                           | 0,04                      | CA Immobilien Anlagen AG<br>3,500 % éch. 07/07/2029 (c)                                      | € 24 400                            | 27 776                           | 0,02                      |
| 6,590 % éch. 26/05/2028         |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 11/04/2027                                                  | \$ 2 800                            | 2 797                            | 0,00                      | CaixaBank S.A.<br>4,818 % éch. 22/04/2032                                                    | \$ 20 300                           | 20 141                           | 0,02                      |
| Jane Street Group LLC           | 58 734                              | 58 274                           | 0,05                      | 4,867 % éch. 15/04/2031                                                  | 8 400                               | 8 355                            | 0,01                      | 6,208 % éch. 18/01/2029                                                                      | 78 650                              | 80 489                           | 0,07                      |
| 5,666 % éch. 15/12/2031         |                                     |                                  |                           | 5,017 % éch. 14/03/2028                                                  | 37 600                              | 37 796                           | 0,03                      | 6,684 % éch. 13/09/2027                                                                      | 27 300                              | 27 415                           | 0,02                      |
| Lealand Finance Co. BV          |                                     |                                  |                           | 5,538 % éch. 14/03/2030                                                  | 68 700                              | 70 020                           | 0,06                      | Cape Lookout Re Ltd.<br>8,770 % éch. 21/03/2033                                              | 6 900                               | 6 831                            | 0,01                      |
| 3,000 % - 4,758 % éch           | 7 627                               | 7 379                            | 0,01                      | 5,552 % éch. 14/03/2028                                                  | 64 100                              | 64 518                           | 0,05                      | 9,520 % éch. 21/03/2033                                                                      | 6 850                               | 6 845                            | 0,01                      |
| 31/12/2027                      | 2 771                               | 2 682                            | 0,00                      | 5,565 % éch. 17/01/2030                                                  | 52 200                              | 53 520                           | 0,04                      | 10,420 % éch. 13/03/2032                                                                     | 21 900                              | 22 872                           | 0,02                      |
| 6,758 % éch. 30/06/2027         |                                     |                                  |                           | 6,527 % éch. 07/11/2027                                                  | 41 800                              | 42 101                           | 0,03                      | 12,226 % éch. 05/04/2027                                                                     | 4 900                               | 4 891                            | 0,00                      |
| Mercury Aggregator LP           | 34 862                              | 0                                | 0,00                      | 6,607 % éch. 07/11/2028                                                  | 26 200                              | 27 382                           | 0,02                      | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF<br>3,875 % éch. 28/05/2031                   | € 27 700                            | 31 810                           | 0,03                      |
| 0,000 % éch. 03/04/2027         |                                     |                                  |                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>5,343 % éch. 29/06/2029                     | 93 800                              | 94 184                           | 0,08                      | CBRE Services, Inc.<br>5,250 % éch. 01/06/2036                                               | \$ 53 900                           | 53 173                           | 0,04                      |
| MPH Acquisition Holdings LLC    |                                     |                                  |                           | Bank of America Corp.<br>3,419 % éch. 20/12/2028                         | 47 300                              | 46 516                           | 0,04                      | Charles River Re Ltd.<br>11,152 % éch. 10/05/2031                                            | 1 400                               | 1 417                            | 0,00                      |
| 7,413 % éch. 31/12/2030         | 8 118                               | 8 145                            | 0,01                      | 3,615 % éch. 16/03/2028 (k)                                              | \$ 37 900                           | 26 829                           | 0,02                      | CI Financial Corp.<br>4,625 % éch. 12/12/2031                                                | € 100 000                           | 115 903                          | 0,09                      |
| OCS Group Holdings Ltd.         | £ 0                                 | 0                                | 0,00                      | 4,477 % éch. 23/04/2030                                                  | \$ 41 500                           | 41 244                           | 0,03                      | 7,500 % éch. 30/05/2029                                                                      | \$ 39 800                           | 41 727                           | 0,03                      |
| 8,981 % éch. 28/11/2031         |                                     |                                  |                           | 5,202 % éch. 25/04/2029 (l)                                              | 40 100                              | 40 480                           | 0,03                      | Citadel Finance LLC<br>4,750 % éch. 14/02/2029                                               |                                     |                                  |                           |
| Poseidon Bidco SASU             | € 42 400                            | 14 058                           | 0,01                      | Banque de Montréal<br>4,309 % éch. 01/06/2027                            | CAD 20 800                          | 14 824                           | 0,01                      | 5,150 % éch. 14/02/2031                                                                      | 46 500                              | 45 782                           | 0,04                      |
| 7,504 % éch. 13/03/2030         | € 42 400                            | 14 058                           | 0,01                      | Bank of Nova Scotia<br>4,247 % éch. 02/02/2030                           | \$ 42 100                           | 41 590                           | 0,03                      | 22 850                                                                                       | 22 335                              | 0,02                             |                           |
| Project Dorchester              |                                     |                                  |                           | 4,638 % éch. 08/09/2028                                                  | 33 400                              | 33 563                           | 0,03                      | Citadel Securities Global Holdings LLC<br>5,125 % éch. 27/01/2032                            | 47 900                              | 47 338                           | 0,04                      |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (k)     | 25 000                              | 28 582                           | 0,02                      | Barclays PLC<br>2,279 % éch. 24/11/2027                                  | 10 969                              | 10 874                           | 0,01                      | 5,500 % éch. 18/06/2030                                                                      | 14 750                              | 14 943                           | 0,01                      |
| République du Panama            |                                     |                                  |                           | 4,219 % éch. 24/05/2030                                                  | 42 100                              | 41 403                           | 0,03                      | 5,750 % éch. 27/03/2036                                                                      | 72 000                              | 71 491                           | 0,06                      |
| 3,886 % éch. 05/03/2027         | 74 800                              | 85 650                           | 0,07                      | 4,476 % éch. 11/11/2029                                                  | 19 500                              | 19 367                           | 0,02                      | Citrus Re Ltd.<br>9,060 % éch. 07/06/2033                                                    | 2 350                               | 2 383                            | 0,00                      |
| 4,979 % éch. 01/04/2027         | 233 400                             | 268 646                          | 0,22                      | 4,837 % éch. 10/09/2028                                                  | 51 700                              | 51 796                           | 0,04                      | 10,039 % éch. 07/06/2033                                                                     | 2 150                               | 2 180                            | 0,00                      |
| State Oil, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 4,942 % éch. 10/09/2030                                                  | 3 400                               | 3 407                            | 0,00                      | CNO Global Funding<br>4,875 % éch. 10/12/2027                                                | 14 500                              | 14 509                           | 0,01                      |
| TBD % éch. 24/03/2031           | \$ 64 700                           | 63 988                           | 0,05                      | 4,972 % éch. 16/05/2029                                                  | 89 115                              | 89 494                           | 0,07                      | 5,875 % éch. 04/06/2027                                                                      | 36 800                              | 37 221                           | 0,03                      |
| Subcalidora                     | € 51 900                            | 59 019                           | 0,05                      | 5,128 % éch. 12/03/2028                                                  | 76 800                              | 77 267                           | 0,06                      | Commonwealth RE Ltd.<br>7,407 % éch. 08/07/2030                                              | 5 542                               | 5 543                            | 0,00                      |
| 8,041 % éch. 14/08/2029         | € 51 900                            | 59 019                           | 0,05                      | 5,501 % éch. 09/08/2028                                                  | 41 084                              | 41 454                           | 0,03                      | Constellation Pharmaceuticals, Inc.<br>5,550 % éch. 01/07/2033 (k)                           | 28 394                              | 28 845                           | 0,02                      |
| Syniverse Holdings, Inc.        | \$ 38 305                           | 33 407                           | 0,03                      | 5,674 % éch. 12/03/2030                                                  | 18 294                              | 18 443                           | 0,02                      | Cooperative Rabobank UA<br>6,500 %                                                           | € 78 850                            | 101 837                          | 0,08                      |
| 10,732 % éch. 13/05/2027        |                                     |                                  |                           | 5,690 % éch. 12/03/2030                                                  | 22 400                              | 22 869                           | 0,02                      | Corebridge Global Funding<br>4,900 % éch. 03/12/2029                                         | \$ 4 900                            | 4 903                            | 0,00                      |
| TransDigm, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 6,490 % éch. 13/09/2029                                                  | 7 300                               | 7 557                            | 0,01                      | Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % en numéraire ou 11,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 5,894 % éch. 22/03/2030         | 43 682                              | 43 734                           | 0,04                      | 6,496 % éch. 13/09/2027                                                  | 26 700                              | 26 800                           | 0,02                      | 10,000 % éch. 31/12/2026 (d)                                                                 | € 742                               | 785                              | 0,00                      |
| 6,144 % éch. 28/02/2031         | 86 704                              | 86 817                           | 0,07                      | 7,385 % éch. 02/11/2028                                                  | 21 400                              | 22 136                           | 0,02                      |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 19/01/2032         | 5 686                               | 5 693                            | 0,00                      | 7,437 % éch. 02/11/2033                                                  | 9 963                               | 11 108                           | 0,01                      |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 19/08/2032         | 40 398                              | 40 451                           | 0,03                      | Bayou Re Ltd.<br>10,020 % éch. 09/05/2033                                | 3 800                               | 3 790                            | 0,00                      |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O. |                                     |                                  |                           | 11,852 % éch. 30/04/2031                                                 | 3 000                               | 3 102                            | 0,00                      |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,401 % éch. 15/12/2028         | € 10 600                            | 12 166                           | 0,01                      | 22,020 % éch. 30/04/2031                                                 | 3 500                               | 3 768                            | 0,00                      |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| U.S. Renal Care, Inc.           |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 8,758 % éch. 28/06/2028         | \$ 24 354                           | 24 011                           | 0,02                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Westmoreland Coal Co.           |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 15/03/2029         | 1 428                               | 821                              | 0,00                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     | 2 077 195                        | 1,67                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS   |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| BANQUE ET FINANCE               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 123 Lights Re Ltd.              |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 14,520 % éch. 14/09/2031        | 3 600                               | 3 788                            | 0,00                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| AerCap Ireland Capital DAC      |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,450 % éch. 15/04/2027         | 2 648                               | 2 682                            | 0,00                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| AGFC Capital Trust              |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,685 % éch. 15/01/2067         | 23 000                              | 14 373                           | 0,01                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Alamo Re Ltd.                   |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 9,039 % éch. 07/06/2029         | 1 950                               | 1 949                            | 0,00                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 5,667 % éch. 20/03/2028                     | \$ 113 700                          | \$ 115 151                       | 0,09                      | Hestia Re Ltd.                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 31/12/2028 (d)                                                                | € 7 640                             | \$ 4 542                         | 0,00                      | 5,800 % éch. 05/03/2027                     | 7 767                               | 7 808                            | 0,01                      | 10,270 % éch. 13/03/2032                                                              | \$ 1 700                            | \$ 1 742                         | 0,00                      |
| CoStar Group, Inc.                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 08/03/2029                     | 103 749                             | 104 681                          | 0,08                      | 11,770 % éch. 13/03/2032                                                              | 1 850                               | 1 890                            | 0,00                      |
| 2,800 % éch. 15/07/2030                                                                    | \$ 11 362                           | 10 226                           | 0,01                      | 5,850 % éch. 17/05/2027                     | 50 986                              | 51 381                           | 0,04                      | 13,039 % éch. 16/04/2029                                                              | 600                                 | 605                              | 0,00                      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.                                               |                                     |                                  |                           | 5,918 % éch. 20/03/2028                     | 51 400                              | 52 052                           | 0,04                      | Hexagon RE Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                                                                    | PEN 73 400                          | 23 061                           | 0,02                      | 6,798 % éch. 07/11/2028                     | 20 400                              | 21 066                           | 0,02                      | 10,666 % éch. 07/01/2031                                                              | € 10 684                            | 12 636                           | 0,01                      |
| 10,100 % éch. 15/12/2043                                                                   | 32 944                              | 10 628                           | 0,01                      | 6,800 % éch. 12/05/2028                     | 98 330                              | 101 177                          | 0,08                      | HLD Europe S.C.A.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Credit Agricole Opportunities Partners                                                     |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 04/11/2027                     | 43 314                              | 44 518                           | 0,04                      | 4,125 % éch. 02/04/2030                                                               | 28 900                              | 33 365                           | 0,03                      |
| 6,520 % éch. 20/03/2028 (k)                                                                | \$ 30 200                           | 30 165                           | 0,02                      | GA Global Funding Trust                     |                                     |                                  |                           | Horizon Mutual Holdings, Inc.                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,740 % éch. 20/03/2030 (k)                                                                | 35 600                              | 35 472                           | 0,03                      | 4,400 % éch. 23/09/2027                     | 50 000                              | 49 799                           | 0,04                      | 6,200 % éch. 15/11/2034                                                               | \$ 12 200                           | 11 862                           | 0,01                      |
| Crédit Agricole S.A.                                                                       |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 09/12/2031                     | 23 800                              | 23 526                           | 0,02                      | Host Hotels & Resorts LP                                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,631 % éch. 11/09/2028                                                                    | 24 550                              | 24 545                           | 0,02                      | 5,400 % éch. 13/01/2030                     | 25 100                              | 25 200                           | 0,02                      | 3,375 % éch. 15/12/2029                                                               | 5 000                               | 4 772                            | 0,00                      |
| 4,848 % éch. 11/09/2028                                                                    | 60 500                              | 60 872                           | 0,05                      | 5,500 % éch. 01/04/2032                     | 41 500                              | 41 363                           | 0,03                      | 5,500 % éch. 15/04/2035                                                               | 15 267                              | 15 328                           | 0,01                      |
| 6,316 % éch. 03/10/2029                                                                    | 23 650                              | 24 425                           | 0,02                      | 5,900 % éch. 13/01/2035 (l)                 | 36 800                              | 37 126                           | 0,03                      | HSBC Holdings PLC                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Crown Castle, Inc.                                                                         |                                     |                                  |                           | Gaci First Investment Co.                   |                                     |                                  |                           | 4,041 % éch. 13/03/2028                                                               | 31 500                              | 31 387                           | 0,03                      |
| 2,900 % éch. 15/03/2027                                                                    | 20 641                              | 20 419                           | 0,02                      | 4,875 % éch. 14/05/2029                     | 295 500                             | 294 576                          | 0,24                      | 4,583 % éch. 19/06/2029                                                               | 9 300                               | 9 274                            | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 01/03/2027                                                                    | 500                                 | 499                              | 0,00                      | 5,250 % éch. 29/01/2030                     | 217 500                             | 219 571                          | 0,18                      | 4,711 % éch. 12/05/2030                                                               | 53 400                              | 53 180                           | 0,04                      |
| DaVinciRe Holdings Ltd.                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 14/05/2033                     | 236 100                             | 236 016                          | 0,19                      | 5,887 % éch. 14/08/2027                                                               | 54 600                              | 54 680                           | 0,04                      |
| 5,950 % éch. 15/04/2035                                                                    | 3 030                               | 3 114                            | 0,00                      | 6,250 % éch. 14/05/2056                     | 260 000                             | 260 414                          | 0,21                      | InCaps Funding Ltd.                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Deloitte LLP                                                                               |                                     |                                  |                           | GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 5,922 % éch. 01/06/2033                                                               | 1 576                               | 1 577                            | 0,00                      |
| 5,250 % éch. 30/01/2030 (k)                                                                | 12 400                              | 12 397                           | 0,01                      | 5,617 % éch. 30/06/2032                     | AUD 48 800                          | 33 956                           | 0,03                      | Integrity Re Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,410 % éch. 30/01/2032 (k)                                                                | 12 200                              | 12 192                           | 0,01                      | Galderma Finance Europe BV                  |                                     |                                  |                           | 10,520 % éch. 07/06/2029                                                              | 1 700                               | 1 699                            | 0,00                      |
| Deutsche Bank AG                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 17/03/2031                     | € 16 574                            | 18 923                           | 0,02                      | 11,520 % éch. 06/06/2027                                                              | 700                                 | 710                              | 0,00                      |
| 2,311 % éch. 16/11/2027                                                                    | 15 400                              | 15 273                           | 0,01                      | Gateway Casinos & Entertainment Ltd.        |                                     |                                  |                           | 13,270 % éch. 06/06/2027                                                              | 500                                 | 506                              | 0,00                      |
| 2,789 % éch. 18/08/2027                                                                    | € 98 600                            | 112 765                          | 0,09                      | 5,000 % éch. 12/03/2038                     | CAD 41 791                          | 27 472                           | 0,02                      | 14,520 % éch. 07/06/2029                                                              | 850                                 | 847                              | 0,00                      |
| 5,706 % éch. 08/02/2028                                                                    | \$ 18 100                           | 18 231                           | 0,02                      | Gateway Re Ltd.                             |                                     |                                  |                           | 15,770 % éch. 06/06/2028                                                              | 3 100                               | 3 211                            | 0,00                      |
| 6,720 % éch. 18/01/2029                                                                    | 34 800                              | 35 852                           | 0,03                      | 5,550 % éch. 06/07/2029                     | \$ 6 200                            | 6 194                            | 0,01                      | 19,770 % éch. 07/06/2029                                                              | 1 050                               | 1 045                            | 0,00                      |
| 6,819 % éch. 20/11/2029 (l)                                                                | 26 700                              | 27 933                           | 0,02                      | 14,430 % éch. 08/07/2026                    | 5 520                               | 5 526                            | 0,00                      | 29,020 % éch. 06/06/2027                                                              | 5 200                               | 5 439                            | 0,00                      |
| 7,146 % éch. 13/07/2027                                                                    | 14 700                              | 14 712                           | 0,01                      | GATX Corp.                                  |                                     |                                  |                           | Intesa Sanpaolo SpA                                                                   |                                     |                                  |                           |
| ELM BV for Swiss Prime Site AG                                                             |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 15/03/2027                     | 2 500                               | 2 514                            | 0,00                      | 4,000 % éch. 23/09/2029                                                               | 5 000                               | 4 889                            | 0,00                      |
| 3,125 % éch. 01/10/2031                                                                    | € 25 900                            | 28 996                           | 0,02                      | General Motors Financial Co., Inc.          |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 29/06/2030                                                               | 70 500                              | 70 593                           | 0,06                      |
| Emirates NBD Bank PJSC                                                                     |                                     |                                  |                           | 2,350 % éch. 26/02/2027 (l)                 | 9 900                               | 9 768                            | 0,01                      | 6,625 % éch. 20/06/2033                                                               | 8 625                               | 9 354                            | 0,01                      |
| 5,125 % éch. 29/06/2031                                                                    | \$ 359 800                          | 359 800                          | 0,29                      | Genpact UK Finco PLC                        |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 28/11/2033                                                               | 48 300                              | 54 352                           | 0,04                      |
| EPR Properties                                                                             |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 18/11/2030                     | 35 000                              | 34 477                           | 0,03                      | 7,200 % éch. 28/11/2033 (l)                                                           | 17 500                              | 19 693                           | 0,02                      |
| 3,750 % éch. 15/08/2029                                                                    | 2 887                               | 2 777                            | 0,00                      | GLP Capital LP                              |                                     |                                  |                           | 8,248 % éch. 21/11/2033                                                               | 4 133                               | 4 778                            | 0,00                      |
| 4,500 % éch. 01/06/2027                                                                    | 5 100                               | 5 091                            | 0,00                      | 3,250 % éch. 15/01/2032                     | 5 600                               | 5 018                            | 0,00                      | Iridium Capital PLC                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/12/2026                                                                    | 7 623                               | 7 624                            | 0,01                      | 4,000 % éch. 15/01/2031                     | 17 915                              | 16 930                           | 0,01                      | 9,250 % éch. 18/06/2029                                                               | € 19 750                            | 24 539                           | 0,02                      |
| 4,950 % éch. 15/04/2028                                                                    | 7 610                               | 7 614                            | 0,01                      | 5,430 % éch. 15/02/2033                     | 22 700                              | 22 279                           | 0,02                      | Jackson National Life Global Funding                                                  |                                     |                                  |                           |
| Equinix, Inc.                                                                              |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/01/2029                     | 19 614                              | 19 718                           | 0,02                      | 4,600 % éch. 01/10/2029                                                               | \$ 70 950                           | 69 973                           | 0,06                      |
| 2,900 % éch. 18/11/2026                                                                    | 2 400                               | 2 386                            | 0,00                      | 5,625 % éch. 15/09/2034                     | 8 600                               | 8 537                            | 0,01                      | 4,603 % éch. 14/01/2028                                                               | 44 500                              | 44 450                           | 0,04                      |
| Equitable America Global Funding                                                           |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 01/03/2036                     | 35 800                              | 35 103                           | 0,03                      | 4,900 % éch. 13/01/2027                                                               | 54 000                              | 54 102                           | 0,04                      |
| 4,650 % éch. 09/06/2028                                                                    | 25 890                              | 25 843                           | 0,02                      | 5,750 % éch. 01/06/2028                     | 900                                 | 911                              | 0,00                      | 5,550 % éch. 02/07/2027                                                               | 37 800                              | 38 151                           | 0,03                      |
| Equitable Financial Life Global Funding                                                    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/12/2033                     | 5 800                               | 6 153                            | 0,01                      | Jane Street Group                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 19/11/2027                                                                    | 47 000                              | 47 156                           | 0,04                      | Golden Bear Re Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/05/2033 (l)                                                           | 15 600                              | 16 051                           | 0,01                      |
| Everglades Re Ltd.                                                                         |                                     |                                  |                           | 13,289 % éch. 08/03/2032                    | 9 200                               | 9 279                            | 0,01                      | JPMorgan Chase & Co.                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 9,289 % éch. 22/05/2033                                                                    | 2 800                               | 2 798                            | 0,00                      | 13,300 % éch. 08/01/2029                    | 8 400                               | 8 619                            | 0,01                      | 1,896 % éch. 05/03/2028 (k)                                                           | CAD 19 700                          | 13 790                           | 0,01                      |
| 10,289 % éch. 22/05/2033                                                                   | 3 700                               | 3 697                            | 0,00                      | Goldman Sachs Bank USA                      |                                     |                                  |                           | 2,069 % éch. 01/06/2029                                                               | \$ 24 300                           | 23 170                           | 0,02                      |
| 12,039 % éch. 22/05/2033                                                                   | 4 500                               | 4 495                            | 0,00                      | 4,656 % éch. 03/06/2029 (l)                 | 251 800                             | 251 995                          | 0,20                      | 2,947 % éch. 24/02/2028                                                               | 500                                 | 495                              | 0,00                      |
| F&G Annuities & Life, Inc.                                                                 |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 3,509 % éch. 23/01/2029                                                               | 3 500                               | 3 443                            | 0,00                      |
| 6,250 % éch. 04/10/2034 (l)                                                                | 15 500                              | 15 169                           | 0,01                      | 2,013 % éch. 28/02/2029 (k)                 | CAD 36 900                          | 25 459                           | 0,02                      | 3,702 % éch. 06/05/2030                                                               | 15 500                              | 15 076                           | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 04/06/2029                                                                    | 28 740                              | 29 383                           | 0,02                      | 3,615 % éch. 15/03/2028                     | \$ 500                              | 497                              | 0,00                      | 4,005 % éch. 23/04/2029                                                               | 12 182                              | 12 052                           | 0,01                      |
| F&G Global Funding                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,148 % éch. 21/01/2029                     | 155 500                             | 154 185                          | 0,12                      | 4,323 % éch. 26/04/2028                                                               | 2 700                               | 2 696                            | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 20/09/2028                                                                    | 11 900                              | 11 089                           | 0,01                      | 4,594 % éch. 20/04/2030                     | 129 600                             | 128 885                          | 0,10                      | 4,408 % éch. 23/04/2030                                                               | 119 000                             | 118 003                          | 0,10                      |
| 5,875 % éch. 10/06/2027                                                                    | 21 100                              | 21 311                           | 0,02                      | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.         |                                     |                                  |                           | 4,457 % éch. 13/11/2031                                                               | € 24 300                            | 29 039                           | 0,02                      |
| 5,875 % éch. 16/01/2030 (l)                                                                | 29 200                              | 29 553                           | 0,02                      | 3,875 % éch. 29/04/2033                     | € 10 000                            | 11 446                           | 0,01                      | 5,299 % éch. 24/07/2029                                                               | \$ 13 600                           | 13 778                           | 0,01                      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 03/05/2030                     | 35 800                              | 42 082                           | 0,03                      | 5,571 % éch. 22/04/2028                                                               | 9 000                               | 9 076                            | 0,01                      |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                                                                    | 302 600                             | 303 039                          | 0,24                      | Goodman U.S. Finance Eight LLC              |                                     |                                  |                           | 5,581 % éch. 22/04/2030                                                               | 5 100                               | 5 212                            | 0,00                      |
| Ford Credit Canada Co.                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 28/04/2046                     | \$ 46 000                           | 45 310                           | 0,04                      | Kaisa Group Holdings Ltd.                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,398 % éch. 09/04/2029 (k)                                                                | CAD 19 600                          | 13 903                           | 0,01                      | Goodman U.S. Finance Seven LLC              |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/11/2027                                                               | 56                                  | 3                                | 0,00                      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 28/04/2036                     | 31 600                              | 31 076                           | 0,03                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 2,700 % éch. 10/08/2026                                                                    | \$ 9 684                            | 9 663                            | 0,01                      | Greengrove RE Ltd.                          |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/12/2028 (d)                                                           | 446                                 | 10                               | 0,00                      |
| 2,900 % éch. 16/02/2028                                                                    | 36 156                              | 34 933                           | 0,03                      | 11,270 % éch. 08/04/2032                    | 5 500                               | 5 613                            | 0,00                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,500 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 2,900 % éch. 10/02/2029                                                                    | 7 036                               | 6 623                            | 0,01                      | GSG Bidco Ltd.                              |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 28/12/2029 (d)                                                           | 746                                 | 17                               | 0,00                      |
| 3,815 % éch. 02/11/2027                                                                    | 42 429                              | 41 816                           | 0,03                      | 4,700 % éch. 15/06/2031                     | € 55 000                            | 62 370                           | 0,05                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (6,750 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 17/08/2027                                                                    | 68 699                              | 68 110                           | 0,06                      | GTA Finance Co. Pty. Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 28/12/2030 (d)                                                           | 899                                 | 16                               | 0,00                      |
| 4,271 % éch. 09/01/2027                                                                    | 36 205                              | 36 104                           | 0,03                      | 5,400 % éch. 04/12/2029                     | AUD 30 700                          | 21 157                           | 0,02                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,000 % en numéraire ou 6,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 28/05/2027                                                                    | 13 452                              | 13 462                           | 0,01                      | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/12/2031 (d)                                                           | 1 355                               | 23                               | 0,00                      |
| 4,970 % éch. 06/04/2029                                                                    | 187 100                             | 185 229                          | 0,15                      | 6,375 % éch. 01/07/2034 (l)                 | \$ 31 000                           | 31 631                           | 0,03                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,250 % en numéraire ou 6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 5,078 % éch. 05/11/2026                                                                    | 100 000                             | 100 182                          | 0,08                      | Handshake Re Ltd.                           |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 28/12/2032 (d)                                                           | 1 275                               | 26                               | 0,00                      |
| 5,113 % éch. 03/05/2029                                                                    | 5 609                               | 5 571                            | 0,00                      | 8,050 % éch. 08/01/2030                     | 1 500                               | 1 479                            | 0,00                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (7,721 % en numéraire ou 6,721 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 05/11/2026                                                                    | 83 195                              | 83 300                           | 0,07                      | Hardwood Funding LLC                        |                                     |                                  |                           | 7,721 % éch. 28/12/2028 (d)                                                           | 305                                 | 6                                | 0,00                      |
| 5,303 % éch. 06/09/2029                                                                    | 4 366                               | 4 351                            | 0,00                      | 4,840 % éch. 07/06/2028 (k)                 | 9 600                               | 9 577                            | 0,01                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,980 % éch. 07/06/2030 (k)                 | 6 200                               | 6 173                            | 0,01                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Herbie Re Ltd.                              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 7,760 % éch. 07/01/2030                     | 2 550                               | 2 552                            | 0,00                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Kizuna RE Pte. Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 5,076 % éch. 27/01/2030                        | \$ 143 670                          | \$ 144 628                       | 0,12                      | 4,679 % éch. 27/04/2029                  | \$ 245 400                          | \$ 246 633                       | 0,20                      |
| 6,539 % éch. 09/04/2029             | \$ 3 200                            | \$ 3 252                         | 0,00                      | 5,583 % éch. 01/03/2028                        | 25 835                              | 26 024                           | 0,02                      | Quercus Re DAC                           |                                     |                                  |                           |
| Lloyds Banking Group PLC            |                                     |                                  |                           | 5,808 % éch. 13/09/2029                        | 2 200                               | 2 249                            | 0,00                      | 10,149 % éch. 06/01/2031                 | € 1 900                             | 2 207                            | 0,00                      |
| 3,750 % éch. 18/03/2028             | 25 494                              | 25 364                           | 0,02                      | NatWest Markets PLC                            |                                     |                                  |                           | 13,324 % éch. 07/01/2031                 | 7 100                               | 8 236                            | 0,01                      |
| 4,241 % éch. 10/02/2030             | 66 200                              | 65 368                           | 0,05                      | 4,587 % éch. 21/03/2028                        | 51 300                              | 51 645                           | 0,04                      | Realkredit Danmark A/S                   |                                     |                                  |                           |
| 4,692 % éch. 26/11/2028             | 75 600                              | 75 990                           | 0,06                      | 4,654 % éch. 27/03/2029                        | 71 600                              | 71 511                           | 0,06                      | 2,500 % éch. 01/04/2047                  | DKK 0                               | 0                                | 0,00                      |
| 5,087 % éch. 26/11/2028             | 41 600                              | 41 891                           | 0,03                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                |                                     |                                  |                           | Recoletos RE DAC                         |                                     |                                  |                           |
| 5,462 % éch. 05/01/2028             | 1 100                               | 1 106                            | 0,00                      | 1,850 % éch. 16/09/2026                        | 25 036                              | 24 818                           | 0,02                      | 5,289 % éch. 06/07/2032                  | \$ 4 150                            | 4 148                            | 0,00                      |
| 5,985 % éch. 07/08/2027             | 10 000                              | 10 015                           | 0,01                      | 2,450 % éch. 15/09/2028                        | 5 700                               | 5 294                            | 0,00                      | RGF Global Funding                       |                                     |                                  |                           |
| Locke Tavern Re Ltd.                |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 09/03/2028                        | 20 400                              | 19 410                           | 0,02                      | 5,050 % éch. 06/12/2031                  | 32 000                              | 31 976                           | 0,03                      |
| 6,800 % éch. 11/04/2033             | 4 100                               | 4 080                            | 0,00                      | 5,300 % éch. 13/09/2027                        | 65 001                              | 64 799                           | 0,05                      | Royal Bank of Canada                     |                                     |                                  |                           |
| 7,800 % éch. 11/04/2033             | 3 700                               | 3 708                            | 0,00                      | 5,625 % éch. 29/09/2028                        | 126 000                             | 125 799                          | 0,10                      | 3,411 % éch. 12/06/2029                  | CAD 27 300                          | 19 277                           | 0,02                      |
| Long Point Re Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 5,688 % éch. 13/09/2027                        | 14 200                              | 14 127                           | 0,01                      | 4,420 % éch. 23/07/2027                  | \$ 300                              | 300                              | 0,00                      |
| 7,289 % éch. 01/06/2034             | 9 300                               | 9 299                            | 0,01                      | 6,125 % éch. 30/09/2030                        | 88 534                              | 87 106                           | 0,07                      | 4,510 % éch. 18/10/2027                  | 35 200                              | 35 208                           | 0,03                      |
| Longleaf Pine Re Ltd.               |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 15/09/2026                        | 6 675                               | 6 707                            | 0,01                      | 4,612 % éch. 26/07/2027                  | CAD 7 000                           | 5 017                            | 0,00                      |
| 21,453 % éch. 27/05/2031            | 4 100                               | 4 187                            | 0,00                      | Nomura Holdings, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Sabine Re Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| Lower Ferry Re Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 2,172 % éch. 14/07/2028                        | 14 968                              | 14 228                           | 0,01                      | 12,040 % éch. 07/04/2031                 | \$ 3 400                            | 3 442                            | 0,00                      |
| 6,260 % éch. 08/07/2033             | 700                                 | 700                              | 0,00                      | 2,329 % éch. 22/01/2027                        | 500                                 | 494                              | 0,00                      | Sagax AB                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,510 % éch. 08/07/2033             | 600                                 | 600                              | 0,00                      | 4,886 % éch. 02/07/2027                        | 35 300                              | 35 578                           | 0,03                      | 3,375 % éch. 26/01/2031                  | € 40 100                            | 45 196                           | 0,04                      |
| 7,510 % éch. 08/07/2033             | 1 800                               | 1 801                            | 0,00                      | 4,904 % éch. 01/07/2030                        | 13 900                              | 13 878                           | 0,01                      | Sammons Financial Group Global Funding   |                                     |                                  |                           |
| 8,156 % éch. 08/07/2030             | 500                                 | 500                              | 0,00                      | 4,996 % éch. 29/06/2029                        | 48 100                              | 48 222                           | 0,04                      | 5,050 % éch. 10/01/2028                  | \$ 14 800                           | 14 837                           | 0,01                      |
| 9,014 % éch. 08/07/2030             | 4 300                               | 4 301                            | 0,00                      | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab           |                                     |                                  |                           | 5,100 % éch. 10/12/2029                  | 12 700                              | 12 757                           | 0,01                      |
| LPL Holdings, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 01/10/2047                        | DKK 0                               | 0                                | 0,00                      | Sammons Financial Group, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 03/04/2028             | 24 600                              | 24 621                           | 0,02                      | Norinchukin Bank                               |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 15/06/2036 (I)              | 12 200                              | 12 226                           | 0,01                      |
| 5,150 % éch. 15/06/2030 (I)         | 43 900                              | 44 053                           | 0,04                      | 4,683 % éch. 10/03/2031                        | \$ 26 100                           | 25 756                           | 0,02                      | Santander Holdings USA, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| 5,200 % éch. 15/03/2030 (I)         | 41 500                              | 41 785                           | 0,03                      | 5,094 % éch. 16/10/2029                        | 9 300                               | 9 366                            | 0,01                      | 5,247 % éch. 20/03/2029                  | 39 900                              | 40 315                           | 0,03                      |
| 5,700 % éch. 20/05/2027             | 17 400                              | 17 535                           | 0,01                      | Nykredit Realkredit A/S                        |                                     |                                  |                           | 5,353 % éch. 06/09/2030 (I)              | 78 500                              | 79 271                           | 0,06                      |
| Lseg U.S. Fin Corp.                 |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 01/10/2037                        | DKK 0                               | 0                                | 0,00                      | 5,473 % éch. 20/03/2029                  | 44 000                              | 44 435                           | 0,04                      |
| 4,250 % éch. 23/03/2029             | 65 100                              | 64 369                           | 0,05                      | 2,000 % éch. 01/10/2047                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,741 % éch. 20/03/2031 (I)              | 34 200                              | 34 942                           | 0,03                      |
| Luca RE Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 10/07/2031                        | € 2 700                             | 3 095                            | 0,00                      | Santander UK Group Holdings PLC          |                                     |                                  |                           |
| 9,036 % éch. 09/07/2032             | 4 200                               | 4 198                            | 0,00                      | Omega Healthcare Investors, Inc.               |                                     |                                  |                           | 2,469 % éch. 11/01/2028                  | 23 100                              | 22 836                           | 0,02                      |
| 10,800 % éch. 22/07/2031            | 9 900                               | 10 296                           | 0,01                      | 5,200 % éch. 01/07/2030                        | \$ 47 200                           | 47 442                           | 0,04                      | 3,823 % éch. 03/11/2028                  | 25 600                              | 25 314                           | 0,02                      |
| Marex Group PLC                     |                                     |                                  |                           | OneMain Finance Corp.                          |                                     |                                  |                           | 4,320 % éch. 22/09/2029                  | 65 400                              | 64 728                           | 0,05                      |
| 5,680 % éch. 21/04/2031             | 21 100                              | 21 117                           | 0,02                      | 6,625 % éch. 15/01/2028 (I)                    | 62 200                              | 63 151                           | 0,05                      | 4,858 % éch. 11/09/2030                  | 92 200                              | 92 149                           | 0,07                      |
| 5,829 % éch. 08/05/2028             | 8 800                               | 8 863                            | 0,01                      | Orange Capital RE DAC                          |                                     |                                  |                           | 5,694 % éch. 15/04/2031 (I)              | 68 000                              | 69 774                           | 0,06                      |
| 6,404 % éch. 04/11/2029             | 42 900                              | 43 983                           | 0,04                      | 8,103 % éch. 17/01/2029                        | € 1 200                             | 1 428                            | 0,00                      | 6,534 % éch. 10/01/2029                  | 3 300                               | 3 388                            | 0,00                      |
| Mayflower Re Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 10,433 % éch. 08/01/2027                       | 9 900                               | 11 557                           | 0,01                      | 7,482 % éch. 29/08/2029                  | £ 46 210                            | 64 441                           | 0,05                      |
| 8,565 % éch. 08/07/2030             | 4 650                               | 4 651                            | 0,00                      | Palm RE Ltd.                                   |                                     |                                  |                           | SBA Communications Corp.                 |                                     |                                  |                           |
| 10,033 % éch. 08/07/2030            | 4 150                               | 4 153                            | 0,00                      | 8,550 % éch. 07/06/2033                        | \$ 3 700                            | 3 754                            | 0,00                      | 3,875 % éch. 15/02/2027 (I)              | \$ 58 000                           | 57 704                           | 0,05                      |
| Mercury General Corp.               |                                     |                                  |                           | 11,270 % éch. 07/06/2032                       | 3 000                               | 3 063                            | 0,00                      | SBA Tower Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/06/2036             | 47 100                              | 47 948                           | 0,04                      | 13,220 % éch. 09/06/2031                       | 900                                 | 930                              | 0,00                      | 1,840 % éch. 15/04/2027                  | 70 400                              | 68 875                           | 0,06                      |
| Merna Reinsurance Ltd.              |                                     |                                  |                           | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                                     |                                  |                           | 4,831 % éch. 15/10/2054                  | 100 000                             | 100 047                          | 0,08                      |
| 13,991 % éch. 07/07/2030            | 1 100                               | 1 101                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 05/04/2032 (f)                    | 135 733                             | 110 563                          | 0,09                      | SELP Finance SARL                        |                                     |                                  |                           |
| MMIFS Re Ltd.                       |                                     |                                  |                           | Polestar Re Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 29/06/2033                  | € 22 300                            | 25 625                           | 0,02                      |
| 5,161 % éch. 10/01/2033             | CAD 4 500                           | 3 205                            | 0,00                      | 10,550 % éch. 08/01/2029                       | 2 000                               | 2 005                            | 0,00                      | Simon Global Development BV              |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley                      |                                     |                                  |                           | 12,550 % éch. 08/01/2029                       | 2 000                               | 2 022                            | 0,00                      | 3,650 % éch. 15/06/2031                  | 36 000                              | 41 499                           | 0,03                      |
| 0,000 % éch. 02/04/2032 (k)         | \$ 68 500                           | 51 113                           | 0,04                      | 14,050 % éch. 08/01/2029                       | 300                                 | 301                              | 0,00                      | SLM Student Loan Trust                   |                                     |                                  |                           |
| 3,485 % éch. 11/06/2030             | € 95 400                            | 109 679                          | 0,09                      | 14,140 % éch. 07/01/2028                       | 8 500                               | 8 857                            | 0,01                      | 2,951 % éch. 15/12/2033                  | 6 783                               | 7 345                            | 0,01                      |
| 4,238 % éch. 09/01/2030             | \$ 28 600                           | 28 230                           | 0,02                      | 16,800 % éch. 07/01/2027                       | 14 000                              | 14 375                           | 0,01                      | Société Générale S.A.                    |                                     |                                  |                           |
| 4,555 % éch. 10/04/2030 (I)         | 60 200                              | 59 826                           | 0,05                      | PPI Public Property Invest AB                  |                                     |                                  |                           | 2,797 % éch. 19/01/2028 (I)              | \$ 7 000                            | 6 933                            | 0,01                      |
| 5,123 % éch. 01/02/2029             | 40 137                              | 40 386                           | 0,03                      | 3,250 % éch. 21/04/2029                        | € 18 000                            | 20 482                           | 0,02                      | 4,857 % éch. 07/07/2029 (c)              | 151 000                             | 150 984                          | 0,12                      |
| Morgan Stanley Bank N.A.            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 21/04/2033                        | 18 000                              | 20 313                           | 0,02                      | 6,446 % éch. 10/01/2029                  | 37 400                              | 38 330                           | 0,03                      |
| 4,319 % éch. 15/10/2027             | 37 900                              | 37 925                           | 0,03                      | Preferred Term Securities Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 6,691 % éch. 10/01/2034                  | 124 100                             | 132 865                          | 0,11                      |
| 4,573 % éch. 14/07/2028             | 179 350                             | 180 351                          | 0,15                      | 4,216 % éch. 22/06/2037                        | \$ 8 962                            | 8 537                            | 0,01                      | Sofina S.A.                              |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley Finance LLC          |                                     |                                  |                           | 4,226 % éch. 22/03/2037                        | 11 065                              | 10 595                           | 0,01                      | 3,707 % éch. 13/11/2033                  | € 45 700                            | 51 769                           | 0,04                      |
| 6,550 % éch. 05/01/2029             | £ 31 600                            | 41 716                           | 0,03                      | 4,226 % éch. 22/09/2037                        | 10 159                              | 9 651                            | 0,01                      | SRC Sukuk Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| Mountain Re Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 4,276 % éch. 22/12/2035                        | 5 952                               | 5 877                            | 0,01                      | 4,375 % éch. 02/04/2029                  | \$ 200 000                          | 197 594                          | 0,16                      |
| 10,770 % éch. 07/06/2033            | \$ 500                              | 500                              | 0,00                      | 4,276 % éch. 22/03/2038                        | 5 866                               | 5 661                            | 0,00                      | 5,000 % éch. 27/02/2028                  | 124 625                             | 125 033                          | 0,10                      |
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding |                                     |                                  |                           | 4,296 % éch. 22/09/2037                        | 11 491                              | 10 457                           | 0,01                      | Starwood Property Trust, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/10/2029             | 12 200                              | 12 191                           | 0,01                      | 4,306 % éch. 22/03/2037                        | 12 773                              | 11 623                           | 0,01                      | 5,250 % éch. 15/10/2028 (I)              | 16 400                              | 16 335                           | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 01/04/2030             | 23 100                              | 23 273                           | 0,02                      | 4,326 % éch. 22/03/2038                        | 11 052                              | 10 352                           | 0,01                      | 5,750 % éch. 15/01/2031                  | 40 000                              | 39 799                           | 0,03                      |
| National Securities Clearing Corp.  |                                     |                                  |                           | 4,356 % éch. 22/12/2035                        | 2 118                               | 2 034                            | 0,00                      | 6,125 % éch. 01/06/2031                  | 90 100                              | 90 635                           | 0,07                      |
| 4,350 % éch. 09/06/2028             | 32 400                              | 32 379                           | 0,03                      | 4,376 % éch. 22/03/2038                        | 9 044                               | 8 321                            | 0,01                      | Stellantis Finance U.S., Inc.            |                                     |                                  |                           |
| Nationwide Building Society         |                                     |                                  |                           | 4,406 % éch. 23/09/2035                        | 6 172                               | 5 956                            | 0,01                      | 5,350 % éch. 17/03/2028                  | 21 600                              | 21 665                           | 0,02                      |
| 3,960 % éch. 18/07/2030             | 168 083                             | 163 738                          | 0,13                      | 4,506 % éch. 23/03/2035                        | 6 220                               | 5 986                            | 0,01                      | 5,750 % éch. 18/03/2030                  | 64 900                              | 64 876                           | 0,05                      |
| 4,302 % éch. 08/03/2029             | 24 100                              | 23 979                           | 0,02                      | 4,826 % éch. 22/03/2038                        | 471                                 | 468                              | 0,00                      | 6,450 % éch. 18/03/2035 (I)              | 7 810                               | 7 682                            | 0,01                      |
| 6,557 % éch. 18/10/2027             | 107 870                             | 108 487                          | 0,09                      | Prime Property                                 |                                     |                                  |                           | Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                     |                                  |                           |
| Nature Coast Re Ltd.                |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 30/09/2029 (k)                    | 18 100                              | 18 026                           | 0,01                      | 4,950 % éch. 15/09/2028                  | 32 400                              | 32 174                           | 0,03                      |
| 11,789 % éch. 26/02/2030            | 7 700                               | 7 764                            | 0,01                      | 5,440 % éch. 30/09/2031 (k)                    | 18 100                              | 17 917                           | 0,01                      | 5,400 % éch. 15/06/2029 (I)              | 90 700                              | 90 393                           | 0,07                      |
| 13,271 % éch. 10/04/2033            | 4 500                               | 4 673                            | 0,00                      | Principal Life Global Funding                  |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 15/09/2030                  | 39 300                              | 38 516                           | 0,03                      |
| 13,521 % éch. 07/12/2030            | 11 206                              | 11 100                           | 0,01                      | 4,600 % éch. 19/08/2027                        | 10 000                              | 10 025                           | 0,01                      | Store Capital LLC                        |                                     |                                  |                           |
| NatWest Group PLC                   |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 27/11/2029                        | 30 500                              | 30 617                           | 0,03                      | 4,950 % éch. 11/02/2031                  | 19 300                              | 19 061                           | 0,02                      |
| 4,445 % éch. 08/05/2030             | 115 125                             | 114 055                          | 0,09                      | Purple Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | Suci Second Investment Co.               |                                     |                                  |                           |
| 4,887 % éch. 01/03/2028             | 13 100                              | 13 160                           | 0,01                      | 10,050 % éch. 07/06/2033                       | 5 450                               | 5 450                            | 0,00                      | 4,375 % éch. 10/09/2027                  | 148 000                             | 147 565                          | 0,12                      |
| 4,892 % éch. 18/05/2029             | 35 773                              | 35 876                           | 0,03                      | 12,676 % éch. 06/06/2031                       | 10 500                              | 10 784                           | 0,01                      | Sumisho Air Lease Corp.                  |                                     |                                  |                           |
| 4,927 % éch. 15/11/2028             | 76 600                              | 77 259                           | 0,06                      | Pyramid Funding Ltd.                           |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 15/01/2027                  | 5 400                               | 5 331                            | 0,00                      |
| 4,964 % éch. 15/08/2030             | 47 500                              | 47 648                           | 0,04                      | 5,062 % éch. 28/03/2035                        | £ 16 087                            | 17 400                           | 0,01                      | 3,625 % éch. 01/04/2027                  | 500                                 | 496                              | 0,00                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | QNB Finance Ltd.                               |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | 4,538 % éch. 19/09/2027                        | \$ 569 300                          | 569 152                          | 0,46                      |                                          |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Sutter Re Ltd.                                           |                                     |                                  |                           | Volkswagen Bank GmbH               |                                     |                                  |                           | Amdocs Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| 7,289 % éch. 07/06/2034                                  | \$ 5 700                            | \$ 5 700                         | 0,01                      | 3,625 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 2,538 % éch. 15/06/2030                | \$ 11 200                           | \$ 10 102                        | 0,01                      |
| Synchrony Financial                                      |                                     |                                  |                           | 26/11/2028                         | € 21 300                            | \$ 24 486                        | 0,02                      | American Airlines Pass-Through Trust   |                                     |                                  |                           |
| 4,947 % éch. 25/02/2032                                  | 34 200                              | 33 352                           | 0,03                      | 4,000 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 11/01/2036                | 12 355                              | 11 151                           | 0,01                      |
| 5,019 % éch. 29/07/2029                                  | 15 800                              | 15 815                           | 0,01                      | 26/11/2030                         | 29 300                              | 33 795                           | 0,03                      | 3,000 % éch. 15/04/2030                | 2 157                               | 2 090                            | 0,00                      |
| 5,450 % éch. 06/03/2031                                  | 38 700                              | 38 712                           | 0,03                      | Vornado Realty LP                  |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/08/2033                | 607                                 | 570                              | 0,00                      |
| 5,935 % éch. 02/08/2030 (I)                              | 2 800                               | 2 857                            | 0,00                      | 5,750 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch. 15/12/2029                | 2 585                               | 2 510                            | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 29/07/2036 (I)                              | 16 000                              | 16 083                           | 0,01                      | 01/02/2033                         | \$ 9 000                            | 9 035                            | 0,01                      | 3,350 % éch. 15/04/2031 (I)            | 9 191                               | 8 853                            | 0,01                      |
| Taranis Reinsurance DAC                                  |                                     |                                  |                           | Voyager Aviation Holdings LLC      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 01/11/2028                | 17 929                              | 17 728                           | 0,01                      |
| 8,514 % éch. 07/01/2031                                  | € 6 400                             | 7 405                            | 0,01                      | 8,500 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 3,575 % éch. 15/07/2029                | 7 624                               | 7 524                            | 0,01                      |
| 11,194 % éch. 08/01/2031                                 | 9 400                               | 11 345                           | 0,01                      | 09/05/2026 ^                       | 2 075                               | 0                                | 0,00                      | 3,600 % éch. 22/03/2029                | 1 421                               | 1 400                            | 0,00                      |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.               |                                     |                                  |                           | Wells Fargo & Co.                  |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 15/08/2030                | 1 703                               | 1 665                            | 0,00                      |
| 6,551 % éch. 15/11/2034                                  | \$ 31 300                           | 31 799                           | 0,03                      | 0,000 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/08/2030                | 4 200                               | 4 081                            | 0,00                      |
| Titanium Bondco SARL (6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 23/07/2029                         | € 21 209                            | 24 054                           | 0,02                      | AppLovin Corp.                         |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 14/01/2031 (d)                              | € 1 423                             | 238                              | 0,00                      | 3,526 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 01/12/2029 (I)            | 8 700                               | 8 774                            | 0,01                      |
| Toronto-Dominion Bank                                    |                                     |                                  |                           | 24/03/2028                         | \$ 54 300                           | 53 908                           | 0,04                      | AptarGroup, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 4,210 % éch. 01/06/2027                                  | CAD 34 200                          | 24 374                           | 0,02                      | 4,182 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 30/03/2031                | 2 911                               | 2 884                            | 0,00                      |
| 4,361 % éch. 23/04/2029                                  | \$ 40 500                           | 40 292                           | 0,03                      | 23/01/2030 (I)                     | 38 200                              | 37 704                           | 0,03                      | Australian Metcoal Financing Pty. Ltd. |                                     |                                  |                           |
| 5,376 % éch. 21/10/2027                                  | CAD 15 500                          | 11 239                           | 0,01                      | 4,700 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 22/10/2031                | 34 300                              | 34 922                           | 0,03                      |
| Torrey Pines Re Ltd.                                     |                                     |                                  |                           | 22/04/2028                         | 64 500                              | 64 781                           | 0,05                      | 6,750 % éch. 22/04/2034                | 50 700                              | 52 317                           | 0,04                      |
| 6,539 % éch. 07/06/2033                                  | \$ 1 000                            | 1 000                            | 0,00                      | 5,083 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Bacardi-Martini BV                     |                                     |                                  |                           |
| 6,789 % éch. 07/06/2034                                  | 4 000                               | 4 026                            | 0,00                      | 26/04/2028 (k)                     | CAD 23 700                          | 16 979                           | 0,01                      | 5,550 % éch. 01/02/2030                | 33 550                              | 34 175                           | 0,03                      |
| 7,536 % éch. 07/06/2034                                  | 1 500                               | 1 507                            | 0,00                      | 5,707 % éch.                       |                                     |                                  |                           | BAT International Finance PLC          |                                     |                                  |                           |
| 9,586 % éch. 07/06/2032                                  | 7 700                               | 7 919                            | 0,01                      | 22/04/2028                         | \$ 25 000                           | 25 228                           | 0,02                      | 3,375 % éch. 11/05/2029                | € 23 800                            | 27 301                           | 0,02                      |
| 9,810 % éch. 07/06/2034                                  | 1 000                               | 1 024                            | 0,00                      | Windrose Re Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 5,931 % éch. 02/02/2029                | \$ 1 146                            | 1 181                            | 0,00                      |
| 10,656 % éch. 07/06/2032                                 | 4 600                               | 4 741                            | 0,00                      | 8,782 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Baxter International, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| Tremont Re Ltd.                                          |                                     |                                  |                           | 11/02/2033                         | 1 000                               | 1 000                            | 0,00                      | 4,450 % éch. 15/02/2029                | 8 700                               | 8 602                            | 0,01                      |
| 7,786 % éch. 22/03/2033                                  | 2 700                               | 2 692                            | 0,00                      | Winston RE Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 15/12/2030 (I)            | 17 000                              | 16 878                           | 0,01                      |
| U.S. Capital Funding Ltd.                                |                                     |                                  |                           | 8,300 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Bayer U.S. Finance LLC                 |                                     |                                  |                           |
| 4,220 % éch. 10/07/2043                                  | 3 824                               | 3 480                            | 0,00                      | 04/05/2033                         | 2 100                               | 2 105                            | 0,00                      | 4,375 % éch. 15/12/2028                | 71 175                              | 70 427                           | 0,06                      |
| UBS AG                                                   |                                     |                                  |                           | 8,800 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 21/11/2026                | 110 041                             | 110 619                          | 0,09                      |
| 4,678 % éch. 29/11/2030                                  | 251 700                             | 251 303                          | 0,20                      | 04/05/2033                         | 2 000                               | 2 005                            | 0,00                      | 6,250 % éch. 21/01/2029 (I)            | 83 902                              | 86 652                           | 0,07                      |
| UBS Group AG                                             |                                     |                                  |                           | 9,550 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 21/11/2030 (I)            | 51 125                              | 53 822                           | 0,04                      |
| 3,091 % éch. 14/05/2032                                  | 36 950                              | 33 919                           | 0,03                      | 04/05/2033                         | 1 600                               | 1 611                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 21/11/2033                | 18 720                              | 20 103                           | 0,02                      |
| 3,869 % éch. 12/01/2029                                  | 5 750                               | 5 685                            | 0,01                      | 10,020 % éch.                      |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC                   |                                     |                                  |                           |
| 4,194 % éch. 01/04/2031                                  | 73 037                              | 71 317                           | 0,06                      | 21/02/2028                         | 1 000                               | 1 030                            | 0,00                      | 6,581 % éch. 30/05/2049                | 2 310 110                           | 2 357 810                        | 1,89                      |
| 4,214 % éch. 10/04/2030                                  | 261 300                             | 257 036                          | 0,21                      | 15,210 % éch.                      |                                     |                                  |                           | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.  |                                     |                                  |                           |
| 4,282 % éch. 09/01/2028                                  | 1 800                               | 1 792                            | 0,00                      | 26/02/2031                         | 2 400                               | 2 448                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 05/06/2034 (f)            | 863                                 | 708                              | 0,00                      |
| 5,428 % éch. 08/02/2030                                  | 2 800                               | 2 840                            | 0,00                      | Yango Group Co. Ltd.               |                                     |                                  |                           | BMW U.S. Capital LLC                   |                                     |                                  |                           |
| 5,959 % éch. 12/01/2034                                  | 64 081                              | 66 798                           | 0,05                      | 6,900 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 4,557 % éch. 21/03/2028                | 31 100                              | 31 305                           | 0,03                      |
| 6,246 % éch. 22/09/2029                                  | 67 100                              | 69 214                           | 0,06                      | 31/10/2022 ^                       | CNY 50 000                          | 114                              | 0,00                      | Boeing Co.                             |                                     |                                  |                           |
| 6,327 % éch. 22/12/2027                                  | 30 800                              | 31 060                           | 0,03                      | Yardstick RE DAC                   |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 01/02/2028                | 13 300                              | 13 023                           | 0,01                      |
| Ursa Re Ltd.                                             |                                     |                                  |                           | 4,274 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 01/05/2030 (I)            | 27 500                              | 27 840                           | 0,02                      |
| 8,510 % éch. 07/12/2029                                  | 1 800                               | 1 823                            | 0,00                      | 08/07/2034                         | € 1 400                             | 1 601                            | 0,00                      | 6,259 % éch. 01/05/2027                | 76 037                              | 77 059                           | 0,06                      |
| 9,020 % éch. 07/12/2026                                  | 19 400                              | 19 606                           | 0,02                      |                                    |                                     | 19 420 963                       | 15,56                     | 6,298 % éch. 01/05/2029                | 99 120                              | 103 207                          | 0,08                      |
| 11,021 % éch. 22/02/2028                                 | 13 100                              | 13 530                           | 0,01                      | INDUSTRIE                          |                                     |                                  |                           | 6,388 % éch. 01/05/2031                | 22 500                              | 23 913                           | 0,02                      |
| 11,260 % éch. 07/06/2028                                 | 9 600                               | 9 875                            | 0,01                      | Air Canada Pass-Through Trust      |                                     |                                  |                           | Booking Holdings, Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| 12,270 % éch. 07/12/2026                                 | 24 900                              | 25 373                           | 0,02                      | 3,300 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 11/05/2030                | € 7 500                             | 8 638                            | 0,01                      |
| VD DPR Finance Co.                                       |                                     |                                  |                           | 15/07/2031                         | \$ 1 602                            | 1 524                            | 0,00                      | British Airways Pass-Through Trust     |                                     |                                  |                           |
| 6,833 % éch. 15/03/2035 (k)                              | 27 500                              | 27 781                           | 0,02                      | 3,600 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 15/09/2036                | \$ 5 817                            | 5 326                            | 0,00                      |
| Ventas Realty LP                                         |                                     |                                  |                           | 15/09/2028                         | 753                                 | 746                              | 0,00                      | 3,300 % éch. 15/06/2034                | 2 639                               | 2 484                            | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 15/10/2026                                  | 500                                 | 498                              | 0,00                      | 5,250 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 3,800 % éch. 20/03/2033                | 1 549                               | 1 510                            | 0,00                      |
| Veraison Re Ltd.                                         |                                     |                                  |                           | 01/10/2030                         | 20 925                              | 21 081                           | 0,02                      | Burberry Group PLC                     |                                     |                                  |                           |
| 6,421 % éch. 08/03/2034                                  | 6 350                               | 6 426                            | 0,01                      | Alaska Airlines Pass-Through Trust |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 20/06/2030                | £ 40 780                            | 54 655                           | 0,04                      |
| 7,671 % éch. 08/03/2034                                  | 2 000                               | 2 003                            | 0,00                      | 4,800 % éch.                       |                                     |                                  |                           | Carnival Corp. Ltd.                    |                                     |                                  |                           |
| 8,521 % éch. 08/03/2033                                  | 1 850                               | 1 872                            | 0,00                      | 15/02/2029                         | 14 434                              | 14 436                           | 0,01                      | 4,000 % éch. 01/08/2028 (I)            | \$ 65 676                           | 64 493                           | 0,05                      |
| VICI Properties LP                                       |                                     |                                  |                           | Altice France S.A.                 |                                     |                                  |                           | Carvana Co.                            |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 15/02/2027                                  | 41 800                              | 41 546                           | 0,03                      | 6,500 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 01/06/2030                | 105 406                             | 109 060                          | 0,09                      |
| 3,875 % éch. 15/02/2029                                  | 32 080                              | 31 175                           | 0,03                      | 15/04/2032                         | 5 483                               | 5 303                            | 0,00                      | 9,000 % éch. 01/06/2031 (I)            | 127 867                             | 141 196                          | 0,11                      |
| 4,125 % éch. 15/08/2030                                  | 28 366                              | 27 233                           | 0,02                      | 6,875 % éch.                       |                                     |                                  |                           | CDW LLC                                |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 01/12/2026                                  | 35 700                              | 35 634                           | 0,03                      | 15/10/2030                         | 16 497                              | 16 019                           | 0,01                      | 2,670 % éch. 01/12/2026                | 12 600                              | 12 499                           | 0,01                      |
| 4,500 % éch. 01/09/2026                                  | 11 628                              | 11 622                           | 0,01                      | 6,875 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 3,276 % éch. 01/12/2028                | 3 815                               | 3 669                            | 0,00                      |
| 4,500 % éch. 15/01/2028                                  | 2 000                               | 1 987                            | 0,00                      | 15/07/2032                         | 1 521                               | 1 477                            | 0,00                      | 3,569 % éch. 01/12/2031                | 21 300                              | 19 564                           | 0,02                      |
| 4,625 % éch. 01/12/2029                                  | 42 575                              | 41 801                           | 0,03                      | 9,500 % éch.                       |                                     |                                  |                           | 5,100 % éch. 01/03/2030                | 16 100                              | 16 080                           | 0,01                      |
| 4,750 % éch. 01/04/2028                                  | 13 400                              | 13 393                           | 0,01                      | 01/11/2029                         | 136 262                             | 138 427                          | 0,11                      | Cenovus Energy, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 15/02/2030                                  | 28 400                              | 28 329                           | 0,02                      | 12,875 % éch.                      |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 20/03/2031                | 7 740                               | 7 644                            | 0,01                      |
| 5,125 % éch. 15/11/2031 (I)                              | 28 100                              | 27 985                           | 0,02                      | 01/11/2029                         | € 15 842                            | 18 591                           | 0,02                      | Centene Corp.                          |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 01/04/2035 (I)                              | 36 200                              | 36 231                           | 0,03                      | Altred Investment Authority S.A.S. |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/07/2028 (I)            | 87 568                              | 83 257                           | 0,07                      |
| 5,750 % éch. 01/02/2027                                  | 28 055                              | 28 130                           | 0,02                      | 3,704 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 01/04/2034                                  | 6 200                               | 6 298                            | 0,01                      | 23/06/2029                         | 15 000                              | 17 165                           | 0,01                      |                                        |                                     |                                  |                           |
| Vitality Re Ltd.                                         |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,260 % éch. 08/01/2030                                  | 2 900                               | 2 887                            | 0,00                      | 23/06/2032                         | 16 700                              | 19 209                           | 0,02                      |                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,521 % éch. 08/01/2031                                  | 12 000                              | 12 002                           | 0,01                      | Altria Group, Inc.                 |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,921 % éch. 08/01/2031                                  | 4 900                               | 4 901                            | 0,00                      | 4,500 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,260 % éch. 08/01/2030                                  | 2 400                               | 2 390                            | 0,00                      | 06/08/2030                         | \$ 8 100                            | 8 040                            | 0,01                      |                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,521 % éch. 08/01/2031                                  | 1 300                               | 1 300                            | 0,00                      | Amadeus IT Group S.A.              |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                          |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch.                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                          |                                     |                                  |                           | 20/05/2031                         | € 15 200                            | 17 557                           | 0,01                      |                                        |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 2,500 % éch. 01/03/2031                                                    | \$ 25 200                           | \$ 22 027                        | 0,02                      | 8,625 % éch. 28/04/2034                                                                  | \$ 38 699                           | \$ 33 862                        | 0,03                      | NTT Finance Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 2,625 % éch. 01/08/2031                                                    | 8 000                               | 6 976                            | 0,01                      | Global Payments, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,620 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/10/2030                                                    | 74 775                              | 67 717                           | 0,05                      | 4,500 % éch. 15/11/2028                                                                  | 16 900                              | 16 702                           | 0,01                      | 16/07/2028                           | \$ 6 400                            | \$ 6 385                         | 0,01                      |
| 3,375 % éch. 15/02/2030                                                    | 35 522                              | 33 126                           | 0,03                      | Green Palm Bidco SARL                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,741 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/12/2027                                                    | 9 152                               | 9 109                            | 0,01                      | 5,957 % éch. 30/06/2041                                                                  | 69 700                              | 70 478                           | 0,06                      | 31/03/2028 (c)                       | 29 500                              | 29 522                           | 0,02                      |
| 4,625 % éch. 15/12/2029                                                    | 113 074                             | 109 748                          | 0,09                      | 6,462 % éch. 30/06/2046                                                                  | 88 600                              | 89 808                           | 0,07                      | 4,828 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| CGI, Inc.                                                                  |                                     |                                  |                           | Greene King Finance PLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 01/11/2029 (c)                       | 28 800                              | 28 789                           | 0,02                      |
| 1,450 % éch. 14/09/2026                                                    | 8 100                               | 8 055                            | 0,01                      | 4,064 % éch. 15/03/2035                                                                  | £ 2 987                             | 3 720                            | 0,00                      | 4,876 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 14/03/2030                                                    | 23 700                              | 23 616                           | 0,02                      | 5,106 % éch. 15/03/2034                                                                  | 2 368                               | 3 101                            | 0,00                      | 16/07/2030                           | 23 400                              | 23 352                           | 0,02                      |
| Chpe LLC                                                                   |                                     |                                  |                           | GSG Bidco Ltd.                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,012 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 30/06/2031                                                    | 23 800                              | 23 759                           | 0,02                      | 5,375 % éch. 15/06/2036                                                                  | € 55 000                            | 62 420                           | 0,05                      | 01/11/2031 (c)                       | 23 100                              | 23 075                           | 0,02                      |
| 5,100 % éch. 30/06/2033                                                    | 21 300                              | 21 250                           | 0,02                      | 6,375 % éch. 15/06/2051                                                                  | 120 000                             | 138 716                          | 0,11                      | 5,259 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| Claritex Corp. (6,000 % en numéraire et 0,750 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | Haleon U.S. Capital LLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 01/11/2033 (c)                       | 61 000                              | 60 830                           | 0,05                      |
| 6,750 % éch.                                                               |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 24/03/2027                                                                  | \$ 14 700                           | 14 594                           | 0,01                      | 5,483 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 31/03/2031 (d)                                                             | 18 240                              | 10 762                           | 0,01                      | Hughes Satellite Systems Corp.                                                           |                                     |                                  |                           | 01/11/2036 (c)                       | 38 500                              | 38 377                           | 0,03                      |
| Cogent Communications Group LLC                                            |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch.                                                                             |                                     |                                  |                           | ORLEN S.A.                           |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 15/06/2027                                                    | 6 400                               | 6 357                            | 0,01                      | 01/08/2026 (l)                                                                           | 10 000                              | 8 462                            | 0,01                      | 6,000 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| Cox Communications, Inc.                                                   |                                     |                                  |                           | Hyundai Capital America                                                                  |                                     |                                  |                           | 30/01/2035                           | 27 100                              | 28 080                           | 0,02                      |
| 3,350 % éch. 15/09/2026                                                    | 2 200                               | 2 195                            | 0,00                      | 4,300 % éch. 24/09/2027                                                                  | 73 900                              | 73 649                           | 0,06                      | Pennsylvania-American Water Co.      |                                     |                                  |                           |
| Crown Castle Towers LLC                                                    |                                     |                                  |                           | 4,552 % éch. 07/01/2028                                                                  | 5 900                               | 5 919                            | 0,00                      | 7,800 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,241 % éch. 15/07/2048                                                    | 11 100                              | 10 993                           | 0,01                      | 5,350 % éch. 19/03/2029                                                                  | 9 400                               | 9 532                            | 0,01                      | 01/09/2026                           | 1 500                               | 1 508                            | 0,00                      |
| CVS Health Corp.                                                           |                                     |                                  |                           | Icon Investments Six DAC                                                                 |                                     |                                  |                           | Petroleos de Venezuela S.A.          |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 21/08/2030                                                    | 300                                 | 266                              | 0,00                      | 5,809 % éch. 08/05/2027                                                                  | 27 389                              | 27 608                           | 0,02                      | 5,375 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| CVS Pass-Through Trust                                                     |                                     |                                  |                           | Illumina, Inc.                                                                           |                                     |                                  |                           | 12/04/2027 ^                         | 54 814                              | 20 226                           | 0,02                      |
| 4,163 % éch. 11/08/2036                                                    | 1 150                               | 1 077                            | 0,00                      | 4,650 % éch. 09/09/2026                                                                  | 40 700                              | 40 715                           | 0,03                      | 5,500 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,704 % éch. 10/01/2036                                                    | 4 276                               | 3 993                            | 0,00                      | Imperial Brands Finance Netherlands BV                                                   |                                     |                                  |                           | 12/04/2037 ^                         | 50 574                              | 18 586                           | 0,02                      |
| 5,926 % éch. 10/01/2034                                                    | 575                                 | 585                              | 0,00                      | 1,750 % éch. 18/03/2033                                                                  | € 13 600                            | 13 594                           | 0,01                      | 6,000 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 6,036 % éch. 10/12/2028                                                    | 1 229                               | 1 233                            | 0,00                      | 5,250 % éch. 15/02/2031                                                                  | 32 457                              | 39 710                           | 0,03                      | 16/05/2024 ^                         | 51 876                              | 19 557                           | 0,02                      |
| 6,943 % éch. 10/01/2030                                                    | 3 081                               | 3 160                            | 0,00                      | Imperial Brands Finance PLC                                                              |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 7,507 % éch. 10/01/2032                                                    | 4 215                               | 4 405                            | 0,00                      | 3,500 % éch. 26/07/2026                                                                  | \$ 8 084                            | 8 078                            | 0,01                      | 15/11/2026 ^                         | 70 377                              | 26 567                           | 0,02                      |
| 8,353 % éch. 10/07/2031                                                    | 3 256                               | 3 510                            | 0,00                      | 3,875 % éch. 02/08/2033                                                                  | € 25 400                            | 28 802                           | 0,02                      | 9,750 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| Davide Campari-Milano NV                                                   |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 12/02/2034                                                                  | 12 900                              | 14 543                           | 0,01                      | 17/05/2035 ^                         | 67 030                              | 29 983                           | 0,02                      |
| 4,250 % éch. 17/06/2033                                                    | € 77 900                            | 90 669                           | 0,07                      | Incora Intermediate LLC (0,000 % en numéraire ou 0,500 % de rémunération en nature)      |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch.                        |                                     |                                  |                           |
| Delta Air Lines Pass-Through Trust                                         |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch.                                                                             |                                     |                                  |                           | 17/02/2022 ^                         | 2 100                               | 1 052                            | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 10/12/2029                                                    | \$ 1 699                            | 1 642                            | 0,00                      | 31/01/2030 (d)                                                                           | \$ 11 452                           | 11 452                           | 0,01                      | Petroleos Mexicanos                  |                                     |                                  |                           |
| Deutsche Telekom International Finance BV                                  |                                     |                                  |                           | Incora Top Holdco LLC                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 3,600 % éch. 19/01/2027                                                    | 2 300                               | 2 290                            | 0,00                      | 6,000 % éch.                                                                             |                                     |                                  |                           | 28/01/2031                           | 26 961                              | 26 665                           | 0,02                      |
| Diamondback Energy, Inc.                                                   |                                     |                                  |                           | 30/01/2033 (k)                                                                           | 7 844                               | 12 362                           | 0,01                      | 6,700 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 5,200 % éch. 18/04/2027                                                    | 3 400                               | 3 420                            | 0,00                      | Informa PLC                                                                              |                                     |                                  |                           | 16/02/2032                           | 294 542                             | 297 333                          | 0,24                      |
| Discovery Communications LLC                                               |                                     |                                  |                           | Jabil, Inc.                                                                              |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 3,950 % éch. 20/03/2028                                                    | 74 100                              | 73 035                           | 0,06                      | 4,200 % éch. 01/02/2029                                                                  | \$ 8 100                            | 7 982                            | 0,01                      | 21/09/2047                           | 2 466                               | 2 113                            | 0,00                      |
| DISH DBS Corp.                                                             |                                     |                                  |                           | JetBlue Pass-Through Trust                                                               |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 01/12/2026                                                    | 292 227                             | 289 287                          | 0,23                      | 2,750 % éch. 15/11/2033                                                                  | 3 337                               | 2 961                            | 0,00                      | 28/01/2060                           | 60 850                              | 51 225                           | 0,04                      |
| 5,750 % éch. 01/12/2028                                                    | 125 300                             | 121 484                          | 0,10                      | 4,000 % éch. 15/05/2034                                                                  | 30 504                              | 28 973                           | 0,02                      | 7,690 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 01/07/2026                                                    | 11 876                              | 11 876                           | 0,01                      | JT International Financial Services BV                                                   |                                     |                                  |                           | 23/01/2050                           | 9 240                               | 8 624                            | 0,01                      |
| Enbridge, Inc.                                                             |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 11/04/2034                                                                  | € 57 700                            | 65 224                           | 0,05                      | Prosus NV                            |                                     |                                  |                           |
| 3,200 % éch. 08/06/2027                                                    | CAD 18 400                          | 12 982                           | 0,01                      | Keurig Dr Pepper, Inc.                                                                   |                                     |                                  |                           | 1,985 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,200 % éch. 20/11/2028                                                    | \$ 27 800                           | 27 556                           | 0,02                      | 5,100 % éch. 15/03/2027                                                                  | \$ 10 800                           | 10 837                           | 0,01                      | 13/07/2033                           | € 8 300                             | 8 361                            | 0,01                      |
| 4,500 % éch. 15/02/2031                                                    | 50 000                              | 49 284                           | 0,04                      | Las Vegas Sands Corp.                                                                    |                                     |                                  |                           | QatarEnergy                          |                                     |                                  |                           |
| 5,200 % éch. 20/11/2035                                                    | 6 150                               | 6 112                            | 0,01                      | 5,300 % éch. 15/05/2031                                                                  | 20 700                              | 20 627                           | 0,02                      | 4,625 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| Energy Transfer LP                                                         |                                     |                                  |                           | 5,650 % éch. 18/05/2033                                                                  | 31 700                              | 31 711                           | 0,03                      | 23/06/2029                           | \$ 318 013                          | 316 073                          | 0,25                      |
| 4,200 % éch. 15/04/2027                                                    | 1 200                               | 1 198                            | 0,00                      | Maple Parent Holdings Corp.                                                              |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC       |                                     |                                  |                           |
| 4,400 % éch. 15/03/2027                                                    | 2 000                               | 2 001                            | 0,00                      | 3,495 % éch. 26/03/2028                                                                  | € 31 600                            | 36 288                           | 0,03                      | 7,500 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 15/05/2028                                                    | 2 500                               | 2 513                            | 0,00                      | 3,881 % éch. 26/03/2030                                                                  | 34 900                              | 40 223                           | 0,03                      | 30/03/2045 (l)                       | 1 399 279                           | 1 395 423                        | 1,12                      |
| 5,250 % éch.                                                               |                                     |                                  |                           | 4,224 % éch. 26/03/2032                                                                  | 30 800                              | 35 694                           | 0,03                      | Repsol E&P Capital Markets U.S. LLC  |                                     |                                  |                           |
| 01/07/2029 (l)                                                             | 3 950                               | 4 007                            | 0,00                      | 4,728 % éch. 26/03/2035                                                                  | 32 600                              | 38 324                           | 0,03                      | 5,204 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 6,050 % éch. 01/12/2026                                                    | 18 300                              | 18 419                           | 0,02                      | Microchip Technology, Inc.                                                               |                                     |                                  |                           | 16/09/2030                           | 5 128                               | 5 157                            | 0,00                      |
| 6,400 % éch. 01/12/2030                                                    | 5 333                               | 5 647                            | 0,00                      | 4,900 % éch. 15/03/2028                                                                  | \$ 21 200                           | 21 314                           | 0,02                      | 5,976 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| Fedex Freight Holding Co., Inc.                                            |                                     |                                  |                           | Mitchells & Butlers Finance PLC                                                          |                                     |                                  |                           | 16/09/2035                           | 30 100                              | 30 710                           | 0,02                      |
| 4,300 % éch.                                                               |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 15/12/2030                                                                  | 1 925                               | 1 859                            | 0,00                      | Roadster Finance DAC                 |                                     |                                  |                           |
| 15/03/2029 (l)                                                             | 22 100                              | 21 806                           | 0,02                      | 6,013 % éch. 15/12/2030                                                                  | £ 2 985                             | 3 984                            | 0,00                      | 2,375 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| Fiserv, Inc.                                                               |                                     |                                  |                           | MPH Acquisition Holdings LLC                                                             |                                     |                                  |                           | 08/12/2032                           | € 7 000                             | 7 854                            | 0,01                      |
| 3,200 % éch. 01/07/2026                                                    | 1 800                               | 1 800                            | 0,00                      | 5,750 % éch. 31/12/2030                                                                  | \$ 2 087                            | 1 743                            | 0,00                      | Robert Bosch Finance LLC             |                                     |                                  |                           |
| Flora Food Management BV                                                   |                                     |                                  |                           | MPH Acquisition Holdings LLC (6,500 % en numéraire et 5,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 02/07/2029                                                    | € 39 200                            | 43 843                           | 0,04                      | 11,500 % éch.                                                                            |                                     |                                  |                           | 21/05/2029                           | 22 500                              | 25 780                           | 0,02                      |
| 7,500 % éch. 31/10/2030                                                    | 120 200                             | 137 133                          | 0,11                      | 31/12/2030 (d)                                                                           | 4 321                               | 4 281                            | 0,00                      | Rogers Communications, Inc.          |                                     |                                  |                           |
| Flutter Treasury DAC                                                       |                                     |                                  |                           | MPLX LP                                                                                  |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 04/06/2031                                                    | 34 400                              | 38 781                           | 0,03                      | 4,125 % éch. 01/03/2027                                                                  | 2 286                               | 2 281                            | 0,00                      | 15/03/2027                           | \$ 10 876                           | 10 777                           | 0,01                      |
| 5,875 % éch. 04/06/2031                                                    | \$ 11 200                           | 11 166                           | 0,01                      | 4,800 % éch. 15/02/2031                                                                  | 47 000                              | 46 828                           | 0,04                      | 3,650 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 04/06/2031                                                    | £ 20 700                            | 27 458                           | 0,02                      | National Football League                                                                 |                                     |                                  |                           | 31/03/2027                           | CAD 15 018                          | 10 623                           | 0,01                      |
| 6,375 % éch. 29/04/2029                                                    | \$ 5 000                            | 5 086                            | 0,00                      | 4,780 % éch.                                                                             |                                     |                                  |                           | Rolls-Royce PLC                      |                                     |                                  |                           |
| FMC Corp.                                                                  |                                     |                                  |                           | 05/10/2030 (k)                                                                           | 47 100                              | 46 570                           | 0,04                      | 5,750 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 01/06/2031                                                    | 15 000                              | 15 622                           | 0,01                      | National Fuel Gas Co.                                                                    |                                     |                                  |                           | 15/10/2027                           | \$ 130 473                          | 132 120                          | 0,11                      |
| Gartner, Inc.                                                              |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/05/2029                                                                  | 32 600                              | 32 519                           | 0,03                      | 7,487 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 20/03/2031                                                    | 50 000                              | 48 628                           | 0,04                      | Nissan Motor Co. Ltd.                                                                    |                                     |                                  |                           | Russian Railways Via RZD Capital PLC |                                     |                                  |                           |
| 5,600 % éch.                                                               |                                     |                                  |                           | 4,345 % éch. 17/09/2027                                                                  | 116 124                             | 114 307                          | 0,09                      | 25/03/2031 ^                         | 13 950                              | 12 961                           | 0,01                      |
| 20/11/2035 (l)                                                             | 50 000                              | 47 380                           | 0,04                      | 4,810 % éch. 17/09/2030                                                                  | 43 397                              | 40 438                           | 0,03                      | Saudi Arabian Oil Co.                |                                     |                                  |                           |
| Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.                                          |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 17/07/2030                                                                  | 26 533                              | 27 369                           | 0,02                      | 4,000 % éch.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,950 % éch. 23/03/2027                                                    | 20 300                              | 18 981                           | 0,02                      | NPC Ukrenargo                                                                            |                                     |                                  |                           | 02/02/2029                           | \$ 67 700                           | 66 557                           | 0,05                      |
| 4,950 % éch. 06/02/2028                                                    | 24 600                              | 21 526                           | 0,02                      | 6,875 % éch. 09/11/2028                                                                  | 1 000                               | 975                              | 0,00                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,288 % éch. 16/08/2037                                                    | 18 510                              | 13 883                           | 0,01                      |                                                                                          |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                             | (en milliers) | (en milliers) | NET | DESCRIPTION                      | (en milliers) | (en milliers)                                             | NET       | DESCRIPTION | (en milliers)           | (en milliers)                           | NET    |        |         |            |       |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|-----|----------------------------------|---------------|-----------------------------------------------------------|-----------|-------------|-------------------------|-----------------------------------------|--------|--------|---------|------------|-------|
| Smith & Nephew PLC                      |               |               |     | 5,375 % éch. 10/11/2033          | £             | 30 000                                                    | \$ 38 829 | 0,03        | 5,950 % éch. 01/11/2032 | \$                                      | 12 906 | \$     | 13 445  | 0,01       |       |
| 5,150 % éch. 20/03/2027                 | \$            | 4 100         | \$  | 4 115                            | 0,00          | 5,875 % éch. 20/06/2031                                   | 87 200    | 117 713     | 0,09                    | Sprint Capital Corp.                    |        |        |         |            |       |
| Smithfield Foods, Inc.                  |               |               |     | 6,250 % éch. 10/11/2041          |               | 21 500                                                    | 27 340    | 0,02        | 6,875 % éch. 15/11/2028 |                                         | 9 400  |        | 9 849   | 0,01       |       |
| 4,250 % éch. 01/02/2027                 |               | 500           |     | 499                              | 0,00          | COX Asset Mexico S.A. de C.V.                             |           |             | 0,02                    | 8,750 % éch. 15/03/2032 (I)             |        | 32 200 |         | 37 942     | 0,03  |
| SoftBank Group Corp.                    |               |               |     | 7,125 % éch. 08/01/2032          | \$            | 52 500                                                    | 53 319    | 0,04        | SW Finance PLC          |                                         |        |        |         |            |       |
| 6,375 % éch. 22/04/2030                 | €             | 7 700         |     | 9 039                            | 0,01          | 7,750 % éch. 08/05/2036                                   | 38 200    | 39 117      | 0,03                    | 1,625 % éch. 30/03/2027                 | £      | 19 758 |         | 25 543     | 0,02  |
| 7,625 % éch. 22/10/2029                 | \$            | 25 695        |     | 26 405                           | 0,02          | Edison International                                      |           |             | 0,07                    | 2,375 % éch. 28/05/2028                 |        | 50 479 |         | 63 145     | 0,05  |
| 8,250 % éch. 22/10/2031                 |               | 6 471         |     | 6 681                            | 0,01          | 5,000 % éch. 05/05/2028                                   | 81 200    | 81 316      | 0,07                    | 5,750 % éch. 19/11/2030                 |        | 54 300 |         | 70 315     | 0,06  |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust      |               |               |     | 5,250 % éch. 15/03/2032          |               | 15 600                                                    | 15 412    | 0,01        | 6,125 % éch. 19/11/2033 |                                         | 94 300 |        | 120 132 | 0,10       |       |
| 3,375 % éch. 15/08/2031                 |               | 2 087         |     | 1 922                            | 0,00          | 6,250 % éch. 15/03/2030                                   | 20 900    | 21 483      | 0,02                    | 6,192 % éch. 31/03/2029                 |        | 15 300 |         | 20 601     | 0,02  |
| 4,100 % éch. 01/10/2029                 |               | 7 560         |     | 7 336                            | 0,01          | Électricité de France S.A.                                |           |             | 0,01                    | 6,875 % éch. 07/08/2032                 |        | 83 100 |         | 111 112    | 0,09  |
| Spirits of St. Louis Basketball Club LP |               |               |     | 4,500 % éch. 21/09/2028 (I)      |               | 9 500                                                     | 9 480     | 0,01        | 6,875 % éch. 14/11/2034 |                                         | 30 000 |        | 39 860  | 0,03       |       |
| 5,490 % éch. 30/06/2036 (k)             |               | 5 000         |     | 4 968                            | 0,00          | 5,250 % éch. 22/04/2036                                   | 21 700    | 21 311      | 0,02                    | 7,750 % éch. 31/10/2031                 |        | 36 800 |         | 50 716     | 0,04  |
| Station Casinos LLC                     |               |               |     | Emera U.S. Finance LP            |               |                                                           |           |             |                         | Xcel Energy, Inc.                       |        |        |         |            |       |
| 4,500 % éch. 15/02/2028                 |               | 13 000        |     | 12 858                           | 0,01          | 2,639 % éch. 15/06/2031                                   | 7 800     | 7 010       | 0,01                    | 1,750 % éch. 15/03/2027                 | \$     | 11 300 |         | 11 095     | 0,01  |
| TD SYNNEX Corp.                         |               |               |     | ENEL Finance International NV    |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         | 2 966 416  | 2,38  |
| 4,300 % éch. 17/01/2029                 |               | 21 000        |     | 20 741                           | 0,02          | 2,125 % éch. 12/07/2028                                   | 8 600     | 8 188       | 0,01                    | Total des Obligations et billets privés |        |        |         | 33 513 671 | 26,86 |
| Telefonica Emisiones S.A.               |               |               |     | 4,125 % éch. 30/09/2028          |               | 20 700                                                    | 20 457    | 0,02        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,103 % éch. 08/03/2027                 |               | 21 100        |     | 21 018                           | 0,02          | 4,375 % éch. 30/09/2030                                   | 33 450    | 32 871      | 0,03                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Tennessee Gas Pipeline Co. LLC          |               |               |     | Entergy Texas, Inc.              |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 2,900 % éch. 01/03/2030                 |               | 8 200         |     | 7 685                            | 0,01          | 5,200 % éch. 15/06/2036                                   | 40 000    | 39 752      | 0,03                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC    |               |               |     | Every Missouri West, Inc.        |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                 | £             | 55 385        |     | 78 077                           | 0,06          | 4,700 % éch. 21/05/2029                                   | 9 200     | 9 194       | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Times Square Hotel Trust                |               |               |     | Eversource Energy                |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 8,528 % éch. 01/08/2026                 | \$            | 88            |     | 88                               | 0,00          | 5,000 % éch. 01/01/2027                                   | 500       | 502         | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Topaz Solar Farms LLC                   |               |               |     | Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,875 % éch. 30/09/2039                 |               | 4 456         |     | 3 955                            | 0,00          | 2,950 % éch. 27/01/2029                                   | 183 800   | 149 797     | 0,12                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 5,750 % éch. 30/09/2039                 |               | 52 236        |     | 51 472                           | 0,04          | Monongahela Power Co.                                     |           |             | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
| U.S. Renal Care, Inc.                   |               |               |     | 4,450 % éch. 15/08/2029          |               | 18 000                                                    | 17 910    | 0,01        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 10,625 % éch. 28/06/2028                |               | 3 879         |     | 3 607                            | 0,00          | NorthWestern Corp.                                        |           |             | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Ubisoft Entertainment S.A.              |               |               |     | 5,073 % éch. 21/03/2030          |               | 26 800                                                    | 27 066    | 0,02        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 0,878 % éch. 24/11/2027                 | €             | 22 700        |     | 22 966                           | 0,02          | Oncor Electric Delivery Co. LLC                           |           |             | 0,05                    |                                         |        |        |         |            |       |
| UCB S.A.                                |               |               |     | 5,700 % éch. 24/06/2033          | AUD           | 87 400                                                    | 60 876    | 0,05        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,250 % éch. 20/03/2030                 |               | 3 400         |     | 3 979                            | 0,00          | Pacific Gas & Electric Co.                                |           |             | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
| United Airlines Pass-Through Trust      |               |               |     | 2,100 % éch. 01/08/2027          | \$            | 12 977                                                    | 12 638    | 0,01        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 2,700 % éch. 01/11/2033                 | \$            | 20 081        |     | 18 337                           | 0,02          | 2,500 % éch. 01/02/2031 (I)                               | 56 091    | 50 345      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 3,500 % éch. 01/09/2031                 |               | 2 173         |     | 2 098                            | 0,00          | 3,000 % éch. 15/06/2028                                   | 31 800    | 30 784      | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 3,750 % éch. 03/03/2028                 |               | 5 776         |     | 5 773                            | 0,00          | 3,250 % éch. 01/06/2031                                   | 44 030    | 40 631      | 0,03                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,150 % éch. 25/02/2033                 |               | 611           |     | 594                              | 0,00          | 3,300 % éch. 15/03/2027                                   | 30 565    | 30 299      | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 5,875 % éch. 15/04/2029                 |               | 47 778        |     | 48 367                           | 0,04          | 3,300 % éch. 01/12/2027                                   | 149 277   | 146 516     | 0,12                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Universal Music Group NV                |               |               |     | 3,750 % éch. 01/07/2028          |               | 113 794                                                   | 111 806   | 0,09        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 3,375 % éch. 16/06/2030                 | €             | 35 300        |     | 40 632                           | 0,03          | 4,200 % éch. 01/03/2029                                   | 49 035    | 48 355      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,125 % éch. 16/06/2036                 |               | 31 800        |     | 36 861                           | 0,03          | 4,400 % éch. 01/03/2032                                   | 27 000    | 26 104      | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Valaris Ltd.                            |               |               |     | 4,550 % éch. 01/07/2030 (I)      |               | 207 115                                                   | 204 014   | 0,16        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 8,375 % éch. 30/04/2030 (I)             | \$            | 7 302         |     | 7 586                            | 0,01          | 4,650 % éch. 01/08/2028                                   | 4 200     | 4 190       | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Venture Global Cascasieu Pass LLC       |               |               |     | 5,000 % éch. 04/06/2028          |               | 121 801                                                   | 122 492   | 0,10        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 3,875 % éch. 15/08/2029                 |               | 44 300        |     | 42 279                           | 0,01          | 5,050 % éch. 15/11/2031                                   | 54 200    | 54 162      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 3,875 % éch. 01/11/2033                 |               | 153 500       |     | 136 910                          | 0,11          | 5,200 % éch. 01/05/2036                                   | 20 200    | 19 628      | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,125 % éch. 15/08/2031                 |               | 30 900        |     | 29 022                           | 0,02          | 5,450 % éch. 15/06/2027                                   | 8 600     | 8 667       | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Venture Global LNG, Inc.                |               |               |     | 5,550 % éch. 15/05/2029 (I)      |               | 13 773                                                    | 14 061    | 0,01        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 7,000 % éch. 15/01/2030                 |               | 18 400        |     | 18 775                           | 0,02          | 5,700 % éch. 01/03/2035                                   | 17 900    | 18 094      | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 9,500 % éch. 01/02/2029                 |               | 253 612       |     | 273 092                          | 0,22          | 5,900 % éch. 15/06/2032                                   | 10 000    | 10 346      | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 9,875 % éch. 01/02/2032                 |               | 11 100        |     | 11 854                           | 0,01          | 6,000 % éch. 15/08/2035                                   | 52 700    | 54 355      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Venture Global Plaquemines LNG LLC      |               |               |     | 6,100 % éch. 15/01/2029          |               | 28 850                                                    | 29 711    | 0,02        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 6,125 % éch. 15/12/2030                 |               | 56 600        |     | 57 938                           | 0,05          | 6,150 % éch. 15/01/2033                                   | 5 869     | 6 134       | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Volkswagen Group of America Finance LLC |               |               |     | 6,400 % éch. 15/06/2033          |               | 42 149                                                    | 44 616    | 0,04        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,550 % éch. 11/09/2028                 |               | 1 900         |     | 1 889                            | 0,00          | PacifiCorp                                                |           |             | 0,03                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 4,750 % éch. 13/11/2028                 |               | 14 800        |     | 14 762                           | 0,01          | 4,250 % éch. 15/03/2029                                   | 36 105    | 35 680      | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 5,050 % éch. 27/03/2028                 |               | 43 300        |     | 43 495                           | 0,04          | 4,650 % éch. 15/04/2029                                   | 22 700    | 22 647      | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Windstream Services LLC                 |               |               |     | 5,100 % éch. 15/04/2033 (I)      |               | 40 500                                                    | 40 882    | 0,03        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 8,250 % éch. 01/10/2031                 |               | 130 289       |     | 137 467                          | 0,11          | 5,400 % éch. 15/04/2033 (I)                               | 48 400    | 49 150      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
| Yorkshire Water Finance PLC             |               |               |     | 5,800 % éch. 15/04/2036 (I)      |               | 21 900                                                    | 22 487    | 0,02        |                         |                                         |        |        |         |            |       |
| 1,750 % éch. 27/10/2032                 | £             | 6 500         |     | 6 855                            | 0,01          | Peru LNG SRL                                              |           |             | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 6,000 % éch. 22/07/2033                 |               | 35 000        |     | 46 608                           | 0,04          | 5,375 % éch. 22/03/2030                                   | 400       | 389         | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
| 6,375 % éch. 18/11/2034                 |               | 40 630        |     | 55 235                           | 0,04          | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara |           |             | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     | 11 126 29                        |               | 4,125 % éch. 15/05/2027                                   | 15 600    | 15 514      | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     | 2                                | 8,92          | Pinnacle West Capital Corp.                               |           |             | 0,02                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 4,650 % éch. 01/06/2029                                   | 22 600    | 22 608      | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | Rio Oil Finance Trust                                     |           |             | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 8,200 % éch. 06/04/2028                                   | 7 841     | 8 046       | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 9,750 % éch. 06/01/2027                                   | 1 570     | 1 594       | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | Southern California Edison Co.                            |           |             | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 2,250 % éch. 01/06/2030                                   | 5 284     | 4 796       | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 2,750 % éch. 01/02/2032                                   | 14 284    | 12 714      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 4,000 % éch. 01/06/2027                                   | 46 060    | 46 063      | 0,01                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 4,950 % éch. 15/09/2031 (I)                               | 44 700    | 44 615      | 0,04                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 5,250 % éch. 15/03/2030                                   | 70 200    | 71 002      | 0,06                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               | 5,300 % éch. 01/03/2028 (I)                               | 2 198     | 2 219       | 0,00                    |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |
|                                         |               |               |     |                                  |               |                                                           |           |             |                         |                                         |        |        |         |            |       |

# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Freddie Mac               |                                     |                                  |                           | 4,391 % éch. 20/03/2065                                   | \$ 166                              | \$ 166                           | 0,00                      | 5,000 % éch. 01/06/2034 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 1,263 % éch.              |                                     |                                  |                           | 4,401 % éch. 20/02/2065                                   | 371                                 | 372                              | 0,00                      | 01/05/2056                                                     | \$ 12 312 622                       | \$ 12 136 809                    | 9,73                      |
| 25/04/2029 (a)            | \$ 20 822                           | \$ 513                           | 0,00                      | 4,409 % éch. 20/09/2055 -                                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/12/2034 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,258 % éch.              |                                     |                                  |                           | 20/10/2065                                                | 30 415                              | 30 516                           | 0,03                      | 01/05/2054                                                     | 1 245 191                           | 1 258 578                        | 1,01                      |
| 25/12/2049 (a)            | 17 278                              | 2 058                            | 0,00                      | 4,411 % éch. 20/10/2064 -                                 |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/08/2031 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,443 % éch.              |                                     |                                  |                           | 20/02/2070                                                | 1 508                               | 1 512                            | 0,00                      | 01/05/2054                                                     | 1 254 491                           | 1 289 937                        | 1,03                      |
| 15/11/2042 (a)            | 2 571                               | 295                              | 0,00                      | 4,421 % éch. 20/12/2065                                   | 814                                 | 817                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 01/10/2026 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,485 % éch. 15/01/2041   | 320                                 | 286                              | 0,00                      | 4,459 % éch. 20/04/2054                                   | 38 361                              | 38 474                           | 0,03                      | 01/06/2055                                                     | 74 492                              | 77 617                           | 0,06                      |
| 2,493 % éch.              |                                     |                                  |                           | 4,461 % éch. 20/03/2062 -                                 |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 01/03/2045 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 15/01/2042 (a)            | 127                                 | 9                                | 0,00                      | 20/08/2066                                                | 276                                 | 277                              | 0,00                      | 01/04/2055                                                     | 12 401                              | 13 206                           | 0,01                      |
| 2,500 % éch. 15/09/2027 - |                                     |                                  |                           | 4,481 % éch. 20/09/2063 -                                 |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/04/2029 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 15/12/2027 (a)            | 820                                 | 11                               | 0,00                      | 20/02/2066                                                | 97                                  | 97                               | 0,00                      | 01/10/2030                                                     | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,842 % éch. 25/06/2054   | 34 524                              | 33 626                           | 0,03                      | 4,489 % éch. 20/02/2073                                   | 753                                 | 762                              | 0,00                      | 8,000 % éch. 01/03/2030                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 15/12/2032 - |                                     |                                  |                           | 4,501 % éch. 15/07/2030 -                                 |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |
| 15/04/2049                | 2 703                               | 385                              | 0,00                      | 20/07/2053                                                | 112 373                             | 110 809                          | 0,09                      | 2,000 % éch. 01/07/2041                                        | 200                                 | 182                              | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 01/11/2046 - |                                     |                                  |                           | 4,511 % éch. 20/10/2066 -                                 |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/07/2041 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 01/05/2049 (a)            | 1 430                               | 1 283                            | 0,00                      | 20/02/2070                                                | 1 607                               | 1 618                            | 0,00                      | 01/07/2056                                                     | 1 350                               | 1 258                            | 0,00                      |
| 3,043 % éch.              |                                     |                                  |                           | 4,531 % éch. 20/10/2066                                   | 17                                  | 17                               | 0,00                      | 3,000 % éch. 01/07/2041 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 15/03/2037 (a)            | 50                                  | 4                                | 0,00                      | 4,541 % éch. 20/09/2066 -                                 |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                     | 1 319 100                           | 1 156 940                        | 0,93                      |
| 3,500 % éch. 15/12/2032 - |                                     |                                  |                           | 20/01/2067                                                | 1 355                               | 1 362                            | 0,00                      | 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 1 726 946                           | 1 565 787                        | 1,26                      |
| 15/06/2049 (a)            | 5 439                               | 849                              | 0,00                      | 4,559 % éch. 20/11/2055                                   | 39 827                              | 39 956                           | 0,03                      | 4,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/07/2046 - |                                     |                                  |                           | 4,561 % éch. 20/06/2066 -                                 |                                     |                                  |                           | 01/09/2056                                                     | 5 658 853                           | 5 285 430                        | 4,24                      |
| 01/05/2049                | 6 079                               | 5 632                            | 0,01                      | 20/09/2066                                                | 1 552                               | 1 558                            | 0,00                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/05/2039 - |                                     |                                  |                           | 4,609 % éch. 20/10/2055                                   | 26 251                              | 26 420                           | 0,02                      | 01/09/2056                                                     | 3 987 180                           | 3 816 063                        | 3,06                      |
| 01/11/2047                | 23                                  | 23                               | 0,00                      | 4,611 % éch. 20/07/2066 -                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch.              |                                     |                                  |                           | 20/04/2070                                                | 1 155                               | 1 165                            | 0,00                      | 01/08/2056                                                     | 6 037 854                           | 5 926 856                        | 4,75                      |
| 15/06/2049 (a)            | 3 436                               | 611                              | 0,00                      | 4,641 % éch. 20/04/2066                                   | 220                                 | 221                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,071 % éch. 25/10/2046   | 3 226                               | 3 199                            | 0,00                      | 4,661 % éch. 20/04/2066                                   | 526                                 | 529                              | 0,00                      | 01/09/2056                                                     | 6 849 910                           | 6 860 716                        | 5,50                      |
| 4,302 % éch. 25/10/2052   | 116 287                             | 99 472                           | 0,08                      | 4,681 % éch. 20/07/2065                                   | 2 280                               | 2 296                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,448 % éch. 25/11/2052   | 148 506                             | 136 729                          | 0,11                      | 4,711 % éch. 20/12/2066                                   | 19                                  | 20                               | 0,00                      | 01/09/2056                                                     | 13 390 238                          | 13 634 337                       | 10,93                     |
| 4,492 % éch. 25/11/2055   | 36 114                              | 32 031                           | 0,03                      | 4,761 % éch. 20/04/2063 -                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 01/08/2048   | 5 265                               | 5 144                            | 0,01                      | 20/03/2066                                                | 2 465                               | 2 482                            | 0,00                      | 01/08/2056                                                     | 10 348 261                          | 10 695 330                       | 8,57                      |
| 4,500 % éch.              |                                     |                                  |                           | 4,898 % éch. 20/04/2067                                   | 289                                 | 291                              | 0,00                      | 7,000 % éch. 01/08/2056                                        | 782 300                             | 822 199                          | 0,66                      |
| 15/05/2049 (a)            | 2 401                               | 456                              | 0,00                      | 4,911 % éch. 20/03/2066                                   | 12                                  | 12                               | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,673 % éch. 15/10/2033   | 192                                 | 188                              | 0,00                      | 4,927 % éch. 20/08/2068                                   | 233                                 | 234                              | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 25/07/2056 - |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 20/11/2032 -                                 |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 25/11/2057                | 76 145                              | 74 382                           | 0,06                      | 20/06/2049                                                | 151 156                             | 153 292                          | 0,12                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                |                                     |                                  |                           |
| 4,828 % éch. 25/12/2054   | 21 964                              | 22 236                           | 0,02                      | 5,125 % éch. 20/12/2045                                   | 1 977                               | 2 019                            | 0,00                      | Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch.              |                                     |                                  |                           | 5,197 % éch. 20/06/2067                                   | 8 888                               | 8 983                            | 0,01                      | 2,500 % éch. 15/02/2045                                        | 59 000                              | 41 397                           | 0,03                      |
| 15/02/2049 (a)            | 1 019                               | 178                              | 0,00                      | 5,375 % éch. 20/07/2045 -                                 |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 15/05/2043                                        | 69 079                              | 53 040                           | 0,04                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2033 - |                                     |                                  |                           | 20/09/2045                                                | 3 267                               | 3 331                            | 0,00                      | 2,875 % éch. 15/08/2045                                        | 510 010                             | 378 603                          | 0,30                      |
| 01/04/2036                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,577 % éch. 20/09/2067                                   | 4 508                               | 4 566                            | 0,00                      | 3,000 % éch. 15/11/2044                                        | 371 252                             | 284 080                          | 0,23                      |
| 6,000 % éch. 01/01/2033 - |                                     |                                  |                           | 5,581 % éch. 20/07/2067                                   | 4 505                               | 4 561                            | 0,00                      | 3,000 % éch. 15/08/2048                                        | 81 815                              | 59 965                           | 0,05                      |
| 01/09/2033                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 15/04/2037 -                                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/02/2049                                        | 10 169                              | 7 417                            | 0,01                      |
| 6,391 % éch. 25/12/2047   | 1 113                               | 1 111                            | 0,00                      | 20/02/2055                                                | 1 293                               | 1 317                            | 0,00                      | 3,125 % éch. 15/02/2043                                        | 178 076                             | 142 426                          | 0,11                      |
| 6,500 % éch. 01/02/2032 - |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/05/2028 -                                 |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 15/08/2044                                        | 283 117                             | 221 616                          | 0,18                      |
| 25/11/2049                | 2 219                               | 2 309                            | 0,00                      | 20/05/2055                                                | 30 054                              | 31 165                           | 0,03                      | 3,125 % éch. 15/05/2048                                        | 55 840                              | 41 969                           | 0,03                      |
| 7,000 % éch. 01/11/2026 - |                                     |                                  |                           | 6,751 % éch. 20/09/2066                                   | 1 668                               | 1 698                            | 0,00                      | 3,375 % éch. 15/05/2044                                        | 416 095                             | 339 345                          | 0,27                      |
| 01/06/2037                | 4                                   | 1                                | 0,00                      | 6,907 % éch. 20/09/2066                                   | 4 736                               | 4 851                            | 0,00                      | 3,625 % éch. 15/02/2044                                        | 145 436                             | 123 263                          | 0,10                      |
| 8,000 % éch. 01/07/2030   | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 7,000 % éch. 20/01/2027 -                                 |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/11/2043                                        | 80 988                              | 70 026                           | 0,06                      |
| Ginnie Mae                |                                     |                                  |                           | 15/05/2038                                                | 1                                   | 0                                | 0,00                      | 4,250 % éch. 15/08/2054                                        | 178 800                             | 159 670                          | 0,13                      |
| 0,000 % éch.              |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/09/2026 -                                 |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/08/2043                                        | 208 600                             | 196 218                          | 0,16                      |
| 20/05/2049 (a)            | 28 310                              | 145                              | 0,00                      | 20/01/2030                                                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,500 % éch. 15/11/2054                                        | 1 009 800                           | 940 199                          | 0,75                      |
| 0,046 % éch.              |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 15/03/2030 -                                 |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/11/2045                                        | 448 303                             | 430 651                          | 0,35                      |
| 20/01/2049 (a)            | 5 731                               | 79                               | 0,00                      | 20/03/2030                                                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,625 % éch. 15/02/2046                                        | 67 500                              | 64 811                           | 0,05                      |
| 0,300 % éch.              |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/01/2031                                   | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,625 % éch. 15/05/2054                                        | 418 600                             | 397 629                          | 0,32                      |
| 16/05/2050 (a)            | 604                                 | 1                                | 0,00                      | 10,138 % éch. 20/04/2037                                  | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 4,750 % éch. 15/02/2056                                        | 2 145 679                           | 2 084 829                        | 1,67                      |
| 1,993 % éch. 20/12/2040   | 1 170                               | 1 068                            | 0,00                      | Ginnie Mae, TBA                                           |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/08/2045                                        | 65 312                              | 64 832                           | 0,05                      |
| 2,402 % éch.              |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/07/2056                                   | 13 500                              | 11 529                           | 0,01                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (h)     |                                     |                                  |                           |
| 16/01/2043 (a)            | 318                                 | 20                               | 0,00                      | 3,000 % éch. 01/07/2056 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/10/2026                                        | 434 102                             | 431 776                          | 0,35                      |
| 2,530 % éch. 20/12/2040   | 171                                 | 145                              | 0,00                      | 01/08/2056                                                | 328 500                             | 291 453                          | 0,23                      | 0,125 % éch. 15/01/2031                                        | 12 278                              | 11 343                           | 0,01                      |
| 3,500 % éch.              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/07/2056                                   | 198 000                             | 184 087                          | 0,15                      | 0,125 % éch. 15/07/2031                                        | 64 382                              | 59 125                           | 0,05                      |
| 20/03/2043 (a)            | 428                                 | 49                               | 0,00                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,125 % éch. 15/01/2032                                        | 52 605                              | 47 638                           | 0,04                      |
| 3,500 % éch. 20/02/2052 - |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                | 861 772                             | 827 610                          | 0,66                      | 0,250 % éch. 15/07/2029                                        | 909 786                             | 867 966                          | 0,69                      |
| 20/03/2056                | 1 835 051                           | 3                                | 1,33                      | 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 15/02/2050                                        | 125 740                             | 70 918                           | 0,06                      |
| 4,000 % éch. 20/03/2054 - |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                | 1 212 700                           | 1 195 312                        | 0,96                      | 0,375 % éch. 15/01/2027                                        | 20 978                              | 20 704                           | 0,02                      |
| 20/06/2054                | 60 561                              | 56 669                           | 0,05                      | 5,500 % éch. 01/07/2056 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,375 % éch.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,059 % éch. 20/01/2072   | 533                                 | 532                              | 0,00                      | 01/08/2056                                                | 446 050                             | 447 728                          | 0,36                      | 15/07/2027 (l)                                                 | 5 662                               | 5 568                            | 0,00                      |
| 4,061 % éch. 20/03/2068   | 31                                  | 31                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 01/08/2056 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,625 % éch. 15/07/2032                                        | 576 597                             | 534 167                          | 0,43                      |
| 4,111 % éch. 20/08/2065   | 503                                 | 501                              | 0,00                      | 01/09/2056                                                | 2 156 000                           | 2 196 811                        | 1,76                      | 0,625 % éch. 15/02/2043                                        | 17 522                              | 12 786                           | 0,01                      |
| 4,181 % éch. 20/02/2065   | 1 239                               | 1 237                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 01/07/2056 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 15/07/2028                                        | 186 796                             | 182 690                          | 0,15                      |
| 4,211 % éch. 20/08/2066   | 7                                   | 7                                | 0,00                      | 01/08/2056                                                | 1 994 000                           | 2 065 430                        | 1,66                      | 0,750 % éch. 15/02/2042                                        | 49 653                              | 37 921                           | 0,03                      |
| 4,241 % éch. 20/04/2065   | 23                                  | 23                               | 0,00                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 15/02/2045                                        | 164 949                             | 117 231                          | 0,09                      |
| 4,261 % éch. 20/07/2064 - |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/06/2031 -                                 |                                     |                                  |                           | 0,875 % éch. 15/01/2029                                        | 224 528                             | 218 483                          | 0,17                      |
| 20/11/2069                | 237                                 | 237                              | 0,00                      | 01/03/2032                                                | 135                                 | 129                              | 0,00                      | 0,875 % éch. 15/02/2047                                        | 127 575                             | 89 742                           | 0,07                      |
| 4,273 % éch. 20/03/2060   | 141                                 | 141                              | 0,00                      | 3,000 % éch. 01/08/2026 -                                 |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/02/2046                                        | 68 427                              | 50 276                           | 0,04                      |
| 4,275 % éch. 20/07/2064   | 106                                 | 106                              | 0,00                      | 01/12/2052                                                | 413 433                             | 364 881                          | 0,29                      | 1,000 % éch. 15/02/2048                                        | 151 615                             | 107 967                          | 0,09                      |
| 4,301 % éch. 20/07/2063   | 114                                 | 114                              | 0,00                      | 3,500 % éch. 01/05/2032 -                                 |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/02/2049                                        | 398 794                             | 280 232                          | 0,22                      |
| 4,309 % éch. 20/02/2074   | 4 649                               | 4 660                            | 0,00                      | 01/05/2052                                                | 151 259                             | 139 824                          | 0,11                      | 1,125 % éch. 15/01/2033                                        | 56 554                              | 53 510                           | 0,04                      |
| 4,331 % éch. 20/04/2062   | 212                                 | 212                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 01/08/2030 -                                 |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch. 15/07/2033                                        | 1 570 115                           | 1 506 558                        | 1,21                      |
| 4,361 % éch. 20/01/2062 - |                                     |                                  |                           | 01/09/2052                                                | 312 851                             | 299 265                          | 0,24                      | 1,375 % éch. 15/02/2044                                        | 19 142                              | 15 639                           | 0,01                      |
| 20/10/2065                | 57                                  | 57                               | 0,00                      | 4,500 % éch. 01/09/2033 -                                 |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 15/02/2053                                        | 181 218                             | 137 814                          | 0,11                      |
| 4,381 % éch. 20/04/2065   | 198                                 | 199                              | 0,00                      | 01/07/2053                                                | 9 507                               | 9 281                            | 0,01                      | 1,625 % éch. 15/04/2030                                        | 148 511                             | 146 748                          | 0,12                      |



| DESCRIPTION                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 1,750 % éch. 15/01/2034                                                                           | \$ 396 404                          | \$ 387 421                       | 0,31                      | 6,750 % éch. 25/11/2046                 | \$ 3 500                            | \$ 3 192                         | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/07/2037                       | \$ 1 431                            | \$ 1 379                         | 0,00                      |
| 1,875 % éch. 15/07/2034                                                                           | 2 627 273                           | 2 590 208                        | 2,08                      | American Home Mortgage Investment Trust |                                     |                                  |                           | 4,354 % éch. 20/05/2047                       | 1 041                               | 988                              | 0,00                      |
| 2,125 % éch. 15/02/2040                                                                           | 25 261                              | 24 379                           | 0,02                      | 3,953 % éch. 25/05/2047                 | 1 930                               | 1 156                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/08/2036                       | 131                                 | 121                              | 0,00                      |
| 2,125 % éch. 15/02/2041                                                                           | 11 402                              | 10 895                           | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/03/2046                 | 5 863                               | 5 421                            | 0,01                      | 4,686 % éch. 20/05/2036                       | 893                                 | 845                              | 0,00                      |
| Billets du Trésor américain                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/12/2046                 | 5 983                               | 5 175                            | 0,01                      | 4,723 % éch. 20/02/2036                       | 25                                  | 20                               | 0,00                      |
| 0,375 % éch. 30/09/2027                                                                           | 38 660                              | 36 907                           | 0,03                      | 4,163 % éch. 25/03/2046                 | 2 183                               | 2 024                            | 0,00                      | 4,727 % éch. 20/01/2047                       | 1 099                               | 961                              | 0,00                      |
| 0,500 % éch. 31/10/2027                                                                           | 46 600                              | 44 416                           | 0,04                      | 4,363 % éch. 25/09/2045                 | 5 058                               | 4 600                            | 0,01                      | 4,804 % éch. 20/04/2035                       | 1 457                               | 1 355                            | 0,00                      |
| 0,625 % éch. 30/11/2027                                                                           | 542 910                             | 516 825                          | 0,41                      | 4,363 % éch. 25/11/2045                 | 4 350                               | 3 072                            | 0,00                      | 4,889 % éch. 20/11/2035                       | 1 889                               | 1 670                            | 0,00                      |
| 0,625 % éch. 31/12/2027                                                                           | 230 260                             | 218 558                          | 0,18                      | 4,588 % éch. 25/02/2045                 | 5 243                               | 5 045                            | 0,01                      | 4,970 % éch. 20/09/2035                       | 1 429                               | 1 173                            | 0,00                      |
| 0,750 % éch. 31/01/2028                                                                           | 199 210                             | 188 868                          | 0,15                      | 5,770 % éch. 25/09/2035                 | 2 911                               | 1 057                            | 0,00                      | 5,178 % éch. 20/05/2036                       | 147                                 | 138                              | 0,00                      |
| 1,500 % éch. 15/08/2026                                                                           | 56 200                              | 56 035                           | 0,04                      | 5,876 % éch. 25/12/2036                 | 3 001                               | 2 553                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/01/2036                       | 9                                   | 9                                | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 15/11/2026                                                                           | 9 100                               | 9 035                            | 0,01                      | 5,883 % éch. 25/09/2035                 | 10 210                              | 5 444                            | 0,01                      | 5,500 % éch. 25/03/2036                       | 35                                  | 32                               | 0,00                      |
| 2,250 % éch. 15/02/2027                                                                           | 262 600                             | 259 784                          | 0,21                      | 6,500 % éch. 25/03/2047                 | 630                                 | 363                              | 0,00                      | 5,608 % éch. 20/02/2036                       | 33                                  | 32                               | 0,00                      |
| 2,375 % éch. 31/03/2029                                                                           | 139 700                             | 133 277                          | 0,11                      | 6,950 % éch. 25/06/2036                 | 7 599                               | 888                              | 0,00                      | 5,632 % éch. 20/11/2034                       | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 2,375 % éch. 15/05/2029                                                                           | 255 400                             | 243 209                          | 0,19                      | Angel Oak Mortgage Trust                |                                     |                                  |                           | 5,693 % éch. 20/07/2036                       | 32                                  | 32                               | 0,00                      |
| 2,750 % éch. 15/08/2032                                                                           | 832 400                             | 764 605                          | 0,61                      | 1,469 % éch. 25/06/2065                 | 457                                 | 447                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/11/2035                       | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 2,875 % éch. 15/08/2028                                                                           | 500                                 | 487                              | 0,00                      | Antler Mortgage Funding PLC             |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/03/2036                       | 56                                  | 47                               | 0,00                      |
| 2,875 % éch. 15/05/2032                                                                           | 171 690                             | 159 424                          | 0,13                      | 0,000 % éch. 20/02/2068 (f) £           | 0                                   | 11 076                           | 0,01                      | 5,773 % éch. 25/05/2037                       | 67                                  | 63                               | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 15/01/2029                                                                           | 375 000                             | 369 009                          | 0,30                      | 4,947 % éch. 20/02/2068                 | 60 505                              | 79 081                           | 0,07                      | 5,791 % éch. 20/11/2034                       | 25                                  | 24                               | 0,00                      |
| 3,875 % éch. 15/03/2028                                                                           | 823 000                             | 819 110                          | 0,66                      | 5,347 % éch. 20/02/2068                 | 34 940                              | 45 728                           | 0,04                      | 5,846 % éch. 25/01/2037                       | 144                                 | 134                              | 0,00                      |
| 3,875 % éch. 15/06/2028                                                                           | 955 400                             | 950 306                          | 0,76                      | 5,747 % éch. 20/02/2068                 | 16 191                              | 21 177                           | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                       | 372                                 | 297                              | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 31/10/2029                                                                           | 592 900                             | 589 704                          | 0,47                      | 7,247 % éch. 20/02/2068                 | 19 600                              | 26 112                           | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/08/2036                       | 175                                 | 151                              | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 31/07/2032                                                                           | 1 997 703                           | 1 969 064                        | 1,58                      | 8,747 % éch. 20/02/2068                 | 6 818                               | 9 089                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/09/2036                       | 471                                 | 413                              | 0,00                      |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                           | 57 200                              | 55 815                           | 0,04                      | 9,747 % éch. 20/02/2068                 | 10 751                              | 13 994                           | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                       | 1 220                               | 986                              | 0,00                      |
| 4,250 % éch. 15/01/2028                                                                           | 1 733 800                           | 1 735 832                        | 1,39                      | APS Resecuritization Trust              |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 26/10/2037                       | 967                                 | 905                              | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     | 23 241 961                       | 18,63                     | 3,142 % éch. 27/06/2049                 | \$ 976                              | 959                              | 0,00                      | 6,176 % éch. 20/06/2032                       | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br/>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | Aran Funding DAC                        |                                     |                                  |                           | 6,253 % éch. 25/10/2036                       | 6                                   | 6                                | 0,00                      |
| 1211 Avenue of the Americas Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | 3,379 % éch. 24/12/2065                 | € 31 723                            | 36 328                           | 0,03                      | 6,263 % éch. 25/10/2036                       | 136                                 | 122                              | 0,00                      |
| 3,901 % éch. 10/08/2035                                                                           | 1 500                               | 1 456                            | 0,00                      | Ashford Hospitality Trust               |                                     |                                  |                           | 6,307 % éch. 20/07/2036                       | 22                                  | 22                               | 0,00                      |
| 4,230 % éch. 10/08/2035                                                                           | 9 600                               | 9 238                            | 0,01                      | 4,698 % éch. 15/04/2035                 | \$ 167                              | 167                              | 0,00                      | 6,347 % éch. 25/01/2037                       | 449                                 | 418                              | 0,00                      |
| 4,280 % éch. 10/08/2035                                                                           | 7 400                               | 7 067                            | 0,01                      | 5,048 % éch. 15/04/2035                 | 3 000                               | 3 001                            | 0,00                      | 6,479 % éch. 25/10/2036                       | 360                                 | 334                              | 0,00                      |
| 20 Times Square Trust                                                                             |                                     |                                  |                           | 5,198 % éch. 15/04/2035                 | 2 500                               | 2 496                            | 0,00                      | 7,842 % éch. 26/07/2035                       | 93                                  | 78                               | 0,00                      |
| 3,203 % éch. 15/05/2035                                                                           | 37 355                              | 33 945                           | 0,03                      | Atlas Funding PLC                       |                                     |                                  |                           | Banc of America Merrill Lynch Trust           |                                     |                                  |                           |
| 280 Park Avenue Mortgage Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,563 % éch. 20/01/2068                 | £ 9 400                             | 12 501                           | 0,01                      | 2,848 % éch. 14/08/2034                       | 18 900                              | 13 513                           | 0,01                      |
| 4,792 % éch. 15/09/2034                                                                           | 700                                 | 699                              | 0,00                      | 4,586 % éch. 20/09/2061                 | 18 614                              | 24 731                           | 0,02                      | 3,819 % éch. 14/07/2037                       | 8 000                               | 7 816                            | 0,01                      |
| 5,162 % éch. 15/09/2034                                                                           | 2 000                               | 1 994                            | 0,00                      | 4,886 % éch. 20/01/2061                 | 21 718                              | 28 858                           | 0,02                      | 4,325 % éch. 15/08/2046                       | 400                                 | 361                              | 0,00                      |
| Adjustable Rate Mortgage Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | Atrium Hotel Portfolio Trust            |                                     |                                  |                           | 6,013 % éch. 17/06/2050                       | 200                                 | 35                               | 0,00                      |
| 3,282 % éch. 25/08/2035                                                                           | 277                                 | 218                              | 0,00                      | 4,853 % éch. 15/12/2036                 | \$ 32 844                           | 32 706                           | 0,03                      | Banc of America Mortgage Trust                |                                     |                                  |                           |
| 4,003 % éch. 25/08/2036                                                                           | 10 635                              | 3 643                            | 0,00                      | 5,423 % éch. 15/12/2036                 | 4 000                               | 3 951                            | 0,00                      | 3,632 % éch. 20/10/2046                       | 168                                 | 147                              | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/05/2036                                                                           | 3 405                               | 1 305                            | 0,00                      | Auburn PLC                              |                                     |                                  |                           | 4,681 % éch. 25/01/2036                       | 66                                  | 58                               | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/06/2037                                                                           | 2 163                               | 2 743                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 20/07/2045 (f) £           | 3 726                               | 3 571                            | 0,00                      | 4,891 % éch. 20/11/2046                       | 97                                  | 86                               | 0,00                      |
| 4,280 % éch. 25/09/2035                                                                           | 2 077                               | 1 785                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 20/07/2045 (a)(f)          | 180                                 | 0                                | 0,00                      | 5,214 % éch. 25/08/2035                       | 763                                 | 736                              | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/01/2036                                                                           | 73                                  | 71                               | 0,00                      | 5,734 % éch. 20/07/2045                 | 137                                 | 18                               | 0,00                      | 5,437 % éch. 25/09/2035                       | 432                                 | 379                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/02/2036                                                                           | 140                                 | 82                               | 0,00                      | Avon Finance PLC                        |                                     |                                  |                           | 5,438 % éch. 25/07/2035                       | 588                                 | 562                              | 0,00                      |
| 4,408 % éch. 25/05/2036                                                                           | 52                                  | 45                               | 0,00                      | 4,646 % éch. 28/12/2049                 | 26 413                              | 35 072                           | 0,03                      | 5,616 % éch. 25/01/2035                       | 460                                 | 444                              | 0,00                      |
| 4,713 % éch. 25/08/2035                                                                           | 679                                 | 622                              | 0,00                      | Banc of America Alternative Loan Trust  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/03/2037                       | 512                                 | 442                              | 0,00                      |
| 4,884 % éch. 25/03/2037                                                                           | 3 422                               | 2 789                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/01/2037                 | \$ 1 197                            | 1 007                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                       | 156                                 | 125                              | 0,00                      |
| 4,913 % éch. 25/01/2035                                                                           | 289                                 | 258                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/12/2035                 | 109                                 | 99                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2046                       | 13                                  | 12                               | 0,00                      |
| 4,913 % éch. 25/03/2035                                                                           | 720                                 | 643                              | 0,00                      | 5,913 % éch. 25/10/2036                 | 9 057                               | 2 245                            | 0,00                      | 6,244 % éch. 25/02/2036                       | 7                                   | 7                                | 0,00                      |
| 5,043 % éch. 25/04/2035                                                                           | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2035                 | 149                                 | 134                              | 0,00                      | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust |                                     |                                  |                           |
| 5,416 % éch. 25/01/2036                                                                           | 21                                  | 20                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                 | 291                                 | 252                              | 0,00                      | 3,966 % éch. 10/08/2033                       | 29 004                              | 27 111                           | 0,02                      |
| 5,594 % éch. 25/01/2036                                                                           | 1 588                               | 1 115                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2037                 | 358                                 | 309                              | 0,00                      | 4,197 % éch. 10/08/2035                       | 1 350                               | 1 330                            | 0,00                      |
| 6,037 % éch. 25/11/2037                                                                           | 725                                 | 446                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2046                 | 1 633                               | 1 334                            | 0,00                      | 5,814 % éch. 15/07/2037                       | 10 000                              | 9 453                            | 0,01                      |
| AFG Trust                                                                                         |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2046                 | 1 053                               | 912                              | 0,00                      | 6,314 % éch. 15/07/2037                       | 24 373                              | 22 060                           | 0,02                      |
| 5,012 % éch. 10/10/2057                                                                           | AUD 14 656                          | 10 152                           | 0,01                      | 6,500 % éch. 25/03/2036                 | 1 211                               | 1 112                            | 0,00                      | BCAP LLC Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                           | 34 000                              | 23 493                           | 0,02                      | Banc of America Funding Corp.           |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 26/08/2036                       | 597                                 | 211                              | 0,00                      |
| Alba PLC                                                                                          |                                     |                                  |                           | 4,371 % éch. 25/09/2048                 | 1 140                               | 1 087                            | 0,00                      | 3,149 % éch. 26/01/2037                       | 3 179                               | 2 920                            | 0,00                      |
| 4,036 % éch. 17/03/2039                                                                           | £ 3 797                             | 5 019                            | 0,01                      | Banc of America Funding Trust           |                                     |                                  |                           | 3,786 % éch. 26/07/2037                       | 2 655                               | 2 431                            | 0,00                      |
| 4,086 % éch. 15/12/2038                                                                           | 5 386                               | 6 933                            | 0,01                      | 3,795 % éch. 26/10/2036                 | 3 705                               | 3 589                            | 0,00                      | 3,949 % éch. 26/03/2037                       | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,106 % éch. 17/03/2039                                                                           | 3 133                               | 4 049                            | 0,00                      | 3,795 % éch. 29/04/2037                 | 7 060                               | 6 473                            | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/04/2037                       | 1 071                               | 1 036                            | 0,00                      |
| 4,156 % éch. 17/03/2039                                                                           | 5 005                               | 6 282                            | 0,01                      | 3,823 % éch. 25/01/2037                 | 1 716                               | 1 528                            | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/01/2037                       | 1 979                               | 1 771                            | 0,00                      |
| 4,216 % éch. 25/11/2042                                                                           | 957                                 | 1 257                            | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/04/2037                 | 2 473                               | 2 118                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/03/2037                       | 4 731                               | 4 452                            | 0,01                      |
| Alliance Bancorp Trust                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,922 % éch. 20/05/2035                 | 432                                 | 403                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/10/2036                       | 38                                  | 40                               | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/07/2037                                                                           | \$ 790                              | 712                              | 0,00                      | 3,959 % éch. 26/07/2036                 | 2 531                               | 2 247                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/04/2037                       | 42                                  | 41                               | 0,00                      |
| American Home Mortgage Assets Trust                                                               |                                     |                                  |                           | 3,976 % éch. 26/05/2037                 | 5 111                               | 4 588                            | 0,01                      | 4,183 % éch. 25/05/2047                       | 157                                 | 155                              | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/11/2035                                                                           | 750                                 | 518                              | 0,00                      | 4,007 % éch. 27/08/2036                 | 9 619                               | 9 333                            | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/02/2047                       | 755                                 | 729                              | 0,00                      |
| 3,883 % éch. 25/10/2046                                                                           | 4 499                               | 4 155                            | 0,00                      | 4,007 % éch. 20/06/2047                 | 2 557                               | 2 272                            | 0,00                      | 4,273 % éch. 26/04/2047                       | 1 929                               | 1 831                            | 0,00                      |
| 3,888 % éch. 25/03/2047                                                                           | 947                                 | 863                              | 0,00                      | 4,051 % éch. 20/09/2046                 | 51                                  | 44                               | 0,00                      | 4,440 % éch. 26/03/2037                       | 59                                  | 59                               | 0,00                      |
| 3,953 % éch. 25/10/2046                                                                           | 8 683                               | 4 984                            | 0,01                      | 4,074 % éch. 20/02/2047                 | 2 076                               | 1 975                            | 0,00                      | 4,643 % éch. 26/07/2037                       | 453                                 | 425                              | 0,00                      |
| 3,953 % éch. 25/12/2046                                                                           | 4 000                               | 3 511                            | 0,00                      | 4,132 % éch. 20/07/2047                 | 621                                 | 605                              | 0,00                      | 5,063 % éch. 25/09/2047                       | 793                                 | 726                              | 0,00                      |
| 3,973 % éch. 25/10/2046                                                                           | 3 599                               | 1 793                            | 0,00                      | 4,134 % éch. 20/10/2036                 | 6 144                               | 4 831                            | 0,01                      | 5,250 % éch. 26/05/2037                       | 2 730                               | 1 148                            | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/09/2046                                                                           | 2 126                               | 2 099                            | 0,00                      | 4,134 % éch. 20/12/2046                 | 1 555                               | 1 438                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 26/02/2036                       | 728                                 | 475                              | 0,00                      |
| 4,343 % éch. 25/08/2037                                                                           | 1 104                               | 1 013                            | 0,00                      | 4,174 % éch. 20/04/2047                 | 576                                 | 500                              | 0,00                      | 6,163 % éch. 25/10/2047                       | 1 883                               | 1 415                            | 0,00                      |
| 4,444 % éch. 25/02/2047                                                                           | 23 826                              | 7 946                            | 0,01                      | 4,174 % éch. 20/05/2047                 | 4 532                               | 4 273                            | 0,01                      | 6,250 % éch. 26/08/2036                       | 1 521                               | 513                              | 0,00                      |
| 4,664 % éch. 25/11/2046                                                                           | 30 326                              | 6 902                            | 0,01                      | 4,174 % éch. 20/06/2047                 | 337                                 | 282                              | 0,00                      | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust   |                                     |                                  |                           |
| 4,684 % éch. 25/10/2046                                                                           | 3 566                               | 2 332                            | 0,00                      | 4,239 % éch. 20/01/2047                 | 112                                 | 97                               | 0,00                      | 3,996 % éch. 25/05/2047                       | 106                                 | 88                               | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,312 % éch. 20/05/2036                 | 162                                 | 143                              | 0,00                      | 4,015 % éch. 25/05/2047                       | 2 363                               | 2 135                            | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,314 % éch. 20/06/2047                 | 1 384                               | 1 166                            | 0,00                      | 4,032 % éch. 25/08/2047                       | 941                                 | 832                              | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,323 % éch. 25/07/2037                 | 146                                 | 140                              | 0,00                      | 4,109 % éch. 25/07/2036                       | 140                                 | 121                              | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,343 % éch. 25/05/2037                 | 3 565                               | 3 293                            | 0,00                      | 4,400 % éch. 25/07/2034                       | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 4,506 % éch. 25/06/2035                       | 10                                  | 9                                | 0,00                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 4,584 % éch. 25/10/2046                       | 893                                 | 840                              | 0,00                      |

# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,770 % éch. 25/08/2035                             | \$ 455                              | \$ 396                           | 0,00                      | Blackwattle RMBS Trust                                                |                                     |                                  |                           | 4,384 % éch. 25/09/2064                                          | \$ 10 713                           | \$ 9 058                         | 0,01                      |
| 5,011 % éch. 25/02/2036                             | 1 365                               | 1 249                            | 0,00                      | 5,049 % éch. 12/12/2056                                               | AUD 2 027                           | \$ 1 405                         | 0,00                      | 4,445 % éch. 25/09/2037                                          | 2 239                               | 1 994                            | 0,00                      |
| 5,040 % éch. 25/07/2034                             | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 5,050 % éch. 12/02/2058 (c)                                           | 60 000                              | 41 568                           | 0,04                      | 4,449 % éch. 25/03/2037                                          | 997                                 | 863                              | 0,00                      |
| 5,296 % éch. 25/02/2047                             | 1 730                               | 1 498                            | 0,00                      | Bletchley Park Funding PLC                                            |                                     |                                  |                           | 4,466 % éch. 25/06/2036                                          | 774                                 | 752                              | 0,00                      |
| 5,461 % éch. 25/10/2033                             | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,604 % éch. 27/07/2070                                               | £ 18 198                            | 24 193                           | 0,02                      | 4,562 % éch. 25/03/2037                                          | 152                                 | 151                              | 0,00                      |
| 5,528 % éch. 25/06/2035                             | 26                                  | 25                               | 0,00                      | BNPP Mortgage Securities LLC Trust                                    |                                     |                                  |                           | 4,597 % éch. 20/02/2036                                          | 1 201                               | 1 116                            | 0,00                      |
| 5,604 % éch. 25/11/2034                             | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 27/08/2037                                               | \$ 950                              | 321                              | 0,00                      | 4,619 % éch. 25/11/2036                                          | 1 610                               | 1 403                            | 0,00                      |
| 5,625 % éch. 25/02/2033                             | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Braccan Mortgage Funding PLC                                          |                                     |                                  |                           | 4,744 % éch. 25/07/2037                                          | 956                                 | 878                              | 0,00                      |
| 5,778 % éch. 25/10/2035                             | 282                                 | 282                              | 0,00                      | 4,587 % éch. 15/02/2067                                               | £ 41 625                            | 55 284                           | 0,05                      | 4,755 % éch. 25/11/2036                                          | 347                                 | 226                              | 0,00                      |
| 5,910 % éch. 25/04/2033                             | 18                                  | 18                               | 0,00                      | Brants Bridge PLC                                                     |                                     |                                  |                           | 4,802 % éch. 25/12/2035                                          | 413                                 | 244                              | 0,00                      |
| 5,950 % éch. 25/02/2036                             | 728                                 | 705                              | 0,00                      | 4,647 % éch. 14/06/2066                                               | 5 859                               | 7 785                            | 0,01                      | 4,838 % éch. 25/04/2035                                          | 265                                 | 259                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2033                             | 1                                   | 1                                | 0,00                      | BXP Trust                                                             |                                     |                                  |                           | 4,878 % éch. 25/03/2036                                          | 207                                 | 199                              | 0,00                      |
| 6,273 % éch. 25/12/2046                             | 2 984                               | 2 519                            | 0,00                      | 3,379 % éch. 13/06/2039                                               | \$ 90 000                           | 88 716                           | 0,07                      | 4,923 % éch. 25/04/2037                                          | 1 120                               | 1 016                            | 0,00                      |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                     |                                     |                                  |                           | Canada Square Funding PLC                                             |                                     |                                  |                           | 5,329 % éch. 25/08/2035                                          | 201                                 | 188                              | 0,00                      |
| 3,871 % éch. 25/04/2037                             | 197                                 | 134                              | 0,00                      | 4,597 % éch. 17/01/2059                                               | £ 2 322                             | 3 083                            | 0,00                      | 5,461 % éch. 25/07/2036                                          | 102                                 | 72                               | 0,00                      |
| 3,947 % éch. 25/05/2036                             | 583                                 | 546                              | 0,00                      | 5,409 % éch. 17/06/2058                                               | 1 061                               | 1 412                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/09/2035                                          | 411                                 | 417                              | 0,00                      |
| 4,050 % éch. 25/08/2036                             | 4 480                               | 1 973                            | 0,00                      | <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                                   |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/11/2035                                          | 1 342                               | 1 072                            | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/08/2036                             | 4 464                               | 4 068                            | 0,00                      | 4,197 % éch. 25/12/2035                                               | \$ 159                              | 156                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/12/2035                                          | 645                                 | 642                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/11/2036                             | 1 793                               | 1 662                            | 0,00                      | 4,214 % éch. 25/12/2035                                               | 57                                  | 50                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2036                                          | 30                                  | 31                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/06/2046                             | 2 030                               | 1 884                            | 0,00                      | 4,350 % éch. 25/03/2037                                               | 1 964                               | 1 840                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                                          | 1 370                               | 457                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/01/2047                             | 1 305                               | 1 234                            | 0,00                      | 4,569 % éch. 25/01/2036                                               | 343                                 | 319                              | 0,00                      | 6,019 % éch. 25/05/2042                                          | 703                                 | 695                              | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/08/2036                             | 12 205                              | 11 318                           | 0,01                      | 4,763 % éch. 25/07/2037                                               | 389                                 | 311                              | 0,00                      | 6,279 % éch. 25/07/2036                                          | 347                                 | 261                              | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/12/2046                             | 4 306                               | 3 987                            | 0,00                      | 4,847 % éch. 25/03/2037                                               | 540                                 | 529                              | 0,00                      | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through</b> |                                     |                                  |                           |
| 4,143 % éch. 25/05/2036                             | 8 247                               | 7 248                            | 0,01                      | 5,250 % éch. 25/05/2035                                               | 0                                   | 0                                | 0,00                      | <b>Certificates</b>                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,203 % éch. 25/04/2036                             | 2 072                               | 1 896                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                               | 1 751                               | 1 208                            | 0,00                      | 4,405 % éch. 25/09/2035                                          | 963                                 | 925                              | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/02/2036                             | 5 997                               | 5 769                            | 0,01                      | 5,525 % éch. 25/02/2037                                               | 630                                 | 608                              | 0,00                      | <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                       |                                     |                                  |                           |
| 4,261 % éch. 25/07/2035                             | 265                                 | 175                              | 0,00                      | 5,654 % éch. 25/02/2037                                               | 146                                 | 143                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/05/2037                                          | 2 947                               | 2 531                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/01/2036                             | 3 396                               | 3 340                            | 0,00                      | 5,738 % éch. 25/02/2037                                               | 780                                 | 772                              | 0,00                      | 4,313 % éch. 25/01/2037                                          | 3 541                               | 2 975                            | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/11/2035                             | 7 614                               | 7 256                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                                               | 2 594                               | 978                              | 0,00                      | 4,313 % éch. 25/02/2037                                          | 1 112                               | 927                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/10/2035                             | 1 033                               | 980                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2036                                               | 938                                 | 367                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/03/2037                                          | 1 883                               | 1 565                            | 0,00                      |
| 4,394 % éch. 25/11/2036                             | 9 235                               | 4 582                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                               | 2 449                               | 1 038                            | 0,00                      | 4,413 % éch. 25/12/2036                                          | 1 250                               | 1 041                            | 0,00                      |
| 4,403 % éch. 25/04/2034                             | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2037                                               | 5 758                               | 2 111                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/04/2036                                          | 159                                 | 147                              | 0,00                      |
| 4,419 % éch. 25/08/2046                             | 3 101                               | 2 075                            | 0,00                      | 6,327 % éch. 25/07/2037                                               | 86                                  | 68                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/12/2036                                          | 1 370                               | 1 221                            | 0,00                      |
| 4,463 % éch. 25/10/2035                             | 10                                  | 10                               | 0,00                      | <b>ChaseFlex Trust</b>                                                |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/02/2037                                          | 403                                 | 360                              | 0,00                      |
| 4,471 % éch. 25/09/2047                             | 15 945                              | 8 089                            | 0,01                      | 4,034 % éch. 25/09/2036                                               | 418                                 | 367                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/03/2037                                          | 415                                 | 367                              | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/08/2035                             | 2 813                               | 2 784                            | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/05/2037                                               | 1 694                               | 1 651                            | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/04/2037                                          | 2 734                               | 2 492                            | 0,00                      |
| 4,495 % éch. 25/09/2035                             | 1 646                               | 531                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/07/2037                                               | 5 752                               | 5 191                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                          | 601                                 | 537                              | 0,00                      |
| 4,518 % éch. 25/07/2035                             | 542                                 | 366                              | 0,00                      | 5,000 % éch. 25/07/2037                                               | 1 395                               | 434                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/09/2036                                          | 147                                 | 134                              | 0,00                      |
| 4,592 % éch. 25/01/2047                             | 482                                 | 219                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2035                                               | 723                                 | 593                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/10/2036                                          | 156                                 | 135                              | 0,00                      |
| 4,642 % éch. 25/09/2035                             | 1 314                               | 676                              | 0,00                      | <b>ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/11/2036                                          | 2 454                               | 2 272                            | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/11/2034                             | 185                                 | 186                              | 0,00                      | <b>Trust</b>                                                          |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/05/2037                                          | 305                                 | 283                              | 0,00                      |
| 4,738 % éch. 25/07/2035                             | 1 226                               | 1 231                            | 0,00                      | 4,067 % éch. 25/08/2037                                               | 483                                 | 412                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2037                                          | 4 945                               | 4 447                            | 0,01                      |
| 4,758 % éch. 25/09/2034                             | 59                                  | 54                               | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/08/2037                                               | 4 270                               | 3 904                            | 0,00                      | <b>Commercial Mortgage Trust</b>                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,850 % éch. 25/01/2036                             | 347                                 | 330                              | 0,00                      | <b>Chester A PLC</b>                                                  |                                     |                                  |                           | 1,356 % éch. 10/10/2049 (a)                                      | 38 181                              | 1                                | 0,00                      |
| 4,870 % éch. 25/10/2035                             | 491                                 | 406                              | 0,00                      | 0,000 % éch.                                                          |                                     |                                  |                           | 3,140 % éch. 10/10/2036                                          | 19 220                              | 18 972                           | 0,02                      |
| 4,888 % éch. 25/01/2035                             | 1 061                               | 1 024                            | 0,00                      | 17/03/2046 (f)(k)                                                     | £ 13 675                            | 17 635                           | 0,02                      | 3,942 % éch. 10/04/2033                                          | 2 400                               | 2 346                            | 0,00                      |
| 4,991 % éch. 25/09/2035                             | 3 197                               | 974                              | 0,00                      | 1,000 % éch. 20/05/2046 (k)                                           | 1                                   | 4 939                            | 0,01                      | 3,961 % éch. 10/05/2051                                          | 39 998                              | 39 512                           | 0,03                      |
| 5,044 % éch. 25/05/2035                             | 289                                 | 279                              | 0,00                      | 5,147 % éch. 17/03/2046 (k)                                           | 5 588                               | 7 434                            | 0,01                      | 4,921 % éch. 15/09/2033                                          | 28 649                              | 27 165                           | 0,02                      |
| 5,135 % éch. 25/12/2046                             | 118                                 | 77                               | 0,00                      | 5,997 % éch. 17/03/2046 (k)                                           | 14 727                              | 19 602                           | 0,02                      | <b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b>       |                                     |                                  |                           |
| 5,392 % éch. 25/09/2035                             | 995                                 | 763                              | 0,00                      | 6,897 % éch. 17/03/2046 (k)                                           | 13 675                              | 18 216                           | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                                          | 252                                 | 131                              | 0,00                      |
| 5,413 % éch. 25/09/2034                             | 741                                 | 746                              | 0,00                      | 7,747 % éch. 17/03/2046 (k)                                           | 8 415                               | 11 217                           | 0,01                      | 6,250 % éch. 25/08/2037                                          | 1 128                               | 486                              | 0,00                      |
| <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>   |                                     |                                  |                           | 8,247 % éch. 17/03/2046 (k)                                           | 4 207                               | 5 605                            | 0,01                      | 7,000 % éch. 25/01/2037                                          | 273                                 | 42                               | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/10/2034                             | 34                                  | 31                               | 0,00                      | <b>Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates</b>           |                                     |                                  |                           | <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/12/2035                             | 2 429                               | 1 109                            | 0,00                      | 3,855 % éch. 25/08/2035                                               | \$ 205                              | 172                              | 0,00                      | 2,737 % éch. 25/09/2037 (a)                                      | 771                                 | 115                              | 0,00                      |
| 5,125 % éch. 25/03/2034                             | 15                                  | 36                               | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/01/2036                                               | 154                                 | 150                              | 0,00                      | 3,187 % éch. 25/10/2037 (a)                                      | 1 465                               | 207                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/08/2035                             | 1 394                               | 774                              | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/05/2036                                               | 408                                 | 398                              | 0,00                      | 3,470 % éch. 25/05/2035                                          | 1 576                               | 1 253                            | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/09/2035                             | 123                                 | 117                              | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/01/2036                                               | 420                                 | 409                              | 0,00                      | 3,656 % éch. 25/07/2021                                          | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 5,750 % éch. 25/11/2034                             | 1 000                               | 899                              | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/10/2036                                               | 770                                 | 752                              | 0,00                      | 3,934 % éch. 20/02/2047                                          | 5 163                               | 4 222                            | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 25/03/2037                             | 1 455                               | 1 340                            | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/08/2035                                               | 432                                 | 424                              | 0,00                      | 3,944 % éch. 20/03/2047                                          | 4 552                               | 4 015                            | 0,00                      |
| <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>          |                                     |                                  |                           | 4,033 % éch. 25/05/2035                                               | 325                                 | 315                              | 0,00                      | 3,949 % éch. 20/12/2046                                          | 6 576                               | 5 951                            | 0,01                      |
| 4,043 % éch. 25/03/2037                             | 1 933                               | 1 855                            | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/01/2035                                               | 104                                 | 104                              | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/06/2036                                          | 1 214                               | 1 179                            | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/12/2046                             | 7 189                               | 6 471                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/08/2035                                               | 72                                  | 71                               | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/12/2046                                          | 480                                 | 441                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/06/2047                             | 2 169                               | 1 902                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/05/2035                                               | 88                                  | 86                               | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/03/2047                                          | 1 339                               | 1 137                            | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/06/2047                             | 5 178                               | 4 597                            | 0,01                      | 4,123 % éch. 25/03/2035                                               | 66                                  | 67                               | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/08/2037                                          | 5 207                               | 5 026                            | 0,01                      |
| 4,143 % éch. 25/01/2037                             | 8 136                               | 7 749                            | 0,01                      | 4,343 % éch. 25/10/2035                                               | 222                                 | 217                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/04/2047                                          | 4 390                               | 4 045                            | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/02/2037                             | 7 118                               | 6 756                            | 0,01                      | 4,443 % éch. 25/10/2034                                               | 116                                 | 116                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/08/2035                                          | 210                                 | 129                              | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/09/2047                             | 8 636                               | 8 032                            | 0,01                      | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                            |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/11/2035                                          | 638                                 | 39                               | 0,00                      |
| <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b> |                                     |                                  |                           | 3,194 % éch. 25/02/2037                                               | 2 644                               | 2 000                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/09/2047                                          | 2 424                               | 2 288                            | 0,00                      |
| 3,918 % éch. 26/12/2046                             | 1 336                               | 1 039                            | 0,00                      | 3,601 % éch. 25/08/2047                                               | 175                                 | 160                              | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/05/2047                                          | 2 485                               | 2 306                            | 0,00                      |
| 4,750 % éch. 26/01/2036                             | 1 075                               | 751                              | 0,00                      | 3,893 % éch. 25/06/2036                                               | 3 255                               | 3 142                            | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/05/2036                                          | 2 007                               | 723                              | 0,00                      |
| <b>Beckett Mortgages DAC</b>                        |                                     |                                  |                           | 3,912 % éch. 25/04/2036                                               | 335                                 | 178                              | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/10/2036                                          | 1 425                               | 569                              | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 20/07/2071 (f)                         | € 171                               | 1 323                            | 0,00                      | 3,979 % éch. 25/08/2036                                               | 5 120                               | 2 017                            | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/11/2036                                          | 3 486                               | 3 372                            | 0,00                      |
| 2,735 % éch. 20/07/2071                             | 34 610                              | 39 531                           | 0,03                      | 4,083 % éch. 25/09/2036                                               | 179                                 | 172                              | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/09/2046                                          | 1 557                               | 1 489                            | 0,00                      |
| 3,035 % éch. 20/07/2071                             | 1 671                               | 1 908                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/01/2037                                               | 2 189                               | 1 944                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/05/2047                                          | 233                                 | 219                              | 0,00                      |
| 3,285 % éch. 20/07/2071                             | 1 474                               | 1 687                            | 0,00                      | 4,111 % éch. 25/08/2035                                               | 1 707                               | 1 452                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/06/2047                                          | 3 333                               | 3 056                            | 0,00                      |
| 3,535 % éch. 20/07/2071                             | 786                                 | 894                              | 0,00                      | 4,133 % éch. 25/05/2035                                               | 94                                  | 91                               | 0,00                      | 4,133 % éch. 25/02/2037                                          | 689                                 | 183                              | 0,00                      |
| 4,785 % éch. 20/07/2071                             | 393                                 | 452                              | 0,00                      | 4,145 % éch. 25/01/2082                                               | 20 370                              | 17 506                           | 0,02                      | 4,139 % éch. 25/06/2037                                          | 4 559                               | 4 349                            | 0,01                      |
| 6,085 % éch. 20/07/2071                             | 393                                 | 456                              | 0,00                      | 4,147 % éch. 25/10/2035                                               | 60                                  | 57                               | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/07/2046                                          | 283                                 | 323                              | 0,00                      |
| 8,585 % éch. 20/07/2071                             | 314                                 | 349                              | 0,00                      | 4,201 % éch. 25/03/2037                                               | 2 111                               | 1 862                            | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/08/2046                                          | 7 199                               | 6 433                            | 0,01                      |
| <b>BellaVista Mortgage Trust</b>                    |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/09/2036                                               | 2 322                               | 2 233                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/05/2036                                          | 1 371                               | 1 238                            | 0,00                      |
| 4,474 % éch. 22/01/2045                             | \$ 245                              | 239                              | 0,00                      |                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 2                                                   |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,174 % éch. 20/03/2046 | \$ 3 915                            | \$ 3 735                         | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2034                           | \$ 2 429                            | \$ 2 433                         | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2036                                 | \$ 1 034                            | \$ 485                           | 0,00                      |
| 4,174 % éch. 20/05/2046 | 12 403                              | 11 300                           | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/12/2034                           | 516                                 | 459                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                                 | 4 484                               | 1 814                            | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/07/2046 | 4 317                               | 4 027                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2035                           | 1 010                               | 821                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                 | 2 345                               | 1 054                            | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/09/2047 | 3 416                               | 3 283                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2035                           | 51                                  | 18                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                                 | 3 627                               | 1 541                            | 0,00                      |
| 4,213 % éch. 25/09/2035 | 1 575                               | 937                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/12/2035                           | 2 970                               | 2 024                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2037                                 | 3 855                               | 1 541                            | 0,00                      |
| 4,218 % éch. 20/07/2035 | 943                                 | 921                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2036                           | 1 652                               | 1 085                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                 | 2 667                               | 1 169                            | 0,00                      |
| 4,223 % éch. 25/03/2036 | 2 227                               | 2 174                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2036                           | 1 227                               | 1 064                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                 | 8 400                               | 3 423                            | 0,00                      |
| 4,223 % éch. 25/11/2036 | 3 102                               | 2 927                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2036                           | 3 106                               | 1 304                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2037                                 | 1 105                               | 429                              | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/07/2035 | 812                                 | 675                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2036                           | 7 566                               | 3 326                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                                 | 3 312                               | 1 352                            | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/01/2037 | 2 502                               | 2 211                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                           | 1 830                               | 670                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/10/2037                                 | 1 120                               | 762                              | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/05/2035 | 3 243                               | 2 501                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2036                           | 14 738                              | 8 924                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/01/2038                                 | 6 757                               | 2 807                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/06/2035 | 2 548                               | 1 753                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/10/2036                           | 4 335                               | 2 164                            | 0,00                      | 6,057 % éch. 20/12/2035                                 | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/12/2035 | 1 282                               | 708                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2036                           | 7 721                               | 4 032                            | 0,00                      | 6,148 % éch. 20/02/2036                                 | 1 312                               | 1 240                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/07/2036 | 2 104                               | 776                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/12/2036                           | 2 114                               | 573                              | 0,00                      | 6,241 % éch. 20/07/2034                                 | 42                                  | 41                               | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/09/2036 | 100                                 | 36                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2037                           | 1 136                               | 640                              | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/09/2036                                 | 475                                 | 192                              | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/05/2037 | 1 899                               | 620                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                           | 10 662                              | 3 469                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2034                                 | 230                                 | 218                              | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/06/2037 | 2 902                               | 2 776                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2037                           | 4 844                               | 1 777                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/12/2037                                 | 4 671                               | 1 680                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/09/2037 | 771                                 | 255                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                           | 6 341                               | 2 975                            | 0,00                      | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust          |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/07/2046 | 1 712                               | 1 603                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                           | 10 619                              | 4 155                            | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/06/2035                                 | 19                                  | 18                               | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/07/2035 | 950                                 | 874                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2037                           | 6 267                               | 3 117                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/07/2036                                 | 167                                 | 160                              | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/12/2035 | 728                                 | 690                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                           | 17 575                              | 8 439                            | 0,01                      | 4,710 % éch. 25/01/2034                                 | 144                                 | 131                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/01/2036 | 1 765                               | 1 647                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2047                           | 2 115                               | 997                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/03/2035                                 | 107                                 | 109                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/07/2036 | 1 939                               | 1 812                            | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/11/2036                           | 414                                 | 184                              | 0,00                      | Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.            |                                     |                                  |                           |
| 4,313 % éch. 25/08/2035 | 2 158                               | 1 716                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2032                           | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 5,945 % éch. 27/11/2035                                 | 134                                 | 116                              | 0,00                      |
| 4,314 % éch. 20/09/2046 | 3 338                               | 3 054                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/09/2037                           | 8 949                               | 3 322                            | 0,00                      | Countrywide, Inc.                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/08/2035 | 2 291                               | 2 236                            | 0,00                      | 6,750 % éch. 25/10/2036                           | 1 415                               | 381                              | 0,00                      | 5,693 % éch. 27/11/2035                                 | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,323 % éch. 25/02/2037 | 3 558                               | 2 977                            | 0,00                      | 7,000 % éch. 25/10/2037                           | 5 274                               | 1 658                            | 0,00                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.    |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/10/2046 | 5 546                               | 5 326                            | 0,01                      | 7,500 % éch. 25/07/2036                           | 1 684                               | 1 077                            | 0,00                      | 5,000 % éch. 25/07/2035                                 | 396                                 | 375                              | 0,00                      |
| 4,323 % éch. 25/08/2047 | 4 225                               | 3 598                            | 0,00                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |                                     |                                  |                           | 5,476 % éch. 25/06/2046                                 | 10 614                              | 9 943                            | 0,01                      |
| 4,343 % éch. 25/02/2036 | 940                                 | 903                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/04/2036                           | 576                                 | 534                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/07/2035                                 | 1 352                               | 1 231                            | 0,00                      |
| 4,358 % éch. 20/11/2035 | 928                                 | 846                              | 0,00                      | 4,483 % éch. 25/11/2035                           | 65                                  | 64                               | 0,00                      | 5,641 % éch. 25/03/2033                                 | 45                                  | 45                               | 0,00                      |
| 4,359 % éch. 25/03/2047 | 480                                 | 463                              | 0,00                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/12/2035                                 | 1 711                               | 618                              | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/12/2035 | 1 475                               | 1 135                            | 0,00                      | 1,616 % éch. 20/01/2035                           | 24                                  | 21                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/12/2035                                 | 374                                 | 135                              | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/01/2036 | 1 146                               | 1 075                            | 0,00                      | 3,082 % éch. 25/02/2035                           | 1 475                               | 1 230                            | 0,00                      | 7,000 % éch. 25/12/2035                                 | 1 296                               | 165                              | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/10/2036 | 607                                 | 202                              | 0,00                      | 3,437 % éch. 25/05/2036 (a)                       | 306                                 | 64                               | 0,00                      | 7,000 % éch. 25/01/2036                                 | 4 856                               | 746                              | 0,00                      |
| 4,383 % éch. 25/08/2035 | 1 045                               | 1 023                            | 0,00                      | 3,549 % éch. 25/04/2035                           | 1 451                               | 916                              | 0,00                      | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through |                                     |                                  |                           |
| 4,398 % éch. 20/11/2035 | 6 348                               | 5 710                            | 0,01                      | 3,585 % éch. 25/05/2047                           | 1 721                               | 1 525                            | 0,00                      | Certificates                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,403 % éch. 25/11/2035 | 624                                 | 582                              | 0,00                      | 3,998 % éch. 20/12/2035                           | 1 160                               | 1 094                            | 0,00                      | 5,534 % éch. 25/07/2035                                 | 1 248                               | 1 122                            | 0,00                      |
| 4,418 % éch. 20/11/2035 | 6 880                               | 6 558                            | 0,01                      | 4,031 % éch. 20/09/2036                           | 1 445                               | 1 298                            | 0,00                      | 6,553 % éch. 25/10/2033                                 | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 4,443 % éch. 25/09/2035 | 570                                 | 391                              | 0,00                      | 4,033 % éch. 25/04/2035                           | 166                                 | 159                              | 0,00                      | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates             |                                     |                                  |                           |
| 4,443 % éch. 25/10/2035 | 602                                 | 327                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/05/2036                           | 306                                 | 83                               | 0,00                      | 0,000 % éch. 25/02/2056                                 | 81 833                              | 73 967                           | 0,06                      |
| 4,463 % éch. 25/09/2035 | 2 546                               | 2 388                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/08/2035                           | 1 990                               | 1 436                            | 0,00                      | 2,526 % éch. 25/12/2048                                 | 10 077                              | 9 160                            | 0,01                      |
| 4,463 % éch. 25/02/2036 | 2 484                               | 1 518                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/09/2037                           | 3 732                               | 1 309                            | 0,00                      | 2,681 % éch. 25/07/2057                                 | 60 038                              | 53 921                           | 0,04                      |
| 4,463 % éch. 25/05/2036 | 3 978                               | 1 566                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/04/2046                           | 1 971                               | 1 783                            | 0,00                      | 2,836 % éch. 25/07/2057                                 | 4 015                               | 3 144                            | 0,00                      |
| 4,513 % éch. 25/01/2036 | 61                                  | 35                               | 0,00                      | 4,177 % éch. 20/02/2036                           | 1 760                               | 1 672                            | 0,00                      | 2,992 % éch. 25/07/2057                                 | 15 700                              | 13 487                           | 0,01                      |
| 4,563 % éch. 25/12/2035 | 218                                 | 185                              | 0,00                      | 4,190 % éch. 25/11/2037                           | 1 472                               | 1 352                            | 0,00                      | 3,034 % éch. 25/02/2056                                 | 51 278                              | 29 057                           | 0,02                      |
| 4,594 % éch. 25/11/2046 | 3 849                               | 3 536                            | 0,00                      | 4,230 % éch. 20/05/2036                           | 532                                 | 520                              | 0,00                      | 3,107 % éch. 25/07/2057                                 | 34 563                              | 19 304                           | 0,02                      |
| 4,603 % éch. 25/10/2035 | 140                                 | 114                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/03/2036                           | 2 457                               | 2 358                            | 0,00                      | 3,178 % éch. 25/07/2058                                 | 233 335                             | 183 005                          | 0,15                      |
| 4,630 % éch. 25/03/2047 | 490                                 | 475                              | 0,00                      | 4,256 % éch. 20/05/2036                           | 868                                 | 812                              | 0,00                      | 3,188 % éch. 25/07/2058                                 | 13 379                              | 10 577                           | 0,01                      |
| 4,663 % éch. 25/12/2036 | 773                                 | 234                              | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/04/2035                           | 772                                 | 747                              | 0,00                      | 3,431 % éch. 10/11/2032                                 | 5 500                               | 4 656                            | 0,01                      |
| 4,684 % éch. 25/06/2046 | 3 982                               | 3 827                            | 0,00                      | 4,343 % éch. 20/06/2036                           | 1 098                               | 1 039                            | 0,00                      | 3,509 % éch. 30/11/2037                                 | 2 545                               | 2 365                            | 0,00                      |
| 4,744 % éch. 25/12/2035 | 697                                 | 641                              | 0,00                      | 4,359 % éch. 25/11/2037                           | 989                                 | 947                              | 0,00                      | 3,683 % éch. 27/02/2046                                 | 2 701                               | 1 383                            | 0,00                      |
| 4,744 % éch. 25/02/2036 | 106                                 | 98                               | 0,00                      | 4,366 % éch. 19/01/2034                           | 7                                   | 7                                | 0,00                      | 4,000 % éch. 01/08/2057                                 | 4 352                               | 4 073                            | 0,00                      |
| 4,863 % éch. 25/02/2036 | 54                                  | 41                               | 0,00                      | 4,371 % éch. 25/04/2037                           | 1 025                               | 980                              | 0,00                      | 4,049 % éch. 27/10/2036                                 | 4 972                               | 3 970                            | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 25/08/2035 | 1 959                               | 1 270                            | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/03/2035                           | 859                                 | 798                              | 0,00                      | 4,109 % éch. 27/11/2036                                 | 4 496                               | 4 425                            | 0,01                      |
| 5,054 % éch. 20/07/2035 | 35                                  | 34                               | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/03/2035                           | 1 224                               | 1 168                            | 0,00                      | 4,142 % éch. 27/07/2037                                 | 567                                 | 524                              | 0,00                      |
| 5,094 % éch. 25/08/2035 | 264                                 | 229                              | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/02/2035                           | 1 511                               | 1 186                            | 0,00                      | 4,232 % éch. 25/06/2048                                 | 35 259                              | 30 029                           | 0,03                      |
| 5,124 % éch. 25/11/2047 | 3 078                               | 2 808                            | 0,00                      | 4,425 % éch. 20/02/2036                           | 451                                 | 417                              | 0,00                      | 4,258 % éch. 25/09/2057                                 | 23 977                              | 20 720                           | 0,02                      |
| 5,126 % éch. 25/09/2034 | 748                                 | 730                              | 0,00                      | 4,434 % éch. 20/04/2036                           | 785                                 | 743                              | 0,00                      | 4,282 % éch. 27/02/2036                                 | 1 103                               | 654                              | 0,00                      |
| 5,144 % éch. 25/08/2035 | 424                                 | 412                              | 0,00                      | 4,443 % éch. 25/03/2035                           | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 4,313 % éch. 26/08/2036                                 | 2 838                               | 2 634                            | 0,00                      |
| 5,223 % éch. 25/11/2035 | 5 468                               | 5 209                            | 0,01                      | 4,443 % éch. 25/04/2046                           | 6 828                               | 1 876                            | 0,00                      | 4,624 % éch. 25/04/2058                                 | 37 823                              | 35 450                           | 0,03                      |
| 5,250 % éch. 25/06/2035 | 1 435                               | 1 043                            | 0,00                      | 4,463 % éch. 25/02/2035                           | 1 962                               | 1 828                            | 0,00                      | 4,628 % éch. 27/01/2036                                 | 1 875                               | 1 826                            | 0,00                      |
| 5,250 % éch. 25/10/2035 | 173                                 | 115                              | 0,00                      | 4,483 % éch. 25/03/2035                           | 507                                 | 525                              | 0,00                      | 4,655 % éch. 27/07/2037                                 | 750                                 | 726                              | 0,00                      |
| 5,344 % éch. 25/08/2035 | 1 331                               | 1 156                            | 0,00                      | 4,503 % éch. 25/02/2035                           | 1 833                               | 1 708                            | 0,00                      | 4,694 % éch. 15/07/2032                                 | 11 948                              | 11 888                           | 0,01                      |
| 5,389 % éch. 25/06/2035 | 1 496                               | 1 351                            | 0,00                      | 4,523 % éch. 25/09/2034                           | 55                                  | 54                               | 0,00                      | 5,155 % éch. 26/06/2036                                 | 1 251                               | 1 052                            | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/04/2035 | 1 802                               | 1 507                            | 0,00                      | 4,586 % éch. 20/09/2035                           |                                     |                                  |                           |                                                         |                                     |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,755 % éch. 25/11/2036                   | \$ 607                              | \$ 403                           | 0,00                      | 4,053 % éch. 25/05/2037         | \$ 1 192                            | \$ 609                           | 0,00                      |
| 3,870 % éch. 25/08/2035                                        | \$ 473                              | \$ 393                           | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                   | 63                                  | 26                               | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/06/2035         | 1 406                               | 1 363                            | 0,00                      |
| 3,963 % éch. 25/11/2035                                        | 2                                   | 1                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                   | 647                                 | 224                              | 0,00                      | 4,182 % éch. 25/05/2037         | 1 838                               | 1 604                            | 0,00                      |
| 4,003 % éch. 25/08/2036                                        | 389                                 | 366                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2037                   | 720                                 | 243                              | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/08/2046         | 18 042                              | 3 370                            | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/08/2047                                        | 3 969                               | 3 775                            | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/11/2036                   | 2 052                               | 496                              | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/08/2046         | 15 076                              | 3 150                            | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/07/2047                                        | 7 447                               | 7 137                            | 0,01                      | First Horizon Asset Securities, Inc.      |                                     |                                  |                           | 4,479 % éch. 25/01/2036         | 550                                 | 513                              | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/03/2037                                        | 4 681                               | 4 532                            | 0,01                      | 4,673 % éch. 25/01/2036                   | 22                                  | 11                               | 0,00                      | 4,807 % éch. 25/07/2035         | 21                                  | 20                               | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/09/2047                                        | 6 024                               | 5 311                            | 0,01                      | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust |                                     |                                  |                           | 5,258 % éch. 25/05/2037         | 77                                  | 73                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/03/2037                                        | 11 614                              | 5 477                            | 0,01                      | 3,683 % éch. 25/11/2036                   | 255                                 |                                  | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/09/2034         | 345                                 | 345                              | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/01/2047                                        | 1 633                               | 1 575                            | 0,00                      | 3,875 % éch. 25/07/2037                   | 130                                 | 61                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/07/2035         | 309                                 | 297                              | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/10/2036                                        | 14 118                              | 3 571                            | 0,00                      | 5,701 % éch. 25/11/2037                   | 269                                 | 193                              | 0,00                      | 5,550 % éch. 25/05/2034         | 12                                  | 11                               | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/12/2036                                        | 4 078                               | 1 262                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                   | 165                                 | 58                               | 0,00                      | 5,727 % éch. 25/10/2035         | 36                                  | 34                               | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/02/2037                                        | 1 727                               | 1 553                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                   | 235                                 | 66                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/03/2036         | 190                                 | 171                              | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/08/2047                                        | 4 256                               | 4 018                            | 0,00                      | 6,060 % éch. 25/09/2035                   | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2035         | 2 360                               | 696                              | 0,00                      |
| 4,153 % éch. 25/11/2035                                        | 314                                 | 342                              | 0,00                      | 6,122 % éch. 25/08/2037                   | 206                                 | 41                               | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/02/2036         | 1 628                               | 615                              | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/08/2047                                        | 2 217                               | 2 066                            | 0,00                      | FirstMac Mortgage Funding Trust           |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2036         | 1 773                               | 976                              | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/01/2047                                        | 2 163                               | 1 993                            | 0,00                      | 5,380 % éch. 11/05/2058                   | AUD 57 900                          | 40 159                           | 0,03                      | 6,000 % éch. 25/07/2037         | 387                                 | 242                              | 0,00                      |
| 4,297 % éch. 25/02/2036                                        | 326                                 | 186                              | 0,00                      | 5,388 % éch. 18/02/2056                   | 30 974                              | 21 494                           | 0,02                      | 6,250 % éch. 25/08/2036         | 2 040                               | 489                              | 0,00                      |
| 4,310 % éch. 25/10/2035                                        | 1 397                               | 1 126                            | 0,00                      | Fondo de Titulizacion de Activos UCI      |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/05/2036         | 780                                 | 302                              | 0,00                      |
| 4,323 % éch. 25/08/2036                                        | 2 617                               | 2 437                            | 0,00                      | 2,530 % éch. 16/06/2049                   | € 4 789                             | 5 418                            | 0,01                      | HarborView Mortgage Loan Trust  |                                     |                                  |                           |
| 4,403 % éch. 25/08/2047                                        | 5 681                               | 4 402                            | 0,01                      | Frontier Mortgage Funding PLC             |                                     |                                  |                           | 3,934 % éch. 19/11/2036         | 12 404                              | 11 166                           | 0,01                      |
| 4,423 % éch. 25/08/2037                                        | 9 621                               | 8 092                            | 0,01                      | 0,000 % éch. 20/12/2066 (f)               | £ 18 964                            | 32 596                           | 0,03                      | 3,934 % éch. 19/11/2046         | 640                                 | 505                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/12/2035                                        | 440                                 | 364                              | 0,00                      | 4,532 % éch. 20/12/2066                   | 80 400                              | 106 800                          | 0,09                      | 4,014 % éch. 19/03/2037         | 4 774                               | 4 478                            | 0,01                      |
| Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,732 % éch. 20/12/2066                   | 9 400                               | 12 475                           | 0,01                      | 4,054 % éch. 25/01/2047         | 9 254                               | 8 878                            | 0,01                      |
| 6,005 % éch. 25/10/2036                                        | 989                                 | 864                              | 0,00                      | 5,082 % éch. 20/12/2066                   | 4 200                               | 5 582                            | 0,01                      | 4,094 % éch. 19/12/2036         | 414                                 | 384                              | 0,00                      |
| 6,160 % éch. 25/06/2036                                        | 181                                 | 166                              | 0,00                      | 5,482 % éch. 20/12/2066                   | 5 273                               | 7 004                            | 0,01                      | 4,134 % éch. 19/09/2037         | 6 412                               | 5 683                            | 0,01                      |
| 6,270 % éch. 25/06/2036                                        | 1 364                               | 1 247                            | 0,00                      | 6,232 % éch. 20/12/2066                   | 18 549                              | 24 602                           | 0,02                      | 4,134 % éch. 19/01/2038         | 6 369                               | 5 763                            | 0,01                      |
| 6,445 % éch. 25/02/2036                                        | 2 588                               | 2 373                            | 0,00                      | 6,732 % éch. 20/12/2066                   | 9 047                               | 11 826                           | 0,01                      | 4,164 % éch. 19/12/2036         | 21 215                              | 19 228                           | 0,02                      |
| Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.                      |                                     |                                  |                           | GC Pastor Hipotecario FTA                 |                                     |                                  |                           | 4,174 % éch. 19/11/2036         | 5 073                               | 4 849                            | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 27/07/2037                                        | 390                                 | 320                              | 0,00                      | 2,556 % éch. 21/06/2046                   | € 680                               | 726                              | 0,00                      | 4,194 % éch. 19/05/2035         | 2 353                               | 2 291                            | 0,00                      |
| Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates |                                     |                                  |                           | Glen Securities Finance DAC               |                                     |                                  |                           | 4,254 % éch. 19/01/2036         | 2 801                               | 1 780                            | 0,00                      |
| 4,101 % éch. 27/06/2037                                        | 387                                 | 345                              | 0,00                      | 4,250 % éch. 28/10/2038                   | 2 308                               | 2 666                            | 0,00                      | 4,294 % éch. 19/03/2035         | 472                                 | 461                              | 0,00                      |
| Dilosk RMBS DAC                                                |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 28/10/2038                   | 1 744                               | 1 993                            | 0,00                      | 4,314 % éch. 20/10/2045         | 2 163                               | 1 529                            | 0,00                      |
| 2,733 % éch. 25/10/2064                                        | € 18 400                            | 21 012                           | 0,02                      | 6,050 % éch. 28/10/2038                   | 833                                 | 941                              | 0,00                      | 4,330 % éch. 19/07/2035         | 14                                  | 11                               | 0,00                      |
| 2,845 % éch. 25/01/2063                                        | 12 126                              | 13 863                           | 0,01                      | GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.      |                                     |                                  |                           | 4,354 % éch. 19/04/2034         | 41                                  | 39                               | 0,00                      |
| 3,080 % éch. 24/09/2060                                        | 22 455                              | 25 691                           | 0,02                      | 5,456 % éch. 10/03/2051                   | \$ 17 286                           | 15 178                           | 0,01                      | 4,374 % éch. 19/09/2035         | 7 902                               | 3 485                            | 0,00                      |
| 3,108 % éch. 20/07/2061                                        | 773                                 | 885                              | 0,00                      | 5,550 % éch. 10/08/2038                   | 10 241                              | 9 944                            | 0,01                      | 4,374 % éch. 19/11/2035         | 120                                 | 77                               | 0,00                      |
| 3,204 % éch. 20/10/2062                                        | 10 216                              | 11 707                           | 0,01                      | GMAC Mortgage Corp. Loan Trust            |                                     |                                  |                           | 4,394 % éch. 19/08/2045         | 1 300                               | 994                              | 0,00                      |
| Domi BV                                                        |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 19/07/2035                   | 5                                   | 3                                | 0,00                      | 4,419 % éch. 19/06/2036         | 2 039                               | 906                              | 0,00                      |
| 2,914 % éch. 16/04/2057                                        | 22 829                              | 26 131                           | 0,02                      | 3,704 % éch. 19/04/2036                   | 239                                 | 198                              | 0,00                      | 4,434 % éch. 19/01/2035         | 125                                 | 121                              | 0,00                      |
| 3,081 % éch. 15/06/2056                                        | 19 485                              | 22 279                           | 0,02                      | 3,841 % éch. 18/03/2035                   | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 4,594 % éch. 19/12/2036         | 1 426                               | 1 341                            | 0,00                      |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust          |                                     |                                  |                           | 3,847 % éch. 19/11/2035                   | 53                                  | 21                               | 0,00                      | 4,732 % éch. 19/07/2045         | 15                                  | 13                               | 0,00                      |
| 3,944 % éch. 19/10/2036                                        | \$ 4 856                            | 4 534                            | 0,01                      | Great Hall Mortgages PLC                  |                                     |                                  |                           | 5,104 % éch. 20/06/2035         | 609                                 | 558                              | 0,00                      |
| 3,954 % éch. 19/10/2036                                        | 3 283                               | 2 237                            | 0,00                      | 2,628 % éch. 18/03/2039                   | € 723                               | 822                              | 0,00                      | 5,244 % éch. 19/09/2035         | 60                                  | 45                               | 0,00                      |
| 4,334 % éch. 19/10/2045                                        | 2 462                               | 2 257                            | 0,00                      | 2,938 % éch. 18/06/2039                   | 1 960                               | 2 165                            | 0,00                      | 5,294 % éch. 19/02/2036         | 1 630                               | 673                              | 0,00                      |
| 4,494 % éch. 19/10/2045                                        | 2 246                               | 2 184                            | 0,00                      | 3,608 % éch. 18/06/2039                   | 8 800                               | 9 707                            | 0,01                      | 5,744 % éch. 19/10/2035         | 5 019                               | 2 456                            | 0,00                      |
| 4,574 % éch. 19/09/2044                                        | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 4,166 % éch. 18/06/2039                   | £ 1 460                             | 1 918                            | 0,00                      | 5,744 % éch. 19/01/2036         | 857                                 | 314                              | 0,00                      |
| Dutch Property Finance BV                                      |                                     |                                  |                           | 4,326 % éch. 18/06/2038                   | 4 200                               | 5 463                            | 0,01                      | 5,763 % éch. 25/10/2037         | 8 454                               | 8 046                            | 0,01                      |
| 3,063 % éch. 28/04/2062                                        | € 9 504                             | 10 888                           | 0,01                      | 4,646 % éch. 18/03/2039                   | 1 710                               | 2 178                            | 0,00                      | 5,826 % éch. 19/11/2034         | 174                                 | 170                              | 0,00                      |
| 3,063 % éch. 28/04/2064                                        | 28 949                              | 33 189                           | 0,03                      | 5,116 % éch. 18/06/2039                   | 2 000                               | 2 548                            | 0,00                      | 6,474 % éch. 25/02/2036         | 147                                 | 38                               | 0,00                      |
| Edenbrook Mortgage Funding PLC                                 |                                     |                                  |                           | GreenPoint Mortgage Funding Trust         |                                     |                                  |                           | Harbour PLC                     |                                     |                                  |                           |
| 4,616 % éch. 22/03/2057                                        | £ 40 014                            | 53 167                           | 0,04                      | 4,163 % éch. 25/10/2046                   | \$ 5 185                            | 5 032                            | 0,01                      | 4,797 % éch. 28/10/2054         | £ 17 754                            | 23 638                           | 0,02                      |
| Elstree PLC                                                    |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/04/2036                   | 235                                 | 198                              | 0,00                      | Harmony French Home Loans       |                                     |                                  |                           |
| 4,454 % éch. 21/01/2065                                        | 23 460                              | 31 117                           | 0,03                      | 4,203 % éch. 25/06/2045                   | 1 276                               | 1 099                            | 0,00                      | 2,774 % éch. 27/05/2064         | € 37 187                            | 42 549                           | 0,04                      |
| EMF-UK PLC                                                     |                                     |                                  |                           | 4,283 % éch. 25/10/2045                   | 1 289                               | 1 248                            | 0,00                      | Harvest Funding PLC             |                                     |                                  |                           |
| 4,846 % éch. 13/03/2046                                        | 3 338                               | 4 440                            | 0,01                      | 4,343 % éch. 25/02/2036                   | 1 067                               | 985                              | 0,00                      | 4,643 % éch. 15/11/2069         | £ 113 900                           | 151 197                          | 0,12                      |
| Eurohome UK Mortgages PLC                                      |                                     |                                  |                           | 4,383 % éch. 25/10/2045                   | 1 193                               | 1 114                            | 0,00                      | 5,043 % éch. 15/11/2069         | 14 600                              | 19 316                           | 0,02                      |
| 4,016 % éch. 15/06/2044                                        | 99                                  | 131                              | 0,00                      | Grifonas Finance PLC                      |                                     |                                  |                           | 5,443 % éch. 15/11/2069         | 15 000                              | 19 907                           | 0,02                      |
| 4,166 % éch. 15/06/2044                                        | 3 775                               | 4 983                            | 0,01                      | 2,419 % éch. 28/08/2039                   | € 8 042                             | 9 074                            | 0,01                      | Hawksmoor Mortgage Funding PLC  |                                     |                                  |                           |
| 4,466 % éch. 15/09/2044                                        | 7 250                               | 9 475                            | 0,01                      | GS Mortgage Securities Corp. Trust        |                                     |                                  |                           | 4,587 % éch. 25/02/2057         | 70 000                              | 93 020                           | 0,08                      |
| Eurosail PLC                                                   |                                     |                                  |                           | 3,659 % éch. 10/01/2043                   | \$ 1 900                            | 1 778                            | 0,00                      | Hilton USA Trust                |                                     |                                  |                           |
| 2,641 % éch. 13/03/2045                                        | € 3 056                             | 3 469                            | 0,00                      | 3,721 % éch. 10/02/2037                   | 18 435                              | 18 074                           | 0,02                      | 2,828 % éch. 05/11/2035         | \$ 15 286                           | 12 744                           | 0,01                      |
| 2,801 % éch. 10/09/2044                                        | 2 049                               | 2 338                            | 0,00                      | 3,879 % éch. 26/09/2036                   | 3 453                               | 2 075                            | 0,00                      | HomeBanc Mortgage Trust         |                                     |                                  |                           |
| 2,851 % éch. 13/03/2045                                        | 4 000                               | 4 282                            | 0,01                      | 4,872 % éch. 15/07/2035                   | 27 852                              | 18 243                           | 0,02                      | 4,272 % éch. 25/04/2047         | 721                                 | 613                              | 0,00                      |
| 4,316 % éch. 10/09/2044                                        | £ 768                               | 1 018                            | 0,00                      | 5,102 % éch. 26/04/2037                   | 4 681                               | 1 089                            | 0,00                      | 4,274 % éch. 25/04/2037         | 274                                 | 271                              | 0,00                      |
| 4,346 % éch. 10/06/2044                                        | 674                                 | 893                              | 0,00                      | 6,922 % éch. 15/11/2032                   | 19 350                              | 19 159                           | 0,02                      | 4,283 % éch. 25/01/2036         | 214                                 | 211                              | 0,00                      |
| 4,636 % éch. 13/09/2045                                        | 6 873                               | 8 928                            | 0,01                      | GS Mortgage-Backed Securities Trust       |                                     |                                  |                           | 4,498 % éch. 25/01/2036         | 5 636                               | 5 311                            | 0,01                      |
| 4,816 % éch. 13/06/2045                                        | 2 585                               | 3 427                            | 0,00                      | 3,133 % éch. 24/11/2067                   | € 33 400                            | 38 287                           | 0,03                      | 4,503 % éch. 25/12/2034         | 34                                  | 33                               | 0,00                      |
| 4,866 % éch. 13/06/2045                                        | 3 172                               | 4 090                            | 0,00                      | GSC Capital Corp. Mortgage Trust          |                                     |                                  |                           | Hops Hill PLC                   |                                     |                                  |                           |
| Finsbury Square PLC                                            |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/02/2036                   | \$ 1 182                            | 1 136                            | 0,00                      | 4,614 % éch. 21/04/2056         | £ 26 389                            | 35 051                           | 0,03                      |
| 4,546 % éch. 16/12/2071                                        | 536                                 | 712                              | 0,00                      | GSMPs Mortgage Loan Trust                 |                                     |                                  |                           | Household Capital RMBS          |                                     |                                  |                           |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust            |                                     |                                  |                           | 4,113 % éch. 25/03/2035                   | 4 498                               | 4 248                            | 0,01                      | 6,231 % éch. 21/07/2087         | AUD 21 516                          | 14 868                           | 0,01                      |
| 3,994 % éch. 25/09/2035                                        | \$ 128                              | 123                              | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/09/2035                   | 5 360                               | 4 659                            | 0,01                      | 6,581 % éch. 20/07/2086         | 17 126                              | 11 930                           | 0,01                      |
| 4,215 % éch. 25/11/2035                                        | 1 109                               | 562                              | 0,00                      | 4,134 % éch. 25/06/2034                   | 2 810                               | 2 680                            | 0,00                      | 7,581 % éch. 20/07/2086         | 3 800                               | 2 647                            | 0,00                      |
| 4,264 % éch. 25/02/2036                                        | 83                                  | 59                               | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/06/2034                   | 951                                 | 871                              | 0,00                      | HSI Asset Loan Obligation Trust |                                     |                                  |                           |
| 4,336 % éch. 25/03/2035                                        | 406                                 | 223                              | 0,00                      | 7,052 % éch. 20/10/2032                   | 830                                 | 781                              | 0,00                      | 2,867 % éch. 25/12/2036 (a)     | \$ 1 481                            | 125                              | 0,00                      |
| 4,424 % éch. 25/01/2037                                        | 615                                 | 471                              | 0,00                      | GSR Mortgage Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | 4,133 % éch. 25/12/2036         | 1 900                               | 334                              | 0,00                      |
| 4,593 % éch. 25/02/2037                                        | 363                                 | 243                              | 0,00                      | 3,824 % éch. 25/03/2047                   | 4 714                               | 2 381                            | 0,00                      | Impac CMB Trust                 |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,993 % éch. 25/05/2037                   | 10 910                              | 4 976                            | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/05/2035         | 102                                 | 100                              | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,025 % éch. 25/04/2036                   | 2 673                               | 1 626                            | 0,00                      | 4,393 % éch. 25/02/2036         | 1 084                               | 915                              | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/03/2035         | 1 713                               | 1 692                            | 0,00                      |

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 6,060 % éch. 25/10/2034                | \$ 253                              | \$ 332                           | 0,00                      | Jeronimo Funding DAC                                | € 21 065                            | \$ 24 201                        | 0,02                      | La Trobe Financial Capital Markets Trust | AUD 13 364                          | \$ 9 255                         | 0,01                      |
| Impac Secured Assets CMN Owner Trust   |                                     |                                  |                           | 3,415 % éch. 25/10/2064                             |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/08/2057                  |                                     | 2 632                            | 0,00                      |
| 5,450 % éch. 25/03/2033                | 94                                  | 93                               | 0,00                      | JPMorgan Alternative Loan Trust                     | \$ 2 725                            | 2 449                            | 0,00                      | 5,050 % éch. 15/05/2057                  |                                     | 51 400                           | 0,03                      |
| Impac Secured Assets Corp.             |                                     |                                  |                           | 3,972 % éch. 25/10/2036                             | 1 924                               | 1 800                            | 0,00                      | 5,167 % éch. 13/11/2057                  |                                     | 31 400                           | 0,02                      |
| 4,403 % éch. 25/03/2036                | 829                                 | 741                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/07/2036                             | 1 891                               | 1 602                            | 0,00                      | 5,507 % éch. 13/11/2057                  |                                     |                                  |                           |
| Impac Secured Assets Trust             |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/05/2036                             | 1 790                               | 712                              | 0,00                      | Landmark Mortgage Securities PLC         | £ 4 512                             | 5 931                            | 0,01                      |
| 3,983 % éch. 25/05/2037                | 399                                 | 340                              | 0,00                      | 4,162 % éch. 25/03/2037                             | 13 639                              | 4 642                            | 0,01                      | 4,066 % éch. 17/06/2039                  |                                     | 6 691                            | 0,01                      |
| 4,243 % éch. 25/03/2037                | 3 192                               | 2 864                            | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/06/2037                             | 2 136                               | 2 074                            | 0,00                      | 4,666 % éch. 17/04/2044                  |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/09/2037                | 2 119                               | 1 877                            | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/04/2047                             | 272                                 | 166                              | 0,00                      | Lanebrook Mortgage Transaction PLC       |                                     | 38 790                           | 0,04                      |
| 4,283 % éch. 25/01/2037                | 6 145                               | 5 445                            | 0,01                      | 4,420 % éch. 25/01/2036                             | 501                                 | 373                              | 0,00                      | 4,546 % éch. 15/03/2061                  |                                     | 51 524                           |                           |
| 4,303 % éch. 25/11/2036                | 4 853                               | 4 230                            | 0,01                      | 4,594 % éch. 25/03/2036                             | 1 974                               | 1 533                            | 0,00                      | Lansdowne Mortgage Securities PLC        | € 886                               | 997                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/02/2037                | 3 716                               | 3 419                            | 0,00                      | 4,584 % éch. 26/05/2037                             | 1 022                               | 464                              | 0,00                      | 2,701 % éch. 15/06/2045                  |                                     |                                  |                           |
| 4,463 % éch. 25/05/2036                | 315                                 | 301                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 27/12/2036                             | 5 723                               | 5 130                            | 0,01                      | Legacy Mortgage Asset Trust              |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/09/2037                | 1 807                               | 1 607                            | 0,00                      | 6,180 % éch. 25/03/2036                             | 53                                  | 62                               | 0,00                      | 0,000 % éch. 25/12/2056 (a)              | \$ 100 463                          | 648                              | 0,00                      |
| IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust |                                     |                                  |                           | 6,210 % éch. 25/12/2036                             | 306                                 | 326                              | 0,00                      | 0,125 % éch. 26/12/2057 (a)              |                                     | 55 310                           | 0,00                      |
| 5,789 % éch. 25/01/2032                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 6,460 % éch. 25/12/2036                             | 32                                  | 35                               | 0,00                      | 1,405 % éch. 26/12/2057 (a)              |                                     | 6 172                            | 0,00                      |
| IndyMac Mortgage Loan Trust            |                                     |                                  |                           | 6,550 % éch. 25/05/2036                             | 50                                  | 56                               | 0,00                      | 3,102 % éch. 25/12/2056                  |                                     | 99 932                           | 0,06                      |
| 3,077 % éch. 25/06/2037                | 2 711                               | 2 223                            | 0,00                      | 6,620 % éch. 25/08/2036                             | 3 399                               | 2 833                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/02/2058                  |                                     | 2 367                            | 0,00                      |
| 3,156 % éch. 25/07/2037                | 5 264                               | 4 693                            | 0,01                      | 6,920 % éch. 25/08/2036                             |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 26/08/2058                  |                                     | 30 073                           | 0,03                      |
| 3,211 % éch. 25/06/2037                | 1 415                               | 1 293                            | 0,00                      | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/01/2058                  |                                     | 16 587                           | 0,01                      |
| 3,268 % éch. 25/04/2037                | 3 250                               | 2 999                            | 0,00                      | 4,128 % éch. 05/07/2031                             | 33 610                              | 28 341                           | 0,02                      | 4,334 % éch. 25/02/2058                  |                                     | 1 575                            | 0,00                      |
| 3,270 % éch. 25/05/2037                | 1 197                               | 1 020                            | 0,00                      | 4,248 % éch. 05/07/2033                             | 10 000                              | 9 464                            | 0,01                      | 4,358 % éch. 26/08/2058                  |                                     | 17 864                           | 0,01                      |
| 3,301 % éch. 25/06/2036                | 4 826                               | 2 877                            | 0,00                      | 4,549 % éch. 05/07/2033                             | 3 839                               | 3 164                            | 0,00                      | 4,500 % éch. 25/02/2058                  |                                     | 1 575                            | 0,00                      |
| 3,359 % éch. 25/08/2037                | 3 910                               | 2 779                            | 0,00                      | 4,723 % éch. 15/02/2035                             | 29 250                              | 28 895                           | 0,02                      | 4,655 % éch. 26/12/2057                  |                                     | 48 379                           | 0,03                      |
| 3,463 % éch. 25/08/2036                | 135                                 | 104                              | 0,00                      | 4,802 % éch. 05/07/2033                             | 5 665                               | 5 486                            | 0,01                      | Lehman Mortgage Trust                    |                                     |                                  |                           |
| 3,465 % éch. 25/08/2037                | 2 509                               | 1 607                            | 0,00                      | 4,882 % éch. 15/06/2035                             | 2 180                               | 1 450                            | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/07/2037                  |                                     | 16                               | 0,00                      |
| 3,525 % éch. 25/04/2037                | 5 159                               | 4 653                            | 0,01                      | 4,950 % éch. 05/07/2033                             | 38 900                              | 24 701                           | 0,02                      | 4,663 % éch. 25/12/2035                  |                                     | 527                              | 0,00                      |
| 3,609 % éch. 25/08/2035                | 50                                  | 36                               | 0,00                      | 5,089 % éch. 15/12/2036                             | 17 100                              | 7 866                            | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/01/2037                  |                                     | 282                              | 0,00                      |
| 3,618 % éch. 25/03/2036                | 2 702                               | 1 821                            | 0,00                      | 5,223 % éch. 15/02/2035                             | 2 057                               | 1 987                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/01/2036                  |                                     | 2 406                            | 0,00                      |
| 3,653 % éch. 25/06/2037                | 5 548                               | 3 245                            | 0,00                      | 5,350 % éch. 05/07/2033                             | 9 940                               | 4 622                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                  |                                     | 659                              | 0,00                      |
| 3,751 % éch. 25/05/2037                | 1 631                               | 1 077                            | 0,00                      | 5,502 % éch. 05/07/2033                             | 10 109                              | 7 026                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/12/2036                  |                                     | 934                              | 0,00                      |
| 3,806 % éch. 25/01/2037                | 116                                 | 104                              | 0,00                      | JPMorgan Mortgage Trust                             |                                     |                                  |                           | Lehman XS Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 3,837 % éch. 25/05/2036                | 106                                 | 102                              | 0,00                      | 3,927 % éch. 27/07/2037                             | 298                                 | 279                              | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/08/2036                  |                                     | 30                               | 0,00                      |
| 3,880 % éch. 25/03/2037                | 281                                 | 206                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/10/2036                             | 143                                 | 78                               | 0,00                      | 4,033 % éch. 25/02/2036                  |                                     | 241                              | 0,00                      |
| 3,888 % éch. 25/07/2036                | 2 703                               | 1 741                            | 0,00                      | 4,316 % éch. 25/05/2036                             | 1 034                               | 849                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/12/2036                  |                                     | 2 958                            | 0,00                      |
| 3,923 % éch. 25/09/2036                | 92                                  | 83                               | 0,00                      | 4,384 % éch. 25/01/2037                             | 996                                 | 829                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/09/2046                  |                                     | 97                               | 0,00                      |
| 3,991 % éch. 25/05/2035                | 43                                  | 29                               | 0,00                      | 4,407 % éch. 25/05/2037                             | 242                                 | 202                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/08/2046                  |                                     | 2 683                            | 0,00                      |
| 4,003 % éch. 25/07/2036                | 3 563                               | 3 607                            | 0,00                      | 4,498 % éch. 25/05/2037                             | 956                                 | 823                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/09/2046                  |                                     | 1 889                            | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/10/2036                | 1 969                               | 1 803                            | 0,00                      | 4,545 % éch. 25/04/2037                             | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/11/2046                  |                                     | 532                              | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/04/2037                | 662                                 | 602                              | 0,00                      | 4,695 % éch. 25/05/2036                             | 1 985                               | 1 674                            | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/03/2047                  |                                     | 9 177                            | 0,01                      |
| 4,103 % éch. 25/01/2037                | 6 085                               | 5 679                            | 0,01                      | 4,701 % éch. 25/11/2035                             | 1 228                               | 951                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/06/2047                  |                                     | 4 259                            | 0,00                      |
| 4,113 % éch. 25/06/2036                | 2 345                               | 1 970                            | 0,00                      | 4,782 % éch. 25/05/2036                             | 31                                  | 26                               | 0,00                      | 4,173 % éch. 25/08/2046                  |                                     | 6 447                            | 0,01                      |
| 4,123 % éch. 25/08/2036                | 7 090                               | 4 464                            | 0,01                      | 4,901 % éch. 25/04/2036                             | 1 969                               | 1 694                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/11/2046                  |                                     | 11 404                           | 0,01                      |
| 4,123 % éch. 25/02/2037                | 4 891                               | 4 573                            | 0,01                      | 4,930 % éch. 25/08/2036                             | 2 384                               | 1 895                            | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/06/2047                  |                                     | 3 807                            | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/07/2047                | 2 786                               | 1 843                            | 0,00                      | 4,970 % éch. 25/08/2035                             | 133                                 | 123                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/08/2037                  |                                     | 1 911                            | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/10/2036                | 4 493                               | 1 783                            | 0,00                      | 5,054 % éch. 25/10/2037                             | 1 592                               | 1 212                            | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/02/2046                  |                                     | 6 751                            | 0,01                      |
| 4,143 % éch. 25/04/2037                | 1 114                               | 1 013                            | 0,00                      | 5,175 % éch. 25/11/2035                             | 2 437                               | 1 961                            | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/08/2047                  |                                     | 7 438                            | 0,01                      |
| 4,144 % éch. 25/09/2036                | 56                                  | 53                               | 0,00                      | 5,186 % éch. 25/07/2035                             | 94                                  | 93                               | 0,00                      | 5,244 % éch. 25/03/2047                  |                                     | 2 087                            | 0,00                      |
| 4,161 % éch. 25/12/2035                | 2 799                               | 1 872                            | 0,00                      | 5,420 % éch. 25/09/2035                             | 166                                 | 165                              | 0,00                      | 5,463 % éch. 25/09/2047                  |                                     | 1 092                            | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/06/2046                | 4 365                               | 4 037                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/07/2036                             | 2 443                               | 927                              | 0,00                      | Liberty Trust                            |                                     |                                  |                           |
| 4,163 % éch. 25/11/2046                | 5 009                               | 4 933                            | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/01/2036                             | 971                                 | 421                              | 0,00                      | 5,012 % éch. 10/10/2058                  | AUD 15 862                          | 10 986                           | 0,01                      |
| 4,183 % éch. 25/11/2035                | 27                                  | 19                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/03/2037                             | 3 736                               | 1 283                            | 0,00                      | 5,305 % éch. 25/04/2058                  |                                     | 16 530                           | 0,01                      |
| 4,183 % éch. 25/11/2036                | 234                                 | 228                              | 0,00                      | 5,754 % éch. 25/04/2035                             | 188                                 | 179                              | 0,00                      | 5,312 % éch. 10/10/2058                  |                                     | 37 800                           | 0,02                      |
| 4,183 % éch. 25/02/2046                | 4 160                               | 3 246                            | 0,00                      | 5,832 % éch. 25/06/2034                             | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 5,555 % éch. 25/08/2056                  |                                     | 17 213                           | 0,01                      |
| 4,183 % éch. 25/04/2046                | 2 187                               | 2 014                            | 0,00                      | 5,923 % éch. 25/08/2035                             | 4                                   | 4                                | 0,00                      | London Wall Mortgage Capital PLC         |                                     |                                  |                           |
| 4,183 % éch. 25/05/2046                | 5 432                               | 5 059                            | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                             | 16 211                              | 6 769                            | 0,01                      | 4,738 % éch. 15/05/2057                  | £ 11 463                            | 15 248                           | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/04/2046                | 2 058                               | 1 895                            | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/08/2037                             | 5 052                               | 1 300                            | 0,00                      | Ludgate Funding PLC                      |                                     |                                  |                           |
| 4,223 % éch. 25/04/2035                | 146                                 | 140                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/01/2035                             | 1 016                               | 1 053                            | 0,00                      | 2,282 % éch. 01/01/2061                  | € 1 778                             | 2 004                            | 0,00                      |
| 4,236 % éch. 25/09/2036                | 1 173                               | 717                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/07/2036                             | 216                                 | 67                               | 0,00                      | 2,362 % éch. 01/01/2061                  |                                     | 572                              | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/11/2036                | 2 737                               | 2 842                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/08/2036                             | 4 320                               | 1 366                            | 0,00                      | 2,432 % éch. 01/01/2061                  |                                     | 1 907                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/09/2037                | 3 082                               | 2 901                            | 0,00                      | 6,540 % éch. 25/08/2036                             | 71                                  | 57                               | 0,00                      | 2,558 % éch. 01/12/2060                  |                                     | 1 658                            | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/07/2035                | 3 950                               | 2 620                            | 0,00                      | JPMorgan Resecuritization Trust                     |                                     |                                  |                           | 2,822 % éch. 01/01/2061                  |                                     | 7 540                            | 0,01                      |
| 4,288 % éch. 25/11/2035                | 1 799                               | 1 367                            | 0,00                      | 4,500 % éch. 26/04/2037                             | 693                                 | 284                              | 0,00                      | 4,056 % éch. 01/12/2060                  | £ 489                               | 639                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/10/2036                | 1 830                               | 728                              | 0,00                      | 5,250 % éch. 26/09/2036                             | 260                                 | 252                              | 0,00                      | 4,106 % éch. 01/01/2061                  |                                     | 4 196                            | 0,01                      |
| 4,337 % éch. 25/09/2035                | 39                                  | 35                               | 0,00                      | 5,750 % éch. 26/05/2037                             | 112                                 | 32                               | 0,00                      | 4,166 % éch. 01/12/2060                  |                                     | 2 163                            | 0,00                      |
| 4,343 % éch. 25/01/2036                | 2 687                               | 1 800                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 26/09/2036                             | 397                                 | 312                              | 0,00                      | Lugo Funding DAC                         |                                     |                                  |                           |
| 4,352 % éch. 25/09/2035                | 238                                 | 156                              | 0,00                      | 6,305 % éch. 26/09/2037                             | 506                                 | 384                              | 0,00                      | 3,195 % éch. 26/05/2066                  | € 46 813                            | 53 451                           | 0,04                      |
| 4,355 % éch. 25/12/2034                | 4                                   | 4                                | 0,00                      | Jubilee Place BV                                    |                                     |                                  |                           | Luminent Mortgage Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/07/2035                | 857                                 | 684                              | 0,00                      | 3,090 % éch. 17/01/2059                             | € 13 324                            | 15 254                           | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/01/2037                  | \$ 1 705                            | 1 454                            | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/11/2035                | 39                                  | 22                               | 0,00                      | 3,127 % éch. 18/09/2062                             | 18 867                              | 21 595                           | 0,02                      | 4,103 % éch. 25/12/2036                  |                                     | 2 203                            | 0,00                      |
| 4,529 % éch. 25/09/2037                | 10 176                              | 7 041                            | 0,01                      | 3,207 % éch. 17/09/2060                             | 14 991                              | 17 180                           | 0,02                      | 4,123 % éch. 25/12/2036                  |                                     | 49                               | 0,00                      |
| 4,543 % éch. 25/12/2034                | 522                                 | 395                              | 0,00                      | Jupiter Mortgage PLC                                | £ 2 088                             | 2 774                            | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/05/2046                  |                                     | 616                              | 0,00                      |
| 4,563 % éch. 25/07/2046                | 3 761                               | 3 435                            | 0,00                      | 4,747 % éch. 20/07/2055                             |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/02/2046                  |                                     | 1 544                            | 0,00                      |
| 4,583 % éch. 25/11/2034                | 802                                 | 735                              | 0,00                      | Kinbane DAC                                         |                                     |                                  |                           | Lura Funding DAC                         |                                     |                                  |                           |
| 4,623 % éch. 25/09/2034                | 35                                  | 30                               | 0,00                      | 3,378 % éch. 24/08/2075                             | € 32 181                            | 36 857                           | 0,03                      | 0,000 % éch. 27/08/2079 (f)              | € 4 299                             | 1 483                            | 0,00                      |
| 4,855 % éch. 25/08/2034                | 56                                  | 54                               | 0,00                      | 3,379 % éch. 24/01/2063                             | 26 505                              | 30 358                           | 0,03                      | 3,204 % éch. 27/08/2079                  |                                     | 22 910                           | 0,02                      |
| 5,323 % éch. 25/10/2036                | 5 076                               | 2 446                            | 0,00                      | Kirkby RMBS PLC                                     |                                     |                                  |                           | 3,504 % éch. 27/08/2079                  |                                     | 1 870                            | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                | 659                                 | 427                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 22/02/2045                             | £ 1                                 | 1 580                            | 0,00                      | 3,954 % éch. 27/08/2079                  |                                     | 1 020                            | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2037                | 944                                 | 328                              | 0,00                      | 2,250 % éch. 22/02/2045                             | 4 258                               | 3 685                            | 0,00                      | 4,204 % éch. 27/08/2079                  |                                     | 850                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/07/2037                | 373                                 | 108                              | 0,00                      | 4,668 % éch. 22/02/2045                             | 10 897                              | 14 440                           | 0,01                      | 5,204 % éch. 27/08/2079                  |                                     | 595                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/09/2037                | 1 781                               | 899                              | 0,00                      | 5,868 % éch. 22/02/2045                             | 13 150                              | 17 128                           | 0,02                      | 5,954 % éch. 27/08/2079                  |                                     | 1 275                            | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/10/2037                | 2 544                               | 1 054                            | 0,00                      |                                                     |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>Mansard Mortgages PLC</b>                                        |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/02/2036                                     | \$ 235                              | \$ 221                           | 0,00                      | 4,535 % éch. 16/01/2060                       | £ 33 539                            | \$ 44 532                        | 0,04                      |
| 4,046 % éch. 15/04/2047                                             | 646                                 | 854                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/12/2035                                     | 1 882                               | 661                              | 0,00                      | 4,835 % éch. 16/01/2060                       | 5 628                               | 7 494                            | 0,01                      |
| 5,116 % éch. 15/12/2049                                             | 1 818                               | 2 384                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/08/2036                                     | 5 364                               | 2 497                            | 0,00                      | 5,135 % éch. 16/01/2060                       | 3 752                               | 4 985                            | 0,01                      |
| 5,866 % éch. 15/12/2049                                             | 1 616                               | 2 164                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/10/2037                                     | 10 419                              | 4 637                            | 0,01                      | 5,635 % éch. 16/01/2060                       | 3 126                               | 4 172                            | 0,00                      |
| <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>                        |                                     |                                  |                           | 6,354 % éch. 25/08/2036                                     | 1 214                               | 196                              | 0,00                      | 7,235 % éch. 16/01/2060                       | 1 250                               | 1 666                            | 0,00                      |
| 3,184 % éch. 25/02/2035                                             | \$ 144                              | 126                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/02/2036                                     | 99                                  | 38                               | 0,00                      | 7,735 % éch. 16/01/2060                       | 192                                 | 255                              | 0,00                      |
| 4,069 % éch. 25/03/2035                                             | 377                                 | 340                              | 0,00                      | <b>Morgan Stanley Re-REMIC Trust</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>Polaris PLC</b>                            |                                     |                                  |                           |
| 4,198 % éch. 25/03/2035                                             | 70                                  | 62                               | 0,00                      | 4,035 % éch. 26/12/2036                                     | 988                                 | 881                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 27/03/2069                       | 45 800                              | 60 873                           | 0,05                      |
| 4,594 % éch. 25/12/2046                                             | 5 072                               | 5 204                            | 0,01                      | <b>Morgan Stanley Resecuritization Trust</b>                |                                     |                                  |                           | 4,555 % éch. 26/02/2068                       | 45 167                              | 59 951                           | 0,05                      |
| 4,863 % éch. 25/09/2037                                             | 6 712                               | 2 605                            | 0,00                      | 3,436 % éch. 26/06/2047                                     | 4 198                               | 3 656                            | 0,00                      | <b>Precise Mortgage Funding PLC</b>           |                                     |                                  |                           |
| 4,910 % éch. 25/03/2035                                             | 36                                  | 30                               | 0,00                      | 3,522 % éch. 26/11/2046                                     | 2 301                               | 2 035                            | 0,00                      | 4,716 % éch. 16/07/2060                       | 40 267                              | 53 535                           | 0,04                      |
| 5,643 % éch. 25/09/2034                                             | 504                                 | 453                              | 0,00                      | <b>Mortgage Funding PLC</b>                                 |                                     |                                  |                           | <b>Progress Trust</b>                         |                                     |                                  |                           |
| 6,307 % éch. 25/12/2035                                             | 507                                 | 510                              | 0,00                      | 4,966 % éch. 13/03/2046                                     | £ 4 424                             | 5 858                            | 0,01                      | 5,349 % éch. 12/08/2055                       | AUD 25 494                          | 17 675                           | 0,02                      |
| <b>MASTR Alternative Loan Trust</b>                                 |                                     |                                  |                           | <b>MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>      |                                     |                                  |                           | <b>Project Cashmere</b>                       |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 25/04/2035                                             | 1 542                               | 836                              | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/06/2047                                     | \$ 6 371                            | 5 669                            | 0,01                      | 4,543 % éch. 30/12/2057 (c)                   | 1 122 000                           | 774 780                          | 0,62                      |
| 5,750 % éch. 25/08/2035                                             | 1 235                               | 509                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/09/2037                                     | 2 856                               | 2 187                            | 0,00                      | 5,713 % éch. 30/12/2057 (c)                   | 155 200                             | 107 279                          | 0,09                      |
| 6,500 % éch. 25/05/2034                                             | 41                                  | 42                               | 0,00                      | <b>MortgageIT Trust</b>                                     |                                     |                                  |                           | 5,863 % éch. 30/12/2057 (c)                   | 97 800                              | 67 602                           | 0,06                      |
| <b>MASTR Asset Securitization Trust</b>                             |                                     |                                  |                           | 4,323 % éch. 25/10/2035                                     | 52                                  | 52                               | 0,00                      | 6,163 % éch. 30/12/2057 (c)                   | 65 400                              | 45 207                           | 0,04                      |
| 5,000 % éch. 25/07/2019                                             | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/08/2035                                     | 780                                 | 785                              | 0,00                      | 6,563 % éch. 30/12/2057 (c)                   | 53 500                              | 36 982                           | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                                             | 1 566                               | 831                              | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/12/2035                                     | 866                                 | 873                              | 0,00                      | <b>Proteus RMBS DAC</b>                       |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/10/2036                                             | 512                                 | 411                              | 0,00                      | 4,648 % éch. 25/02/2035                                     | 139                                 | 139                              | 0,00                      | 0,000 % éch.                                  |                                     |                                  |                           |
| <b>MASTR Reperforming Loan Trust</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>Mortimer BTL PLC</b>                                     |                                     |                                  |                           | 29/10/2054 (b)(f)                             | € 14 190                            | 11 254                           | 0,01                      |
| 4,123 % éch. 25/07/2035                                             | 2 557                               | 1 160                            | 0,00                      | 4,916 % éch. 22/12/2056                                     | £ 17 609                            | 23 396                           | 0,02                      | 3,070 % éch. 29/10/2054                       | 7 338                               | 8 306                            | 0,01                      |
| 7,000 % éch. 25/08/2034                                             | 8                                   | 5                                | 0,00                      | <b>Mortimer Mix PLC</b>                                     |                                     |                                  |                           | 3,520 % éch. 29/10/2054                       | 8 681                               | 9 754                            | 0,01                      |
| <b>MASTR Seasoned Securitization Trust</b>                          |                                     |                                  |                           | 4,579 % éch. 22/09/2067                                     | 19 694                              | 26 153                           | 0,02                      | 3,820 % éch. 29/10/2054                       | 6 313                               | 7 030                            | 0,01                      |
| 4,163 % éch. 25/10/2032                                             | 77                                  | 70                               | 0,00                      | <b>MSDB Trust</b>                                           |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 29/10/2054                       | 4 735                               | 5 263                            | 0,01                      |
| <b>Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust</b> |                                     |                                  |                           | 3,427 % éch. 11/07/2039                                     | \$ 1 600                            | 1 548                            | 0,00                      | 6,670 % éch. 29/10/2054                       | 3 946                               | 4 374                            | 0,01                      |
| 4,180 % éch. 15/12/2030                                             | 1                                   | 1                                | 0,00                      | <b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b>         |                                     |                                  |                           | <b>Puma Trust</b>                             |                                     |                                  |                           |
| 4,220 % éch. 15/06/2030                                             | 139                                 | 137                              | 0,00                      | 3,858 % éch. 10/04/2037                                     | 5 780                               | 5 542                            | 0,01                      | 5,258 % éch. 18/04/2056                       | AUD 41 193                          | 28 580                           | 0,02                      |
| <b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b>                   |                                     |                                  |                           | <b>New Century Alternative Mortgage Loan Trust</b>          |                                     |                                  |                           | <b>RBSGC Mortgage Loan Trust</b>              |                                     |                                  |                           |
| 4,163 % éch. 25/03/2037                                             | 10 088                              | 2 660                            | 0,00                      | 4,460 % éch. 25/10/2036                                     | 5 935                               | 1 048                            | 0,00                      | 4,213 % éch. 25/01/2037                       | \$ 431                              | 198                              | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/04/2037                                             | 11 135                              | 1 821                            | 0,00                      | 6,810 % éch. 25/07/2036                                     | 3 063                               | 574                              | 0,00                      | <b>RBSGC Structured Trust</b>                 |                                     |                                  |                           |
| 4,288 % éch. 25/06/2037                                             | 2 004                               | 812                              | 0,00                      | <b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>                  |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 25/11/2035                       | 46                                  | 38                               | 0,00                      |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                       |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 25/08/2055                                     | 2 811                               | 2 716                            | 0,00                      | <b>RBSSP Resecuritization Trust</b>           |                                     |                                  |                           |
| 0,239 % éch. 25/01/2029 (a)                                         | 183                                 | 0                                | 0,00                      | 4,000 % éch. 25/04/2057                                     | 4 453                               | 4 279                            | 0,01                      | 4,009 % éch. 27/06/2036                       | 2 100                               | 1 907                            | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/07/2030                                             | 13                                  | 12                               | 0,00                      | 4,500 % éch. 25/05/2058                                     | 10 136                              | 9 809                            | 0,01                      | 4,035 % éch. 26/12/2036                       | 1 067                               | 1 021                            | 0,00                      |
| 4,223 % éch. 25/04/2029                                             | 203                                 | 189                              | 0,00                      | <b>Newgate Funding PLC</b>                                  |                                     |                                  |                           | 4,819 % éch. 26/01/2036                       | 3 297                               | 3 137                            | 0,00                      |
| 4,423 % éch. 25/06/2028                                             | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 2,369 % éch. 01/12/2050                                     | € 1 954                             | 2 225                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 26/05/2036                       | 1 412                               | 477                              | 0,00                      |
| 4,423 % éch. 25/09/2029                                             | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 2,488 % éch. 01/12/2050                                     | 1 245                               | 1 343                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 26/08/2037                       | 502                                 | 446                              | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/08/2035                                             | 2 675                               | 2 518                            | 0,00                      | 3,001 % éch. 15/12/2050                                     | 5 702                               | 6 493                            | 0,01                      | 7,552 % éch. 26/10/2037                       | 1 571                               | 1 471                            | 0,00                      |
| 4,588 % éch. 25/11/2029                                             | 258                                 | 199                              | 0,00                      | 4,026 % éch. 01/12/2050                                     | £ 11 745                            | 15 448                           | 0,01                      | <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b> |                                     |                                  |                           |
| 4,708 % éch. 25/08/2036                                             | 1 832                               | 1 681                            | 0,00                      | 4,026 % éch. 15/12/2050                                     | 4 888                               | 6 386                            | 0,01                      | 2,787 % éch. 25/12/2036 (a)                   | 1 379                               | 156                              | 0,00                      |
| 4,767 % éch. 25/09/2029                                             | 35                                  | 35                               | 0,00                      | 4,036 % éch. 01/12/2050                                     | 1 446                               | 1 904                            | 0,00                      | 2,877 % éch. 25/01/2037 (a)                   | 1 482                               | 197                              | 0,00                      |
| 4,806 % éch. 25/01/2029                                             | 14                                  | 14                               | 0,00                      | 4,866 % éch. 15/12/2050                                     | 4 862                               | 6 411                            | 0,01                      | 2,887 % éch. 25/12/2036 (a)                   | 596                                 | 67                               | 0,00                      |
| 4,938 % éch. 25/05/2036                                             | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 5,116 % éch. 15/12/2050                                     | 316                                 | 410                              | 0,00                      | 3,437 % éch. 25/12/2036 (a)                   | 837                                 | 119                              | 0,00                      |
| 5,380 % éch. 25/12/2035                                             | 874                                 | 859                              | 0,00                      | <b>Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust</b> |                                     |                                  |                           | 3,870 % éch. 25/11/2037                       | 375                                 | 315                              | 0,00                      |
| 5,506 % éch. 25/11/2035                                             | 29                                  | 28                               | 0,00                      | 0,000 % éch. 25/02/2036                                     | \$ 3                                | 0                                | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/05/2037                       | 79                                  | 76                               | 0,00                      |
| 5,645 % éch. 25/12/2032                                             | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/06/2037                                     | 451                                 | 386                              | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/03/2037                       | 1 509                               | 1 170                            | 0,00                      |
| 5,850 % éch. 25/12/2034                                             | 100                                 | 99                               | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/12/2035                                     | 696                                 | 163                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/08/2035                       | 121                                 | 82                               | 0,00                      |
| 6,525 % éch. 25/01/2037                                             | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,559 % éch. 25/06/2036                                     | 210                                 | 144                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/12/2036                       | 2 555                               | 1 889                            | 0,00                      |
| <b>Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust</b>               |                                     |                                  |                           | 4,763 % éch. 25/05/2035                                     | 884                                 | 802                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/06/2037                       | 713                                 | 702                              | 0,00                      |
| 4,260 % éch. 25/04/2037                                             | 1 232                               | 1 004                            | 0,00                      | 5,034 % éch. 25/05/2035                                     | 1 262                               | 587                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/02/2047                       | 1 008                               | 941                              | 0,00                      |
| 6,200 % éch. 25/08/2036                                             | 1 095                               | 943                              | 0,00                      | 5,688 % éch. 25/07/2035                                     | 13                                  | 13                               | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/01/2037                       | 3 612                               | 3 319                            | 0,00                      |
| <b>Merrion Square Residential DAC</b>                               |                                     |                                  |                           | 6,169 % éch. 25/03/2047                                     | 589                                 | 540                              | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/12/2036                       | 1 677                               | 1 586                            | 0,00                      |
| 3,378 % éch. 24/03/2081                                             | € 35 619                            | 40 856                           | 0,03                      | 6,215 % éch. 25/08/2036                                     | 9 748                               | 2 489                            | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/01/2037                       | 1 368                               | 1 228                            | 0,00                      |
| <b>Metlife Securitization Trust</b>                                 |                                     |                                  |                           | 6,408 % éch. 25/05/2036                                     | 693                                 | 121                              | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/12/2036                       | 1 597                               | 1 222                            | 0,00                      |
| 3,750 % éch. 25/03/2057                                             | \$ 3 440                            | 3 322                            | 0,00                      | 6,495 % éch. 25/03/2047                                     | 1 083                               | 993                              | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/07/2036                       | 6 182                               | 2 284                            | 0,00                      |
| <b>Mill City Mortgage Loan Trust</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>Nomura Resecuritization Trust</b>                        |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/01/2037                       | 1 477                               | 1 021                            | 0,00                      |
| 3,250 % éch. 25/01/2061                                             | 9 742                               | 8 342                            | 0,01                      | 1,570 % éch. 26/03/2037                                     | 910                                 | 751                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/07/2036                       | 911                                 | 867                              | 0,00                      |
| <b>Morgan Stanley Capital Trust</b>                                 |                                     |                                  |                           | 1,868 % éch. 26/02/2037                                     | 944                                 | 800                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/09/2036                       | 1 411                               | 1 337                            | 0,00                      |
| 4,523 % éch. 15/08/2033                                             | 7 568                               | 6 226                            | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/07/2036                                     | 16 270                              | 15 837                           | 0,01                      | 4,143 % éch. 25/12/2036                       | 1 001                               | 919                              | 0,00                      |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Capital Holdings LLC</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                      |                                     |                                  |                           | 4,143 % éch. 25/05/2037                       | 879                                 | 830                              | 0,00                      |
| 3,397 % éch. 13/09/2039                                             | 14 710                              | 14 130                           | 0,01                      | 0,382 % éch. 25/09/2046                                     | 8 879                               | 3 267                            | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/07/2037                       | 2 921                               | 2 803                            | 0,00                      |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                           |                                     |                                  |                           | <b>OBX Trust</b>                                            |                                     |                                  |                           | 4,143 % éch. 25/05/2047                       | 760                                 | 719                              | 0,00                      |
| 2,160 % éch. 25/06/2037                                             | 3 367                               | 1 738                            | 0,00                      | 4,413 % éch. 25/06/2057                                     | 910                                 | 905                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/08/2036                       | 100                                 | 80                               | 0,00                      |
| 3,128 % éch. 25/11/2037                                             | 5 604                               | 3 842                            | 0,00                      | <b>Olympus Trust</b>                                        |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/05/2037                       | 2 303                               | 1 778                            | 0,00                      |
| 3,440 % éch. 25/11/2037                                             | 75                                  | 46                               | 0,00                      | 4,999 % éch. 12/11/2057                                     | AUD 18 879                          | 13 078                           | 0,01                      | 4,193 % éch. 25/05/2046                       | 2 267                               | 2 045                            | 0,00                      |
| 3,672 % éch. 25/05/2036                                             | 1 384                               | 702                              | 0,00                      | <b>Pepper Prime Trust</b>                                   |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/02/2046                       | 62                                  | 28                               | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/06/2036                                             | 3 416                               | 653                              | 0,00                      | 4,999 % éch. 12/04/2067                                     | 1 424                               | 986                              | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/05/2046                       | 1 926                               | 1 457                            | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/08/2036                                             | 5 199                               | 1 060                            | 0,00                      | <b>PHH Alternative Mortgage Trust</b>                       |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/04/2036                       | 1 555                               | 1 393                            | 0,00                      |
| 4,273 % éch. 25/02/2047                                             | 6 601                               | 2 402                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/02/2037                                     | \$ 2 810                            | 2 066                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/03/2037                       | 3 121                               | 2 476                            | 0,00                      |
| 4,300 % éch. 25/10/2037                                             | 608                                 | 398                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/05/2037                                     | 1 242                               | 1 132                            | 0,00                      | 4,446 % éch. 25/08/2035                       | 83                                  | 74                               | 0,00                      |
| 4,459 % éch. 25/03/2036                                             | 32                                  | 17                               | 0,00                      | 4,463 % éch. 25/07/2037                                     | 519                                 | 512                              | 0,00                      |                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,888 % éch. 25/09/2035                                             | 1 724                               | 1 744                            | 0,00                      | <b>Pierpont BTL PLC</b>                                     |                                     |                                  |                           |                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,361 % éch. 25/08/2034                                             | 17                                  | 16                               | 0,00                      | 4,586 % éch. 21/09/2061                                     | £ 23 709                            | 31 482                           | 0,03                      |                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,488 % éch. 25/11/2035                                             | 1 855                               | 1 868                            | 0,00                      | 4,846 % éch. 21/09/2054                                     | 6 151                               | 8 172                            | 0,01                      |                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 25/10/2037                                             | 192                                 | 187                              | 0,00                      | <b>PMF PLC</b>                                              |                                     |                                  |                           |                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,569 % éch. 25/06/2036                                             | 537                                 | 525                              | 0,00                      | 0,000 % éch. 16/01/2060 (f)                                 | 20                                  | 5 688                            | 0,01                      |                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,743 % éch. 25/09/2035                                             | 829                                 | 859                              | 0,00                      | 4,495 % éch. 16/02/2063                                     | 19 200                              | 25 498                           | 0,02                      |                                               |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,594 % éch. 25/09/2046                             | \$ 3 745                            | \$ 3 548                         | 0,00                      | RMAC Securities PLC                            | € 1 110                             | \$ 1 257                         | 0,00                      | 3,933 % éch. 25/02/2036                               | \$ 1 574                            | \$ 1 342                         | 0,00                      |
| 4,655 % éch. 25/10/2037                             | 4 023                               | 3 179                            | 0,00                      | 2,547 % éch. 12/06/2044                        | 3 706                               | 4 083                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/01/2037                               | 2 459                               | 2 255                            | 0,00                      |
| 4,670 % éch. 25/02/2035                             | 402                                 | 362                              | 0,00                      | 2,637 % éch. 12/06/2044                        | 1 061                               | 1 166                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/01/2037                               | 1 545                               | 1 413                            | 0,00                      |
| 4,744 % éch. 25/01/2046                             | 133                                 | 102                              | 0,00                      | 2,667 % éch. 12/06/2044                        | 3 577                               | 3 909                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/07/2046                               | 2 635                               | 2 368                            | 0,00                      |
| 5,010 % éch. 25/07/2035                             | 530                                 | 499                              | 0,00                      | 2,867 % éch. 12/06/2044                        | 1 732                               | 2 274                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/09/2047                               | 153                                 | 146                              | 0,00                      |
| 5,104 % éch. 25/09/2045                             | 273                                 | 236                              | 0,00                      | 4,016 % éch. 12/06/2044                        | 12 997                              | 16 974                           | 0,02                      | 4,163 % éch. 25/02/2036                               | 273                                 | 229                              | 0,00                      |
| 5,244 % éch. 25/08/2035                             | 1 331                               | 997                              | 0,00                      | 4,036 % éch. 12/06/2044                        | \$ 179                              | 174                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/02/2036                               | 2 229                               | 1 424                            | 0,00                      |
| 5,288 % éch. 25/02/2035                             | 320                                 | 112                              | 0,00                      | 4,049 % éch. 12/06/2044                        | £ 450                               | 568                              | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/09/2047                               | 8 831                               | 8 253                            | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 25/06/2035                             | 597                                 | 508                              | 0,00                      | 4,296 % éch. 12/06/2044                        | 836                                 | 1 097                            | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/05/2036                               | 7 684                               | 6 467                            | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 25/09/2035                             | 913                                 | 723                              | 0,00                      | Rochester Financing PLC                        |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/09/2047                               | 7 522                               | 6 832                            | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 25/02/2036                             | 417                                 | 348                              | 0,00                      | 5,046 % éch. 18/12/2044                        | 1 010                               | 1 341                            | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/02/2036                               | 737                                 | 682                              | 0,00                      |
| 5,750 % éch. 25/01/2037                             | 1 187                               | 904                              | 0,00                      | Ronda RMBS DAC                                 |                                     |                                  |                           | 4,223 % éch. 25/05/2045                               | 31                                  | 30                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/09/2035                             | 1 418                               | 1 255                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 28/10/2075 (f)                    | € 710                               | 635                              | 0,00                      | 4,234 % éch. 19/04/2035                               | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/12/2035                             | 1 206                               | 1 050                            | 0,00                      | 2,963 % éch. 28/10/2075                        | 21 745                              | 24 753                           | 0,02                      | 4,254 % éch. 19/07/2035                               | 14                                  | 14                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/04/2036                             | 753                                 | 614                              | 0,00                      | 3,663 % éch. 28/10/2075                        | 1 806                               | 2 043                            | 0,00                      | 4,323 % éch. 25/02/2036                               | 58                                  | 50                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/05/2036                             | 318                                 | 282                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 28/10/2075                        | 1 626                               | 1 840                            | 0,00                      | 4,354 % éch. 19/07/2034                               | 149                                 | 144                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                             | 1 889                               | 1 513                            | 0,00                      | 4,663 % éch. 28/10/2075                        | 1 084                               | 1 216                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/08/2036                               | 5 483                               | 4 502                            | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2036                             | 189                                 | 152                              | 0,00                      | 5,163 % éch. 28/10/2075                        | 1 174                               | 1 301                            | 0,00                      | 4,454 % éch. 19/12/2034                               | 66                                  | 62                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2036                             | 3 523                               | 2 971                            | 0,00                      | 5,663 % éch. 28/10/2075                        | 542                                 | 592                              | 0,00                      | 4,863 % éch. 25/09/2047                               | 3 834                               | 3 376                            | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/09/2036                             | 676                                 | 543                              | 0,00                      | 8,000 % éch. 28/10/2075                        | 6 234                               | 2 032                            | 0,00                      | 4,879 % éch. 19/12/2033                               | 147                                 | 143                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/11/2036                             | 142                                 | 114                              | 0,00                      | Roundstone Securities DAC                      |                                     |                                  |                           | 5,144 % éch. 25/12/2035                               | 813                                 | 695                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/01/2037                             | 2 985                               | 2 457                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 28/06/2058                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,204 % éch. 25/03/2046                               | 508                                 | 480                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/03/2037                             | 284                                 | 246                              | 0,00                      | 1,000 % éch. 28/06/2058                        | 4 957                               | 5 368                            | 0,01                      | 5,244 % éch. 25/08/2047                               | 7 232                               | 6 280                            | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/04/2037                             | 270                                 | 228                              | 0,00                      | 3,193 % éch. 28/06/2058                        | 70 192                              | 80 356                           | 0,07                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/05/2037                             | 236                                 | 197                              | 0,00                      | 3,293 % éch. 28/06/2058                        | 8 481                               | 9 701                            | 0,01                      | 4,013 % éch. 25/07/2035                               | 1 262                               | 1 140                            | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2037                             | 334                                 | 273                              | 0,00                      | 3,493 % éch. 28/06/2058                        | 7 201                               | 8 220                            | 0,01                      | 4,013 % éch. 25/05/2036                               | 1 537                               | 1 265                            | 0,00                      |
| 6,156 % éch. 25/02/2036                             | 654                                 | 551                              | 0,00                      | 4,000 % éch. 28/06/2058                        | 13 602                              | 4 050                            | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/01/2036                               | 504                                 | 429                              | 0,00                      |
| 6,250 % éch. 25/01/2037                             | 85                                  | 71                               | 0,00                      | 4,293 % éch. 28/06/2058                        | 6 000                               | 6 838                            | 0,01                      | SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust          |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 25/02/2037                             | 2 118                               | 1 767                            | 0,00                      | 5,293 % éch. 28/06/2058                        | 3 600                               | 4 093                            | 0,00                      | 4,184 % éch. 25/06/2037                               | 567                                 | 513                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/08/2036                             | 2 103                               | 1 759                            | 0,00                      | 5,793 % éch. 28/06/2058                        | 1 920                               | 2 164                            | 0,00                      | 4,461 % éch. 25/10/2037                               | 420                                 | 374                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/09/2036                             | 405                                 | 151                              | 0,00                      | Santander Residential FT                       |                                     |                                  |                           | TBW Mortgage-Backed Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 25/11/2036                             | 169                                 | 141                              | 0,00                      | 3,088 % éch. 18/10/2068                        | 55 507                              | 63 623                           | 0,05                      | 5,500 % éch. 25/07/2036                               | 10                                  | 1                                | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/02/2037                             | 3 618                               | 3 062                            | 0,00                      | Sapphire Trust Central Finance                 |                                     |                                  |                           | 5,965 % éch. 25/07/2037                               | 3 276                               | 911                              | 0,00                      |
| 6,750 % éch. 25/06/2037                             | 867                                 | 305                              | 0,00                      | 4,999 % éch. 12/02/2067                        | AUD 1 387                           | 961                              | 0,00                      | 6,450 % éch. 25/03/2037                               | 12 356                              | 2 346                            | 0,00                      |
| 6,864 % éch. 25/08/2047                             | 7 433                               | 940                              | 0,00                      | 4,999 % éch. 12/12/2067                        | 30 009                              | 20 784                           | 0,02                      | TDA Mixto FTA                                         |                                     |                                  |                           |
| Residential Asset Securitization Trust              |                                     |                                  |                           | 5,131 % éch. 12/03/2068                        | 36 100                              | 25 013                           | 0,02                      | 2,566 % éch. 22/06/2040                               | € 2 541                             | 2 748                            | 0,00                      |
| 4,073 % éch. 25/04/2037                             | 4 134                               | 754                              | 0,00                      | 5,299 % éch. 12/12/2067                        | 52 800                              | 36 480                           | 0,03                      | Terwin Mortgage Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,313 % éch. 25/11/2035                             | 106                                 | 49                               | 0,00                      | 5,570 % éch. 14/01/2066                        | 7 794                               | 5 417                            | 0,01                      | 4,323 % éch. 25/10/2037                               | \$ 4 938                            | 1 450                            | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 25/08/2034                             | 575                                 | 575                              | 0,00                      | Sequoia Mortgage Trust                         |                                     |                                  |                           | Thornburg Mortgage Securities Trust                   |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 25/09/2035                             | 2 491                               | 986                              | 0,00                      | 4,015 % éch. 20/07/2037                        | \$ 1 128                            | 858                              | 0,00                      | 2,690 % éch. 25/03/2044                               | 381                                 | 374                              | 0,00                      |
| 5,750 % éch. 25/02/2036                             | 1 039                               | 1 013                            | 0,00                      | 4,159 % éch. 20/06/2037                        | 2 688                               | 2 183                            | 0,00                      | 4,016 % éch. 25/09/2037                               | 164                                 | 163                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2035                             | 1 189                               | 617                              | 0,00                      | 4,394 % éch. 20/11/2034                        | 407                                 | 390                              | 0,00                      | 4,259 % éch. 25/09/2037                               | 80                                  | 79                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/02/2036                             | 17 167                              | 6 077                            | 0,01                      | 4,649 % éch. 20/02/2034                        | 97                                  | 87                               | 0,00                      | 4,287 % éch. 25/04/2036                               | 473                                 | 446                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/04/2036                             | 2 866                               | 1 115                            | 0,00                      | Sestante Finance SRL                           |                                     |                                  |                           | 4,711 % éch. 25/10/2046                               | 29                                  | 28                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                             | 3 996                               | 1 340                            | 0,00                      | 2,388 % éch. 23/07/2046                        | € 7 979                             | 8 667                            | 0,01                      | 5,116 % éch. 25/07/2036                               | 1 068                               | 867                              | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/09/2036                             | 7 162                               | 1 899                            | 0,00                      | Stratton BTL Mortgage Funding PLC              |                                     |                                  |                           | 5,180 % éch. 25/04/2045                               | 2                                   | 1                                | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/12/2036                             | 9 947                               | 2 559                            | 0,00                      | 4,477 % éch. 20/01/2054                        | £ 6 231                             | 8 277                            | 0,01                      | 6,039 % éch. 25/06/2037                               | 64                                  | 53                               | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 25/04/2037                             | 1 054                               | 505                              | 0,00                      | Stratton Mortgage Funding PLC                  |                                     |                                  |                           | Towd Point Mortgage Funding PLC                       |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                             | 1 064                               | 365                              | 0,00                      | 4,649 % éch. 28/06/2050                        | 18 522                              | 24 593                           | 0,02                      | 4,584 % éch. 20/04/2051                               | £ 17 994                            | 23 886                           | 0,02                      |
| 6,000 % éch. 25/08/2037                             | 2 234                               | 958                              | 0,00                      | 4,721 % éch. 25/06/2049                        | 18 880                              | 25 069                           | 0,02                      | 4,672 % éch. 20/07/2053                               | 79 756                              | 105 920                          | 0,09                      |
| 6,000 % éch. 25/01/2046                             | 2 374                               | 828                              | 0,00                      | 5,496 % éch. 20/06/2060                        | 17 063                              | 22 681                           | 0,02                      | 4,984 % éch. 20/04/2051                               | 2 107                               | 2 798                            | 0,00                      |
| 6,250 % éch. 25/08/2036                             | 1 218                               | 858                              | 0,00                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           | 5,147 % éch. 20/02/2054                               | 22 009                              | 29 274                           | 0,03                      |
| 6,250 % éch. 25/12/2036                             | 2 002                               | 594                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/09/2034                        | \$ 229                              | 217                              | 0,00                      | 5,284 % éch. 20/04/2051                               | 1 263                               | 1 678                            | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/07/2036                             | 1 068                               | 258                              | 0,00                      | 4,076 % éch. 25/07/2035                        | 154                                 | 77                               | 0,00                      | 5,984 % éch. 20/04/2051                               | 1 051                               | 1 399                            | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/09/2036                             | 1 185                               | 327                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/01/2037                        | 1 475                               | 1 482                            | 0,00                      | 6,147 % éch. 20/07/2053                               | 4 300                               | 5 724                            | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 25/04/2037                             | 9 894                               | 2 557                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/10/2035                        | 1 336                               | 1 284                            | 0,00                      | 6,984 % éch. 20/04/2051                               | 841                                 | 1 118                            | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 25/06/2037                             | 6 873                               | 1 259                            | 0,00                      | 4,195 % éch. 25/10/2036                        | 1 698                               | 1 545                            | 0,00                      | 7,247 % éch. 20/07/2053                               | 2 842                               | 3 777                            | 0,00                      |
| 6,609 % éch. 25/02/2037                             | 11 476                              | 2 539                            | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/05/2037                        | 595                                 | 562                              | 0,00                      | 7,984 % éch. 20/04/2051                               | 527                                 | 702                              | 0,00                      |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/05/2037                        | 1 103                               | 1 013                            | 0,00                      | 8,247 % éch. 20/07/2053                               | 1 600                               | 2 130                            | 0,00                      |
| 0,000 % éch. 25/09/2036                             | 33                                  | 0                                | 0,00                      | 4,274 % éch. 25/02/2036                        | 2 392                               | 1 790                            | 0,00                      | Towd Point Mortgage Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 3,534 % éch. 25/06/2035                             | 231                                 | 128                              | 0,00                      | 4,313 % éch. 25/09/2034                        | 2 490                               | 2 256                            | 0,00                      | 2,750 % éch. 25/06/2057                               | \$ 1 862                            | 1 834                            | 0,00                      |
| 4,135 % éch. 25/08/2035                             | 30                                  | 10                               | 0,00                      | 4,349 % éch. 25/08/2035                        | 1 357                               | 1 230                            | 0,00                      | 2,750 % éch. 25/10/2057                               | 3 824                               | 3 788                            | 0,00                      |
| 5,066 % éch. 25/04/2037                             | 83                                  | 42                               | 0,00                      | 4,393 % éch. 25/04/2036                        | 95                                  | 80                               | 0,00                      | 3,000 % éch. 25/06/2058                               | 1 306                               | 1 235                            | 0,00                      |
| 5,351 % éch. 25/04/2037                             | 341                                 | 295                              | 0,00                      | 4,418 % éch. 25/05/2036                        | 1 745                               | 1 206                            | 0,00                      | 3,250 % éch. 25/07/2056                               | 332                                 | 331                              | 0,00                      |
| 5,392 % éch. 25/09/2035                             | 2 106                               | 1 307                            | 0,00                      | 4,429 % éch. 25/11/2035                        | 42                                  | 27                               | 0,00                      | 3,750 % éch. 25/04/2055                               | 3 570                               | 3 541                            | 0,00                      |
| 5,439 % éch. 25/08/2036                             | 961                                 | 631                              | 0,00                      | 4,486 % éch. 25/07/2035                        | 430                                 | 380                              | 0,00                      | 3,750 % éch. 25/10/2056                               | 20 092                              | 19 835                           | 0,02                      |
| 5,497 % éch. 27/07/2037                             | 222                                 | 145                              | 0,00                      | 4,603 % éch. 25/01/2035                        | 459                                 | 444                              | 0,00                      | 3,799 % éch. 25/07/2057                               | 13 185                              | 11 765                           | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/06/2036                             | 193                                 | 164                              | 0,00                      | 4,625 % éch. 25/11/2037                        | 236                                 | 224                              | 0,00                      | 4,072 % éch. 25/04/2056                               | 12 200                              | 11 529                           | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 25/07/2036                             | 146                                 | 127                              | 0,00                      | 4,705 % éch. 25/09/2034                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Tower Bridge Funding PLC                              |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/09/2036                             | 598                                 | 482                              | 0,00                      | 4,951 % éch. 25/11/2037                        | 128                                 | 79                               | 0,00                      | 4,538 % éch. 20/12/2066                               | £ 14 673                            | 19 480                           | 0,02                      |
| 6,250 % éch. 25/08/2036                             | 954                                 | 806                              | 0,00                      | 5,075 % éch. 25/02/2035                        | 1 829                               | 1 748                            | 0,00                      | 4,627 % éch. 20/05/2066                               | 10 144                              | 13 477                           | 0,01                      |
| Resimac Premier Trust                               |                                     |                                  |                           | 5,384 % éch. 25/01/2035                        | 30                                  | 29                               | 0,00                      | 4,628 % éch. 20/05/2066                               | 3 695                               | 4 910                            | 0,01                      |
| 5,399 % éch. 12/02/2056                             | AUD 33 359                          | 23 180                           | 0,02                      | 5,422 % éch. 25/08/2036                        | 2 497                               | 1 482                            | 0,00                      | Trinity Square PLC                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,423 % éch. 11/02/2058                             | 47 500                              | 32 913                           | 0,03                      | 5,534 % éch. 25/10/2035                        | 68                                  | 65                               | 0,00                      | 4,647 % éch. 15/07/2059                               | 39 004                              | 51 807                           | 0,04                      |
| Resloc UK PLC                                       |                                     |                                  |                           | 5,645 % éch. 25/10/2037                        | 2 090                               | 1 969                            | 0,00                      | 5,047 % éch. 15/07/2059                               | 3 000                               | 3 986                            | 0,00                      |
| 3,797 % éch. 15/12/2043                             | \$ 8 120                            | 8 014                            | 0,01                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust    |                                     |                                  |                           | Triton Bond Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,086 % éch. 15/12/2043                             | £ 1 501                             | 1 922                            | 0,00                      | 3,457 % éch. 25/05/2047                        | 2 646                               | 2 125                            | 0,00                      | 5,000 % éch. 15/02/2058                               | AUD 13 765                          | 9 534                            | 0,01                      |
| RiverView HECM Trust                                |                                     |                                  |                           | 3,666 % éch. 19/10/2034                        | 219                                 | 193                              | 0,00                      | 5,250 % éch. 15/02/2058                               | 27 300                              | 18 858                           | 0,02                      |
| 4,033 % éch. 25/05/2047                             | \$ 917                              | 820                              | 0,00                      | 3,883 % éch. 25/08/2036                        | 7 430                               | 6 629                            | 0,01                      | 5,299 % éch. 12/03/2057                               | 45 203                              | 31 294                           | 0,03                      |
| RMAC PLC                                            |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/10/2036                        | 3 165                               | 2 770                            | 0,00                      | Twin Bridges PLC                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,947 % éch. 15/02/2047                             | £ 12 898                            | 17 128                           | 0,02                      |                                                |                                     |                                  |                           | 4,927 % éch. 15/05/2056                               | £ 7 675                             | 10 223                           | 0,01                      |
| 7,347 % éch. 15/02/2047                             | 3 273                               |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Uropa Securities PLC                          |                                     |                                  |                           | 5,896 % éch. 21/12/2049                                        | £ 6 405                             | \$ 8 502                         | 0,01                      | Auto1 Car Funding SARL                      |                                     |                                  |                           |
| 4,216 % éch. 10/10/2040                       | £ 6 630                             | \$ 8 457                         | 0,01                      | 6,396 % éch. 21/12/2049                                        | 3 660                               | 4 849                            | 0,01                      | 2,829 % éch. 15/12/2033                     | € 5 782                             | \$ 6 620                         | 0,01                      |
| Valley Funding PLC                            |                                     |                                  |                           | 6,896 % éch. 21/12/2049                                        | 3 660                               | 4 810                            | 0,01                      | AutoFlorence SRL                            |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 16/05/2066 (f)                   | 8 427                               | 10 238                           | 0,01                      | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust     |                                     |                                  |                           | 2,968 % éch. 24/12/2044                     | 44 100                              | 50 571                           | 0,04                      |
| 4,747 % éch. 16/05/2066                       | 37 316                              | 49 492                           | 0,04                      | 3,808 % éch. 25/09/2036                                        | \$ 553                              | 154                              | 0,00                      | Bavarian Sky S.A.                           |                                     |                                  |                           |
| 5,247 % éch. 16/05/2066                       | 5 246                               | 6 962                            | 0,01                      | 4,016 % éch. 25/10/2036                                        | 3 717                               | 1 025                            | 0,00                      | 2,705 % éch. 20/02/2034                     | 51 100                              | 58 449                           | 0,05                      |
| 5,747 % éch. 16/05/2066                       | 5 474                               | 7 256                            | 0,01                      | 4,060 % éch. 25/10/2036                                        | 8 696                               | 3 104                            | 0,00                      | BBVA Consumer Auto                          |                                     |                                  |                           |
| 6,747 % éch. 16/05/2066                       | 2 828                               | 3 750                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/02/2037                                        | 542                                 | 431                              | 0,00                      | 2,819 % éch. 25/02/2042                     | 45 000                              | 51 495                           | 0,04                      |
| 7,747 % éch. 16/05/2066                       | 1 825                               | 2 422                            | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/02/2036                                        | 1 050                               | 950                              | 0,00                      | 2,879 % éch. 19/05/2042                     | 80 002                              | 91 555                           | 0,07                      |
| 9,247 % éch. 16/05/2066                       | 1 004                               | 1 337                            | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/06/2037                                        | 323                                 | 314                              | 0,00                      | 3,117 % éch. 19/03/2038                     | 59 146                              | 67 839                           | 0,06                      |
| Wachovia Mortgage Loan Trust LLC              |                                     |                                  |                           | 4,213 % éch. 25/05/2035                                        | 1 490                               | 1 279                            | 0,00                      | 3,239 % éch. 19/05/2042                     | 889                                 | 1 016                            | 0,00                      |
| 1,492 % éch. 25/01/2037                       | \$ 1 852                            | 621                              | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/12/2035                                        | 2 063                               | 1 835                            | 0,00                      | Bumper NL BV                                |                                     |                                  |                           |
| 1,559 % éch. 25/08/2036                       | 1 166                               | 372                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/06/2035                                        | 248                                 | 203                              | 0,00                      | 2,925 % éch. 21/03/2036                     | 50 181                              | 57 461                           | 0,05                      |
| 5,972 % éch. 20/08/2035                       | 66                                  | 65                               | 0,00                      | 4,504 % éch. 25/04/2047                                        | 3 450                               | 3 068                            | 0,00                      | Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC |                                     |                                  |                           |
| 6,683 % éch. 20/10/2035                       | 93                                  | 91                               | 0,00                      | 4,574 % éch. 25/11/2046                                        | 80                                  | 74                               | 0,00                      | 0,000 % éch. 20/08/2031 (f)                 | £ 1                                 | 0                                | 0,00                      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | 4,664 % éch. 25/09/2046                                        | 2 987                               | 2 587                            | 0,00                      | 5,135 % éch. 20/08/2031                     | 2 495                               | 3 318                            | 0,00                      |
| 3,408 % éch. 25/01/2037                       | 629                                 | 559                              | 0,00                      | 4,684 % éch. 25/04/2046                                        | 3 335                               | 3 101                            | 0,00                      | 5,636 % éch. 20/08/2031                     | 2 697                               | 3 596                            | 0,00                      |
| 3,455 % éch. 25/01/2037                       | 2 488                               | 2 107                            | 0,00                      | 4,684 % éch. 25/07/2046                                        | 5 317                               | 3 309                            | 0,00                      | 6,335 % éch. 20/08/2031                     | 1 806                               | 2 423                            | 0,00                      |
| 3,632 % éch. 25/03/2037                       | 754                                 | 638                              | 0,00                      | 4,704 % éch. 25/08/2046                                        | 4 064                               | 2 361                            | 0,00                      | 7,985 % éch. 20/08/2031                     | 1 925                               | 2 613                            | 0,00                      |
| 3,632 % éch. 25/05/2046                       | 30                                  | 24                               | 0,00                      | 4,994 % éch. 25/04/2047                                        | 13 988                              | 12 600                           | 0,01                      | 10,486 % éch. 20/08/2031                    | 3 449                               | 4 696                            | 0,00                      |
| 3,642 % éch. 25/09/2036                       | 104                                 | 87                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/07/2035                                        | 733                                 | 691                              | 0,00                      | 12,736 % éch. 20/08/2031                    | 4 513                               | 5 214                            | 0,00                      |
| 3,667 % éch. 25/06/2037                       | 918                                 | 807                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/11/2035                                        | 71                                  | 66                               | 0,00                      | Cars Alliance SARL                          |                                     |                                  |                           |
| 3,748 % éch. 25/12/2046                       | 5 505                               | 4 913                            | 0,01                      | 5,750 % éch. 25/01/2036                                        | 2 174                               | 1 939                            | 0,00                      | 2,856 % éch. 19/05/2036                     | € 29 800                            | 34 115                           | 0,03                      |
| 3,813 % éch. 25/05/2037                       | 706                                 | 614                              | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/02/2036                                        | 104                                 | 98                               | 0,00                      | Chesapeake Funding DAC                      |                                     |                                  |                           |
| 3,871 % éch. 25/06/2037                       | 1 181                               | 1 052                            | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/11/2035                                        | 1 475                               | 1 477                            | 0,00                      | 4,082 % éch. 15/07/2027                     | \$ 47 800                           | 47 794                           | 0,04                      |
| 3,911 % éch. 25/12/2036                       | 462                                 | 418                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                        | 3 609                               | 2 910                            | 0,00                      | 4,260 % éch. 15/12/2028                     | 11 000                              | 10 994                           | 0,01                      |
| 3,946 % éch. 25/05/2037                       | 1 056                               | 883                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                        | 1 512                               | 1 309                            | 0,00                      | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC    |                                     |                                  |                           |
| 3,966 % éch. 25/11/2036                       | 3 513                               | 3 231                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/11/2035                                        | 2 745                               | 1 982                            | 0,00                      | 2,779 % éch. 15/08/2033                     | € 19 629                            | 22 483                           | 0,02                      |
| 3,976 % éch. 25/02/2037                       | 1 351                               | 1 225                            | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/03/2036                                        | 2 786                               | 2 138                            | 0,00                      | 2,814 % éch. 15/12/2032                     | 103                                 | 118                              | 0,00                      |
| 3,978 % éch. 27/02/2034                       | 43                                  | 43                               | 0,00                      | 6,812 % éch. 25/07/2036                                        | 10 200                              | 2 096                            | 0,00                      | Driver Australia Eleven                     |                                     |                                  |                           |
| 3,986 % éch. 25/02/2037                       | 6 531                               | 6 180                            | 0,01                      | 6,949 % éch. 25/07/2036                                        | 1 854                               | 381                              | 0,00                      | 5,300 % éch. 21/11/2033                     | AUD 33 985                          | 23 557                           | 0,02                      |
| 4,028 % éch. 25/06/2037                       | 615                                 | 564                              | 0,00                      | 7,000 % éch. 25/02/2036                                        | 2 218                               | 1 675                            | 0,00                      | Driver Australia Ten                        |                                     |                                  |                           |
| 4,034 % éch. 25/12/2036                       | 546                                 | 504                              | 0,00                      | 7,000 % éch. 25/05/2036                                        | 2 372                               | 2 112                            | 0,00                      | 5,450 % éch. 21/02/2033                     | 16 509                              | 11 461                           | 0,01                      |
| 4,041 % éch. 25/07/2037                       | 3 547                               | 3 322                            | 0,00                      | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           | FACT S.A.                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,054 % éch. 25/09/2036                       | 3 262                               | 2 820                            | 0,00                      | 3,380 % éch. 25/01/2035                                        | 23                                  | 21                               | 0,00                      | 2,915 % éch. 20/04/2033                     | € 26 833                            | 30 724                           | 0,03                      |
| 4,091 % éch. 25/04/2035                       | 756                                 | 736                              | 0,00                      | Wells Fargo Alternative Loan Trust                             |                                     |                                  |                           | FACT S.A.                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,119 % éch. 25/02/2037                       | 1 076                               | 967                              | 0,00                      | 2,307 % éch. 25/06/2037 (a)                                    | 601                                 | 58                               | 0,00                      | 2,935 % éch. 22/09/2031                     | 12 100                              | 13 860                           | 0,01                      |
| 4,208 % éch. 25/02/2037                       | 2 894                               | 2 756                            | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/06/2037                                        | 723                                 | 537                              | 0,00                      | First Mobility SARL                         |                                     |                                  |                           |
| 4,223 % éch. 25/04/2045                       | 4 784                               | 4 673                            | 0,01                      | 4,193 % éch. 25/06/2037                                        | 601                                 | 537                              | 0,00                      | 2,809 % éch. 14/10/2032                     | 25 114                              | 28 757                           | 0,02                      |
| 4,235 % éch. 25/12/2036                       | 4 938                               | 4 602                            | 0,01                      | 6,250 % éch. 25/07/2037                                        | 1 910                               | 1 690                            | 0,00                      | First Mobility Swiss Lease                  |                                     |                                  |                           |
| 4,294 % éch. 25/08/2036                       | 681                                 | 629                              | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/11/2037                                        | 914                                 | 783                              | 0,00                      | 2,959 % éch. 23/09/2033                     | 30 847                              | 35 315                           | 0,03                      |
| 4,303 % éch. 25/07/2045                       | 388                                 | 380                              | 0,00                      | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                          |                                     |                                  |                           | Foyt Finance DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 4,379 % éch. 25/08/2046                       | 632                                 | 596                              | 0,00                      | 3,874 % éch. 15/06/2036                                        | 2 600                               | 2 440                            | 0,00                      | 0,000 % éch. 27/12/2041                     | 180                                 | 1 845                            | 0,00                      |
| 4,383 % éch. 25/01/2045                       | 406                                 | 402                              | 0,00                      | 5,761 % éch. 15/09/2040                                        | 16 462                              | 16 249                           | 0,01                      | 0,000 % éch. 27/12/2041 (f)                 | 100                                 | 93                               | 0,00                      |
| 4,444 % éch. 25/02/2047                       | 1 896                               | 1 787                            | 0,00                      | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust                   |                                     |                                  |                           | 2,652 % éch. 27/12/2041                     | 29 844                              | 34 167                           | 0,03                      |
| 4,444 % éch. 25/03/2047                       | 362                                 | 327                              | 0,00                      | 5,407 % éch. 25/04/2037                                        | 269                                 | 240                              | 0,00                      | 2,852 % éch. 27/12/2041                     | 2 994                               | 3 428                            | 0,00                      |
| 4,463 % éch. 25/12/2045                       | 1 065                               | 986                              | 0,00                      | 5,698 % éch. 25/04/2036                                        | 1 037                               | 1 036                            | 0,00                      | 3,102 % éch. 27/12/2041                     | 2 415                               | 2 766                            | 0,00                      |
| 4,464 % éch. 25/10/2036                       | 3 052                               | 2 886                            | 0,00                      | 5,788 % éch. 25/03/2036                                        | 785                                 | 778                              | 0,00                      | 3,602 % éch. 27/12/2041                     | 676                                 | 775                              | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/10/2045                       | 69                                  | 67                               | 0,00                      | 5,876 % éch. 25/11/2037                                        | 140                                 | 129                              | 0,00                      | 4,402 % éch. 27/12/2041                     | 2 028                               | 2 329                            | 0,00                      |
| 4,494 % éch. 25/06/2047                       | 9 356                               | 8 110                            | 0,01                      | 5,947 % éch. 25/10/2036                                        | 65                                  | 62                               | 0,00                      | 5,502 % éch. 27/12/2041                     | 769                                 | 883                              | 0,00                      |
| 4,503 % éch. 25/01/2045                       | 989                                 | 973                              | 0,00                      | 5,952 % éch. 25/10/2036                                        | 1 448                               | 1 363                            | 0,00                      | FTA Santander Consumer Spain Auto           |                                     |                                  |                           |
| 4,504 % éch. 25/04/2047                       | 286                                 | 267                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/06/2037                                        | 495                                 | 452                              | 0,00                      | 2,980 % éch. 17/09/2043                     | 35 163                              | 40 184                           | 0,03                      |
| 4,514 % éch. 25/04/2047                       | 1 230                               | 1 111                            | 0,00                      | 6,003 % éch. 25/08/2036                                        | 653                                 | 621                              | 0,00                      | 3,236 % éch. 22/09/2039                     | 4 948                               | 5 673                            | 0,01                      |
| 4,514 % éch. 25/05/2047                       | 3 368                               | 2 914                            | 0,00                      | 6,099 % éch. 25/04/2036                                        | 751                                 | 705                              | 0,00                      | Fulvia SPV SRL                              |                                     |                                  |                           |
| 4,542 % éch. 25/07/2047                       | 1 297                               | 1 151                            | 0,00                      | 6,105 % éch. 25/10/2037                                        | 63                                  | 55                               | 0,00                      | 3,030 % éch. 23/12/2041                     | 55 695                              | 63 804                           | 0,05                      |
| 4,554 % éch. 25/07/2047                       | 9 337                               | 7 948                            | 0,01                      | 6,155 % éch. 25/09/2036                                        | 728                                 | 703                              | 0,00                      | Golden Bar Securitisation SRL               |                                     |                                  |                           |
| 4,563 % éch. 25/06/2044                       | 78                                  | 79                               | 0,00                      | 6,247 % éch. 25/08/2035                                        | 421                                 | 416                              | 0,00                      | 3,436 % éch. 22/09/2043                     | 32 544                              | 37 420                           | 0,03                      |
| 4,590 % éch. 25/07/2037                       | 2 937                               | 2 745                            | 0,00                      | 6,289 % éch. 25/12/2036                                        | 485                                 | 446                              | 0,00                      | 5,286 % éch. 22/09/2043                     | 6 558                               | 7 658                            | 0,01                      |
| 4,604 % éch. 25/03/2035                       | 1 337                               | 1 312                            | 0,00                      | Winchester PLC                                                 |                                     |                                  |                           | 5,986 % éch. 22/09/2043                     | 1 389                               | 1 623                            | 0,00                      |
| 4,624 % éch. 25/10/2046                       | 4 828                               | 4 371                            | 0,01                      | 4,637 % éch. 21/10/2056                                        | £ 18 931                            | 25 151                           | 0,02                      | Hill FL BV                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,643 % éch. 25/12/2035                       | 3 597                               | 3 409                            | 0,00                      | Worldwide Plaza Trust                                          |                                     |                                  |                           | 2,909 % éch. 18/10/2033                     | 25 400                              | 29 044                           | 0,02                      |
| 4,648 % éch. 25/08/2046                       | 368                                 | 355                              | 0,00                      | 3,715 % éch. 10/11/2036                                        | \$ 62 860                           | 3 779                            | 0,00                      | 2,929 % éch. 18/10/2032                     | 22 164                              | 25 360                           | 0,02                      |
| 4,663 % éch. 25/10/2045                       | 6 728                               | 5 979                            | 0,01                      | WST Trust                                                      |                                     |                                  |                           | 2,939 % éch. 18/06/2034                     | 26 500                              | 30 331                           | 0,02                      |
| 4,664 % éch. 25/09/2046                       | 2 341                               | 2 181                            | 0,00                      | 5,238 % éch. 18/08/2056                                        | AUD 39 899                          | 27 655                           | 0,02                      | Koromo Italy Compartment                    |                                     |                                  |                           |
| 4,703 % éch. 25/03/2037                       | 83                                  | 77                               | 0,00                      | TITRES ADOSSES À DES ACTIFS                                    |                                     |                                  |                           | 2,905 % éch. 26/02/2032                     | 38 899                              | 44 566                           | 0,04                      |
| 4,734 % éch. 25/06/2046                       | 1 395                               | 1 241                            | 0,00                      | TITRES ADOSSES À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES                 |                                     |                                  |                           | Koromo UK PLC                               |                                     |                                  |                           |
| 4,743 % éch. 25/10/2045                       | 214                                 | 208                              | 0,00                      | Angle Asset Finance Radian Trust                               |                                     |                                  |                           | 4,335 % éch. 23/10/2034                     | £ 9 683                             | 12 858                           | 0,01                      |
| 4,744 % éch. 25/02/2046                       | 2 525                               | 2 352                            | 0,00                      | 5,500 % éch. 16/03/2033                                        | 21 375                              | 14 844                           | 0,01                      | LT Rahoitus DAC                             |                                     |                                  |                           |
| 4,763 % éch. 25/12/2045                       | 3 565                               | 3 596                            | 0,00                      | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                              |                                     |                                  |                           | 2,749 % éch. 18/07/2036                     | € 28 806                            | 32 925                           | 0,03                      |
| 4,783 % éch. 25/08/2045                       | 2 644                               | 2 522                            | 0,00                      | 2,939 % éch. 29/12/2036                                        | € 70 132                            | 80 281                           | 0,07                      | Metro Finance Trust                         |                                     |                                  |                           |
| 4,792 % éch. 25/08/2046                       | 1 866                               | 1 645                            | 0,00                      | 2,953 % éch. 26/12/2041                                        | 42 900                              | 49 135                           | 0,04                      | 5,370 % éch. 16/02/2033                     | AUD 50 812                          | 35 206                           | 0,03                      |
| 4,878 % éch. 25/01/2035                       | 1 220                               | 1 192                            | 0,00                      | Auto ABS Spanish Loans                                         |                                     |                                  |                           | Panorama Auto Trust                         |                                     |                                  |                           |
| 4,994 % éch. 25/01/2047                       | 4 048                               | 3 682                            | 0,00                      | 3,059 % éch. 28/09/2038                                        | 35 342                              | 40 502                           | 0,03                      | 5,170 % éch. 15/09/2033                     | 54 073                              | 37 404                           | 0,03                      |
| 4,997 % éch. 25/07/2034                       | 161                                 | 140                              | 0,00                      | 3,721 % éch. 28/02/2032                                        | 767                                 | 877                              | 0,00                      | 5,230 % éch. 20/04/2034                     | 41 983                              | 29 066                           | 0,02                      |
| 5,244 % éch. 25/09/2046                       | 1 843                               | 1 756                            | 0,00                      | 4,421 % éch. 28/02/2032                                        | 1 237                               | 1 415                            | 0,00                      | 5,270 % éch. 15/03/2033                     | 32 563                              | 22 567                           | 0,02                      |
| 5,244 % éch. 25/10/2046                       | 1 629                               | 1 568                            | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 5,367 % éch. 20/05/2034                     | 35 000                              | 24 249                           | 0,02                      |
| 5,244 % éch. 25/11/2046                       | 1 620                               | 1 426                            | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           | Pepper SPARKZ Trust                         |                                     |                                  |                           |
| 5,595 % éch. 25/03/2034                       | 12                                  | 12                               | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/01/2033                     | 17 777                              | 12 325                           | 0,01                      |
| Warwick Finance Residential Mortgages PLC     |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 21/12/2049 (f)                   | £ 2                                 | 10 561                           | 0,01                      |                                                                |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,698 % éch. 21/12/2049                       | 20 013                              | 26 700                           | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,396 % éch. 21/12/2049                       | 12 810                              | 17 109                           | 0,02                      |                                                                |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Plenti Auto ABS                                           |                                     |                                  |                           | 4,483 % éch. 25/08/2035                                        | \$ 42                               | \$ 42                            | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/08/2036                                 | \$ 3 082                            | \$ 3 091                         | 0,00                      |
| 5,399 % éch. 12/08/2033                                   | AUD 16 677                          | \$ 11 568                        | 0,01                      | 4,513 % éch. 25/03/2035                                        | 5 789                               | 5 181                            | 0,01                      | 4,273 % éch. 25/12/2036                                 | 1 926                               | 1 919                            | 0,00                      |
| Pulse UK PLC                                              |                                     |                                  |                           | 5,488 % éch. 25/10/2034                                        | 1 216                               | 1 353                            | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/09/2036                                 | 1 235                               | 1 155                            | 0,00                      |
| 4,397 % éch. 27/05/2036                                   | £ 20 663                            | 27 436                           | 0,02                      | Ameriquest Mortgage Securities Trust                           |                                     |                                  |                           | 4,283 % éch. 25/02/2037                                 | 1 276                               | 1 265                            | 0,00                      |
| Red & Black Auto Italy SRL                                |                                     |                                  |                           | 3,863 % éch. 25/10/2036                                        | 20 255                              | 6 122                            | 0,01                      | 4,603 % éch. 25/08/2036                                 | 1 127                               | 1 115                            | 0,00                      |
| 3,019 % éch. 28/07/2036                                   | € 28 730                            | 32 986                           | 0,03                      | 3,938 % éch. 25/10/2036                                        | 10 492                              | 5 893                            | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/01/2047                                 | 1 212                               | 1 187                            | 0,00                      |
| Red & Black Auto Lease France                             |                                     |                                  |                           | 4,318 % éch. 25/04/2036                                        | 3 418                               | 3 355                            | 0,00                      | 4,716 % éch. 25/11/2035                                 | 1 449                               | 1 504                            | 0,00                      |
| 2,513 % éch. 27/06/2039                                   | 25 773                              | 29 481                           | 0,02                      | 4,423 % éch. 25/03/2036                                        | 5 671                               | 5 348                            | 0,01                      | 4,738 % éch. 25/11/2034                                 | 204                                 | 204                              | 0,00                      |
| SC Sweden SARL                                            |                                     |                                  |                           | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through |                                     |                                  |                           | 4,768 % éch. 25/06/2035                                 | 583                                 | 576                              | 0,00                      |
| 2,825 % éch. 25/12/2039                                   | 43 500                              | 49 793                           | 0,04                      | Certificates                                                   |                                     |                                  |                           | 4,783 % éch. 25/10/2035                                 | 835                                 | 834                              | 0,00                      |
| VCL Multi-Compartment S.A.                                |                                     |                                  |                           | 2,894 % éch. 25/06/2033                                        | 724                                 | 697                              | 0,00                      | 4,783 % éch. 25/12/2035                                 | 1 483                               | 1 477                            | 0,00                      |
| 2,394 % éch. 21/03/2033                                   | 73 500                              | 84 079                           | 0,07                      | 4,073 % éch. 25/11/2034                                        | 959                                 | 963                              | 0,00                      | 4,813 % éch. 25/08/2037                                 | 8 492                               | 7 711                            | 0,01                      |
| 2,715 % éch. 21/11/2032                                   | 57 185                              | 65 444                           | 0,05                      | 4,113 % éch. 25/06/2034                                        | 1 170                               | 1 106                            | 0,00                      | 4,843 % éch. 25/12/2035                                 | 2 335                               | 2 366                            | 0,00                      |
|                                                           |                                     | 1 692 434                        | 1,36                      | 4,503 % éch. 25/11/2033                                        | 179                                 | 183                              | 0,00                      | 5,158 % éch. 25/01/2035                                 | 353                                 | 357                              | 0,00                      |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES               |                                     |                                  |                           | 4,513 % éch. 25/01/2036                                        | 1 836                               | 1 820                            | 0,00                      | 5,170 % éch. 25/08/2034                                 | 153                                 | 154                              | 0,00                      |
| COMMERCIALES AUTRES                                       |                                     |                                  |                           | 4,633 % éch. 25/11/2035                                        | 4 638                               | 4 447                            | 0,01                      | 5,330 % éch. 25/01/2035                                 | 1 362                               | 1 363                            | 0,00                      |
| ACREC LLC                                                 |                                     |                                  |                           | 4,723 % éch. 25/10/2035                                        | 4 265                               | 4 106                            | 0,01                      | 5,361 % éch. 25/09/2034                                 | 793                                 | 848                              | 0,00                      |
| 4,947 % éch. 18/08/2042                                   | \$ 71 850                           | 71 895                           | 0,06                      | 4,738 % éch. 25/05/2035                                        | 1 361                               | 1 336                            | 0,00                      | 5,424 % éch. 25/12/2034                                 | 1 528                               | 1 534                            | 0,00                      |
| 4,950 % éch. 18/07/2043                                   | 99 000                              | 99 000                           | 0,08                      | 4,738 % éch. 25/07/2035                                        | 7 949                               | 7 738                            | 0,01                      | 5,675 % éch. 25/02/2034                                 | 128                                 | 150                              | 0,00                      |
| 5,087 % éch. 18/08/2044                                   | 500                                 | 501                              | 0,00                      | 4,738 % éch. 25/09/2035                                        | 4 000                               | 3 842                            | 0,00                      | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust            |                                     |                                  |                           |
| BDS LLC                                                   |                                     |                                  |                           | 4,783 % éch. 25/01/2035                                        | 1 430                               | 1 420                            | 0,00                      | 5,763 % éch. 25/03/2037                                 | 1 901                               | 1 860                            | 0,00                      |
| 4,921 % éch. 17/10/2042                                   | 34 900                              | 34 927                           | 0,03                      | 4,813 % éch. 25/05/2035                                        | 2 510                               | 2 371                            | 0,00                      | BNC Mortgage Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| Dwight Issuer LLC                                         |                                     |                                  |                           | 4,858 % éch. 25/09/2034                                        | 3 437                               | 3 252                            | 0,00                      | 3,923 % éch. 25/03/2037                                 | 5 263                               | 5 139                            | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 18/01/2044 (c)                               | 85 000                              | 85 106                           | 0,07                      | 5,323 % éch. 25/01/2035                                        | 1 132                               | 1 092                            | 0,00                      | 4,045 % éch. 25/12/2036                                 | 4 765                               | 3 173                            | 0,00                      |
| Invesco Commercial Real Estate Finance Trust LLC          |                                     |                                  |                           | 5,413 % éch. 25/11/2034                                        | 1 246                               | 1 174                            | 0,00                      | 4,073 % éch. 25/05/2037                                 | 4 460                               | 4 142                            | 0,01                      |
| 5,050 % éch. 19/01/2044                                   | 116 600                             | 116 654                          | 0,09                      | 5,488 % éch. 25/08/2035                                        | 2 000                               | 1 820                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/11/2036                                 | 286                                 | 281                              | 0,00                      |
| 5,120 % éch. 19/12/2043                                   | 88 800                              | 88 908                           | 0,07                      | 5,638 % éch. 25/07/2034                                        | 1 072                               | 1 064                            | 0,00                      | Carrington Mortgage Loan Trust                          |                                     |                                  |                           |
| LRECS LLC                                                 |                                     |                                  |                           | 6,523 % éch. 25/05/2034                                        | 1 323                               | 1 244                            | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/04/2036                                 | 770                                 | 762                              | 0,00                      |
| 5,139 % éch. 19/08/2043                                   | 90 000                              | 90 028                           | 0,07                      | Argent Mortgage Loan Trust                                     |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/02/2037                                 | 10 291                              | 9 884                            | 0,01                      |
|                                                           |                                     | 587 019                          | 0,47                      | 4,243 % éch. 25/05/2035                                        | 5 872                               | 5 456                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/08/2036                                 | 4 453                               | 4 350                            | 0,01                      |
| PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                       |                                     |                                  |                           | Argent Securities Trust                                        |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/10/2036                                 | 4 490                               | 4 421                            | 0,01                      |
| Aames Mortgage Investment Trust                           |                                     |                                  |                           | 3,873 % éch. 25/09/2036                                        | 10 394                              | 3 299                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/01/2036                                 | 529                                 | 520                              | 0,00                      |
| 4,543 % éch. 25/10/2035                                   | 1 502                               | 1 498                            | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/07/2036                                        | 703                                 | 188                              | 0,00                      | 4,513 % éch. 25/10/2035                                 | 4 430                               | 4 389                            | 0,01                      |
| Accredited Mortgage Loan Trust                            |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 25/05/2036                                        | 3 756                               | 883                              | 0,00                      | 4,528 % éch. 25/12/2035                                 | 2 922                               | 2 476                            | 0,00                      |
| 3,983 % éch. 25/02/2037                                   | 535                                 | 533                              | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/09/2036                                        | 9 930                               | 3 152                            | 0,00                      | 4,558 % éch. 25/09/2035                                 | 854                                 | 860                              | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/09/2036                                   | 716                                 | 714                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                                        | 12 965                              | 8 616                            | 0,01                      | 4,753 % éch. 25/06/2035                                 | 2 665                               | 2 681                            | 0,00                      |
| 4,033 % éch. 25/09/2036                                   | 12 825                              | 12 418                           | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                        | 26 326                              | 23 997                           | 0,02                      | 4,813 % éch. 25/05/2035                                 | 2 121                               | 2 070                            | 0,00                      |
| 4,033 % éch. 25/02/2037                                   | 8 675                               | 8 343                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/05/2036                                        | 10 768                              | 2 532                            | 0,00                      | Centex Home Equity Loan Trust                           |                                     |                                  |                           |
| 4,223 % éch. 25/12/2035                                   | 8 114                               | 6 839                            | 0,01                      | 4,113 % éch. 25/04/2036                                        | 1 363                               | 741                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                                 | 602                                 | 597                              | 0,00                      |
| 4,633 % éch. 25/09/2035                                   | 1 943                               | 1 902                            | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/03/2036                                        | 12 889                              | 9 886                            | 0,01                      | 4,453 % éch. 25/03/2035                                 | 79                                  | 79                               | 0,00                      |
| 4,783 % éch. 25/07/2035                                   | 2 047                               | 1 996                            | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/05/2036                                        | 637                                 | 150                              | 0,00                      | 4,513 % éch. 25/01/2035                                 | 981                                 | 979                              | 0,00                      |
| 4,843 % éch. 25/10/2034                                   | 1 347                               | 1 301                            | 0,00                      | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | 4,693 % éch. 25/09/2034                                 | 141                                 | 139                              | 0,00                      |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust               |                                     |                                  |                           | 4,233 % éch. 25/01/2036                                        | 565                                 | 564                              | 0,00                      | 4,723 % éch. 25/03/2035                                 | 1 797                               | 1 790                            | 0,00                      |
| 3,943 % éch. 25/07/2036                                   | 487                                 | 117                              | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/11/2035                                        | 2 987                               | 2 945                            | 0,00                      | 6,060 % éch. 25/09/2034                                 | 142                                 | 143                              | 0,00                      |
| 3,943 % éch. 25/01/2037                                   | 1 578                               | 955                              | 0,00                      | 4,523 % éch. 25/02/2036                                        | 10 868                              | 8 879                            | 0,01                      | CIT Mortgage Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,003 % éch. 25/08/2036                                   | 8 183                               | 1 852                            | 0,00                      | 4,528 % éch. 25/10/2035                                        | 5 611                               | 5 297                            | 0,01                      | 5,263 % éch. 25/10/2037                                 | 40 782                              | 41 205                           | 0,03                      |
| 4,003 % éch. 25/12/2036                                   | 7 177                               | 3 796                            | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/05/2034                                        | 888                                 | 828                              | 0,00                      | 5,513 % éch. 25/10/2037                                 | 10 000                              | 9 871                            | 0,01                      |
| 4,003 % éch. 25/01/2037                                   | 973                                 | 589                              | 0,00                      | 4,888 % éch. 25/11/2034                                        | 397                                 | 399                              | 0,00                      | Citicorp Residential Mortgage Trust                     |                                     |                                  |                           |
| 4,023 % éch. 25/12/2036                                   | 22 253                              | 11 840                           | 0,01                      | Asset-Backed Funding Certificates Trust                        |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 25/09/2036                                 | 1 970                               | 1 841                            | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/07/2036                                   | 3 445                               | 3 145                            | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/01/2037                                        | 432                                 | 310                              | 0,00                      | Citigroup Mortgage Loan Trust                           |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/07/2036                                   | 31 201                              | 10 183                           | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/10/2036                                        | 528                                 | 490                              | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/03/2036                                 | 2 774                               | 2 537                            | 0,00                      |
| 4,073 % éch. 25/08/2036                                   | 2 294                               | 2 233                            | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/11/2036                                        | 8 319                               | 4 948                            | 0,01                      | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/12/2036                                   | 1 457                               | 451                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/05/2037                                        | 1 960                               | 1 801                            | 0,00                      | Certificates                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,103 % éch. 25/11/2036                                   | 16 951                              | 6 887                            | 0,01                      | 4,183 % éch. 25/09/2036                                        | 4 923                               | 4 382                            | 0,01                      | 4,768 % éch. 25/10/2034                                 | 2 426                               | 2 288                            | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/01/2037                                   | 3 188                               | 1 929                            | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/10/2036                                        | 8 585                               | 7 635                            | 0,01                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/02/2037                                   | 5 303                               | 2 175                            | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/03/2035                                        | 1 760                               | 1 739                            | 0,00                      | 3,833 % éch. 25/05/2037                                 | 1 678                               | 1 140                            | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/12/2036                                   | 5 191                               | 1 607                            | 0,00                      | 4,463 % éch. 25/06/2034                                        | 1 849                               | 1 805                            | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/12/2036                                 | 133                                 | 93                               | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/01/2037                                   | 9 936                               | 2 051                            | 0,00                      | 4,543 % éch. 25/11/2033                                        | 201                                 | 200                              | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/05/2037                                 | 3 650                               | 2 485                            | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/04/2036                                   | 5 063                               | 4 637                            | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/02/2034                                        | 76                                  | 77                               | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/03/2037                                 | 5 678                               | 5 193                            | 0,01                      |
| 4,243 % éch. 25/07/2036                                   | 6 706                               | 1 913                            | 0,00                      | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust           |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/07/2045                                 | 3 507                               | 2 544                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/01/2037                                   | 973                                 | 589                              | 0,00                      | 2,779 % éch. 25/07/2036                                        | 480                                 | 433                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/12/2036                                 | 1 685                               | 1 654                            | 0,00                      |
| 4,323 % éch. 25/06/2037                                   | 950                                 | 915                              | 0,00                      | 3,112 % éch. 25/03/2036                                        | 1 249                               | 1 118                            | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/01/2037                                 | 6 930                               | 6 571                            | 0,01                      |
| 4,378 % éch. 25/12/2035                                   | 3 142                               | 2 977                            | 0,00                      | 3,307 % éch. 25/03/2036                                        | 632                                 | 582                              | 0,00                      | 4,053 % éch. 25/09/2036                                 | 3 417                               | 3 345                            | 0,00                      |
| 4,423 % éch. 25/11/2035                                   | 192                                 | 226                              | 0,00                      | 3,576 % éch. 25/12/2036                                        | 936                                 | 912                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/12/2036                                 | 834                                 | 306                              | 0,00                      |
| 4,503 % éch. 25/02/2037                                   | 5 200                               | 2 133                            | 0,00                      | 3,638 % éch. 25/12/2036                                        | 3 368                               | 3 126                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/09/2036                                 | 1 714                               | 1 377                            | 0,00                      |
| 4,543 % éch. 25/04/2034                                   | 673                                 | 633                              | 0,00                      | 4,108 % éch. 25/11/2036                                        | 4 119                               | 4 112                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/12/2036                                 | 15 568                              | 8 702                            | 0,01                      |
| 4,663 % éch. 25/12/2034                                   | 2 437                               | 2 238                            | 0,00                      | 4,573 % éch. 25/06/2034                                        | 626                                 | 664                              | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/03/2037                                 | 1 616                               | 1 419                            | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/08/2035                                   | 2 052                               | 2 023                            | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/11/2035                                        | 3 597                               | 3 510                            | 0,00                      | 4,113 % éch. 25/05/2037                                 | 173                                 | 172                              | 0,00                      |
| 4,708 % éch. 25/05/2035                                   | 2 859                               | 2 670                            | 0,00                      | 4,738 % éch. 25/11/2033                                        | 664                                 | 699                              | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/01/2037                                 | 11 916                              | 8 860                            | 0,01                      |
| 4,738 % éch. 25/11/2033                                   | 476                                 | 492                              | 0,00                      | 4,738 % éch. 25/10/2034                                        | 769                                 | 781                              | 0,00                      | 4,168 % éch. 25/05/2037                                 | 8 204                               | 7 690                            | 0,01                      |
| 4,783 % éch. 25/04/2035                                   | 473                                 | 471                              | 0,00                      | 4,738 % éch. 25/06/2035                                        | 1 791                               | 1 596                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/12/2036                                 | 2 105                               | 2 094                            | 0,00                      |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through |                                     |                                  |                           | 4,783 % éch. 25/07/2035                                        | 1 086                               | 1 069                            | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/08/2036                                 | 3 018                               | 2 833                            | 0,00                      |
| Certificates                                              |                                     |                                  |                           | 5,608 % éch. 25/05/2035                                        | 2 020                               | 1 897                            | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/08/2036                                 | 237                                 | 235                              | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 25/01/2037                                   | 969                                 | 737                              | 0,00                      | Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/05/2037                                 | 896                                 | 894                              | 0,00                      |
| 4,408 % éch. 25/12/2035                                   | 2 917                               | 2 779                            | 0,00                      | 4,637 % éch. 28/04/2036                                        | 625                                 | 624                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/12/2035                                 | 1 163                               | 1 122                            | 0,00                      |
| 4,468 % éch. 25/10/2035                                   | 2 121                               | 2 036                            | 0,00                      | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,393 % éch. 25/02/2035                                 | 1 392                               | 1 325                            | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/06/2035                                   | 2 142                               | 2 090                            | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/11/2036                                        | 168                                 | 167                              | 0,00                      | 4,438 % éch. 25/10/2035                                 | 400                                 | 398                              | 0,00                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/03/2037                                        | 1 435                               | 1 370                            | 0,00                      | 5,443 % éch. 25/07/2035                                 | 2 040                               | 1 787                            | 0,00                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           | 4,113 % éch. 25/06/2047                                        | 4 041                               | 3 762                            | 0,00                      | 7,250 % éch. 25/10/2037                                 | 1 379                               | 1 314                            | 0,00                      |
|                                                           |                                     |                                  |                           | 4,223 % éch. 25/02/2037                                        | 1 213                               | 1 181                            | 0,00                      | 7,275 % éch. 25/10/2036                                 | 842                                 | 488                              | 0,00                      |



# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |                                     |                                  |                           | 5,638 % éch. 25/07/2035                              | \$ 2 026                            | \$ 2 006                         | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/01/2036                       | \$ 591                              | \$ 578                           | 0,00                      |
| 3.107 % éch. 25/04/2036                           | \$ 2 653                            | \$ 2 513                         | 0,00                      | 5,713 % éch. 25/08/2035                              | 2 390                               | 2 244                            | 0,00                      | 4,438 % éch. 25/01/2036                       | 6 546                               | 5 637                            | 0,01                      |
| 3.333 % éch. 25/03/2035                           | 5 370                               | 4 931                            | 0,01                      | 5,805 % éch. 25/04/2036                              | 205                                 | 193                              | 0,00                      | 4,543 % éch. 25/07/2035                       | 1 170                               | 1 135                            | 0,00                      |
| 3.333 % éch. 25/04/2035                           | 148                                 | 147                              | 0,00                      | 5,863 % éch. 25/08/2035                              | 459                                 | 385                              | 0,00                      | 4,633 % éch. 25/05/2034                       | 755                                 | 757                              | 0,00                      |
| 3.903 % éch. 25/08/2037                           | 1 920                               | 1 710                            | 0,00                      | 6,163 % éch. 25/10/2034                              | 534                                 | 529                              | 0,00                      | 4,693 % éch. 25/07/2035                       | 2 103                               | 1 823                            | 0,00                      |
| 3.933 % éch. 25/06/2047                           | 10 498                              | 10 084                           | 0,01                      | Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust         |                                     |                                  |                           | 4,723 % éch. 25/04/2035                       | 1 943                               | 1 727                            | 0,00                      |
| 3.943 % éch. 25/06/2047                           | 176                                 | 167                              | 0,00                      | 3,940 % éch. 15/05/2036                              | 403                                 | 393                              | 0,00                      | 4,783 % éch. 25/01/2035                       | 2 567                               | 2 346                            | 0,00                      |
| 3.953 % éch. 25/11/2037                           | 6 603                               | 6 284                            | 0,01                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/11/2034                       | 1 112                               | 1 082                            | 0,00                      |
| 3.963 % éch. 25/06/2047                           | 8 405                               | 7 415                            | 0,01                      | 5,113 % éch. 25/05/2044                              | 14                                  | 14                               | 0,00                      | 4,828 % éch. 25/06/2035                       | 1 847                               | 1 830                            | 0,00                      |
| 3.983 % éch. 25/08/2037                           | 13 413                              | 12 213                           | 0,01                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC    |                                     |                                  |                           | GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 4,013 % éch. 25/06/2047                           | 4 652                               | 4 476                            | 0,01                      | 2,587 % éch. 25/04/2037                              | 11 242                              | 5 101                            | 0,01                      | 4,403 % éch. 25/12/2035                       | 1 234                               | 1 200                            | 0,00                      |
| 4,014 % éch. 25/01/2037                           | 2 360                               | 2 344                            | 0,00                      | 2,955 % éch. 25/05/2036                              | 2 603                               | 1 808                            | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/10/2035                       | 272                                 | 271                              | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/12/2036                           | 5 508                               | 5 170                            | 0,01                      | 2,965 % éch. 25/08/2035                              | 1 131                               | 1 082                            | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/12/2035                       | 1 730                               | 1 417                            | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/04/2046                           | 642                                 | 607                              | 0,00                      | 3,066 % éch. 25/03/2034                              | 200                                 | 231                              | 0,00                      | GE-WMC Mortgage Securities Trust              |                                     |                                  |                           |
| 4,023 % éch. 25/06/2047                           | 7 852                               | 6 516                            | 0,01                      | 3,155 % éch. 25/07/2036                              | 2 226                               | 2 121                            | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/08/2036                       | 4 414                               | 4 126                            | 0,01                      |
| 4,038 % éch. 25/01/2035                           | 2 085                               | 1 695                            | 0,00                      | 3,253 % éch. 25/03/2037                              | 837                                 | 297                              | 0,00                      | GSAA Home Equity Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/06/2035                           | 10 269                              | 9 331                            | 0,01                      | 3,396 % éch. 25/04/2037                              | 5 575                               | 3 781                            | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/09/2036                       | 3 776                               | 789                              | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/02/2037                           | 249                                 | 240                              | 0,00                      | 3,431 % éch. 25/02/2037                              | 1 887                               | 1 068                            | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/12/2046                       | 2 002                               | 963                              | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/03/2037                           | 1 740                               | 1 622                            | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/11/2036                              | 8 807                               | 4 060                            | 0,01                      | 3,883 % éch. 25/05/2036                       | 6 521                               | 1 271                            | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/05/2037                           | 3 902                               | 3 686                            | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/06/2036                              | 1 510                               | 1 030                            | 0,00                      | 3,883 % éch. 25/11/2036                       | 4 766                               | 1 091                            | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/06/2037                           | 9 338                               | 8 733                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/10/2036                              | 2 200                               | 1 883                            | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/03/2036                       | 1 323                               | 412                              | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/07/2037                           | 2 556                               | 2 350                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/11/2036                              | 1 965                               | 906                              | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/12/2046                       | 9 909                               | 2 724                            | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/04/2047                           | 1 175                               | 1 146                            | 0,00                      | 4,068 % éch. 25/12/2037                              | 95                                  | 189                              | 0,00                      | 3,923 % éch. 25/02/2037                       | 5 482                               | 1 474                            | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/06/2047                           | 1 937                               | 1 798                            | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/04/2037                              | 2 797                               | 1 659                            | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/07/2036                       | 1 323                               | 235                              | 0,00                      |
| 4,098 % éch. 25/11/2034                           | 4 041                               | 3 988                            | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/11/2036                              | 4 964                               | 2 288                            | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/03/2037                       | 8 357                               | 2 222                            | 0,00                      |
| 4,132 % éch. 25/01/2037                           | 13 000                              | 12 320                           | 0,01                      | 4,243 % éch. 25/10/2036                              | 7 933                               | 5 417                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/06/2036                       | 4 027                               | 701                              | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/05/2047                           | 4 914                               | 4 862                            | 0,01                      | 7,138 % éch. 25/01/2033                              | 169                                 | 165                              | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/09/2036                       | 5 139                               | 1 074                            | 0,00                      |
| 4,198 % éch. 25/01/2045                           | 1 990                               | 1 898                            | 0,00                      | CSAB Mortgage-Backed Trust                           |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/03/2047                       | 17 963                              | 4 563                            | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/05/2037                           | 2 987                               | 2 894                            | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/11/2036                              | 7 472                               | 800                              | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/03/2036                       | 10 517                              | 3 284                            | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/06/2037                           | 235                                 | 230                              | 0,00                      | 5,858 % éch. 25/05/2037                              | 4 935                               | 1 033                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/12/2036                       | 12 222                              | 3 080                            | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/09/2037                           | 5 389                               | 5 874                            | 0,01                      | 5,898 % éch. 25/05/2037                              | 741                                 | 155                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/03/2036                       | 7 448                               | 2 370                            | 0,00                      |
| 4,203 % éch. 25/06/2047                           | 15 584                              | 14 799                           | 0,01                      | 6,580 % éch. 25/09/2036                              | 1 905                               | 547                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/11/2036                       | 6 807                               | 2 090                            | 0,00                      |
| 4,210 % éch. 25/10/2046                           | 3 006                               | 3 114                            | 0,00                      | Ellington Loan Acquisition Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/12/2035                       | 3 343                               | 1 759                            | 0,00                      |
| 4,223 % éch. 25/05/2037                           | 9 518                               | 8 929                            | 0,01                      | 4,813 % éch. 25/05/2037                              | 6 215                               | 6 112                            | 0,01                      | 4,363 % éch. 25/03/2036                       | 2 815                               | 1 328                            | 0,00                      |
| 4,223 % éch. 25/07/2037                           | 14 616                              | 13 032                           | 0,01                      | 4,863 % éch. 25/05/2037                              | 4 734                               | 4 627                            | 0,01                      | 4,363 % éch. 25/03/2037                       | 162                                 | 64                               | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/02/2037                           | 5 012                               | 4 887                            | 0,01                      | 5,263 % éch. 25/05/2037                              | 584                                 | 579                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/05/2047                       | 88                                  | 55                               | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/03/2037                           | 7 219                               | 6 984                            | 0,01                      | Encore Credit Receivables Trust                      |                                     |                                  |                           | 4,483 % éch. 25/10/2035                       | 1 667                               | 1 606                            | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/04/2037                           | 558                                 | 501                              | 0,00                      | 4,498 % éch. 25/07/2035                              | 887                                 | 845                              | 0,00                      | 4,498 % éch. 25/06/2035                       | 1 549                               | 1 548                            | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/03/2047                           | 4 675                               | 4 487                            | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/01/2036                              | 499                                 | 489                              | 0,00                      | 4,523 % éch. 25/01/2036                       | 465                                 | 34                               | 0,00                      |
| 4,258 % éch. 25/03/2037                           | 3 839                               | 4 618                            | 0,01                      | 4,693 % éch. 25/11/2035                              | 3 589                               | 3 455                            | 0,00                      | 4,708 % éch. 25/08/2035                       | 1 404                               | 1 381                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/10/2034                           | 2 959                               | 2 908                            | 0,00                      | 4,738 % éch. 25/01/2036                              | 3 512                               | 3 238                            | 0,00                      | 5,558 % éch. 25/05/2035                       | 205                                 | 195                              | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/01/2046                           | 8 321                               | 7 927                            | 0,01                      | 4,783 % éch. 25/07/2035                              | 2 138                               | 1 942                            | 0,00                      | 5,676 % éch. 25/09/2035                       | 2 636                               | 1 669                            | 0,00                      |
| 4,263 % éch. 25/04/2046                           | 3 391                               | 3 313                            | 0,00                      | EquiFirst Loan Securitization Trust                  |                                     |                                  |                           | 5,788 % éch. 25/05/2037                       | 5 193                               | 2 247                            | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/09/2046                           | 15 027                              | 14 402                           | 0,01                      | 4,103 % éch. 25/04/2037                              | 1 134                               | 1 059                            | 0,00                      | 5,917 % éch. 25/03/2037                       | 2 234                               | 392                              | 0,00                      |
| 4,288 % éch. 25/08/2036                           | 2 335                               | 2 299                            | 0,00                      | EquiFirst Mortgage Loan Trust                        |                                     |                                  |                           | 6,032 % éch. 25/05/2037                       | 4 048                               | 1 752                            | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/12/2034                           | 3 478                               | 3 414                            | 0,00                      | 4,768 % éch. 25/04/2035                              | 132                                 | 133                              | 0,00                      | 6,300 % éch. 25/03/2037                       | 5 378                               | 1 155                            | 0,00                      |
| 4,318 % éch. 25/07/2036                           | 2 908                               | 2 788                            | 0,00                      | 5,563 % éch. 25/04/2035                              | 1 091                               | 1 004                            | 0,00                      | 6,376 % éch. 25/09/2036                       | 657                                 | 164                              | 0,00                      |
| 4,348 % éch. 25/04/2036                           | 1 000                               | 961                              | 0,00                      | 6,388 % éch. 25/12/2034                              | 657                                 | 588                              | 0,00                      | 6,459 % éch. 25/09/2036                       | 4 397                               | 1 095                            | 0,00                      |
| 4,348 % éch. 25/06/2036                           | 2 784                               | 2 722                            | 0,00                      | 7,138 % éch. 25/10/2034                              | 684                                 | 673                              | 0,00                      | 6,483 % éch. 25/03/2037                       | 4 961                               | 1 318                            | 0,00                      |
| 4,357 % éch. 25/07/2036                           | 3 649                               | 3 463                            | 0,00                      | Equity One Mortgage Pass-Through Trust               |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/10/2037                       | 1 081                               | 573                              | 0,00                      |
| 4,453 % éch. 25/04/2036                           | 8 975                               | 8 824                            | 0,01                      | 3,689 % éch. 25/07/2034                              | 606                                 | 516                              | 0,00                      | 6,599 % éch. 25/03/2037                       | 1 991                               | 426                              | 0,00                      |
| 4,463 % éch. 25/03/2036                           | 4 446                               | 4 063                            | 0,01                      | FBR Securitization Trust                             |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,468 % éch. 25/09/2035                           | 1 064                               | 1 043                            | 0,00                      | 4,498 % éch. 25/11/2035                              | 11 731                              | 11 105                           | 0,01                      | 3,863 % éch. 25/12/2046                       | 267                                 | 132                              | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/08/2035                           | 1 794                               | 1 664                            | 0,00                      | Fieldstone Mortgage Investment Trust                 |                                     |                                  |                           | 3,923 % éch. 25/08/2036                       | 1 777                               | 1 546                            | 0,00                      |
| 4,483 % éch. 25/05/2036                           | 1 553                               | 1 552                            | 0,00                      | 3,939 % éch. 25/11/2036                              | 2 900                               | 1 923                            | 0,00                      | 3,923 % éch. 25/01/2037                       | 13 192                              | 8 115                            | 0,01                      |
| 4,503 % éch. 25/12/2034                           | 94                                  | 93                               | 0,00                      | 3,979 % éch. 25/11/2036                              | 3 808                               | 3 542                            | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/12/2046                       | 17 363                              | 8 574                            | 0,01                      |
| 4,503 % éch. 25/08/2047                           | 8 564                               | 8 389                            | 0,01                      | 4,143 % éch. 25/05/2036                              | 7 403                               | 5 658                            | 0,01                      | 4,003 % éch. 25/09/2036                       | 16 356                              | 5 572                            | 0,01                      |
| 4,513 % éch. 25/03/2034                           | 1 367                               | 1 440                            | 0,00                      | 4,179 % éch. 25/11/2036                              | 2 318                               | 1 537                            | 0,00                      | 4,003 % éch. 25/12/2036                       | 4 286                               | 2 114                            | 0,00                      |
| 4,558 % éch. 25/05/2036                           | 14 800                              | 14 648                           | 0,01                      | 4,408 % éch. 25/02/2036                              | 8 886                               | 7 972                            | 0,01                      | 4,023 % éch. 25/12/2046                       | 4 597                               | 2 417                            | 0,00                      |
| 4,603 % éch. 25/10/2047                           | 651                                 | 636                              | 0,00                      | Finance America Mortgage Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/06/2036                       | 561                                 | 555                              | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/02/2036                           | 3 002                               | 2 941                            | 0,00                      | 4,708 % éch. 25/11/2034                              | 370                                 | 361                              | 0,00                      | 4,043 % éch. 25/11/2036                       | 4 202                               | 1 903                            | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/05/2036                           | 48                                  | 47                               | 0,00                      | 4,783 % éch. 25/11/2034                              | 266                                 | 250                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                       | 5 186                               | 2 874                            | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/03/2047                           | 1 155                               | 910                              | 0,00                      | First NLC Trust                                      |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/12/2036                       | 620                                 | 617                              | 0,00                      |
| 4,738 % éch. 25/01/2036                           | 3 889                               | 3 839                            | 0,00                      | 3,833 % éch. 25/08/2037                              | 5 365                               | 2 662                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/12/2046                       | 404                                 | 200                              | 0,00                      |
| 4,753 % éch. 25/02/2036                           | 2 600                               | 2 368                            | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/08/2037                              | 161                                 | 80                               | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/04/2036                       | 4 040                               | 2 642                            | 0,00                      |
| 4,828 % éch. 25/10/2035                           | 6 134                               | 5 995                            | 0,01                      | 3,943 % éch. 25/08/2037                              | 2 910                               | 1 444                            | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/12/2036                       | 6 274                               | 3 094                            | 0,00                      |
| 4,843 % éch. 25/05/2036                           | 11 717                              | 10 372                           | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/08/2037                              | 40                                  | 20                               | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/01/2037                       | 2 022                               | 1 990                            | 0,00                      |
| 4,858 % éch. 25/04/2036                           | 6 800                               | 6 618                            | 0,01                      | 4,498 % éch. 25/02/2036                              | 3 497                               | 3 208                            | 0,00                      | 4,138 % éch. 25/10/2046                       | 1 026                               | 3 562                            | 0,00                      |
| 4,888 % éch. 25/11/2035                           | 962                                 | 954                              | 0,00                      | Fremont Home Loan Trust                              |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/11/2036                       | 1 026                               | 467                              | 0,00                      |
| 4,903 % éch. 25/01/2036                           | 2                                   |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |                                               |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,738 % éch. 25/04/2035                      | \$ 1 397                            | \$ 1 307                         | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/07/2036                          | \$ 5 826                            | \$ 2 342                         | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/01/2037                | \$ 4 074                            | \$ 3 779                         | 0,00                      |
| 7,138 % éch. 25/02/2037                      | 1 500                               | 1 477                            | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/11/2036                          | 304                                 | 88                               | 0,00                      | 4,403 % éch. 25/03/2037                | 7 146                               | 6 746                            | 0,01                      |
| Home Equity Asset Trust                      |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/08/2036                          | 17 430                              | 6 948                            | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/02/2047                | 177                                 | 102                              | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/11/2036                      | 191                                 | 190                              | 0,00                      | 4,053 % éch. 25/07/2036                          | 6 233                               | 4 390                            | 0,01                      | 4,693 % éch. 25/07/2035                | 2 257                               | 2 266                            | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/10/2036                      | 3 302                               | 2 169                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/05/2036                          | 8 528                               | 4 443                            | 0,01                      | 4,738 % éch. 25/04/2036                | 87                                  | 87                               | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/07/2036                      | 3 074                               | 2 941                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                          | 2 266                               | 913                              | 0,00                      | 4,768 % éch. 25/06/2036                | 2 500                               | 2 082                            | 0,00                      |
| 4,423 % éch. 25/04/2036                      | 2 532                               | 2 483                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/09/2036                          | 642                                 | 411                              | 0,00                      | 4,843 % éch. 25/10/2035                | 17                                  | 17                               | 0,00                      |
| 4,438 % éch. 25/02/2036                      | 1 679                               | 1 647                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/11/2036                          | 12 223                              | 8 491                            | 0,01                      | 4,888 % éch. 25/08/2036                | 319                                 | 486                              | 0,00                      |
| 4,468 % éch. 25/01/2036                      | 1 808                               | 1 737                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/05/2036                          | 10 666                              | 3 031                            | 0,00                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust |                                     |                                  |                           |
| 4,603 % éch. 25/01/2035                      | 442                                 | 440                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/08/2036                          | 2 214                               | 882                              | 0,00                      | 3,546 % éch. 25/01/2035                | 1 449                               | 1 349                            | 0,00                      |
| 4,618 % éch. 25/08/2034                      | 46                                  | 46                               | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/09/2036                          | 8 887                               | 2 126                            | 0,00                      | 3,833 % éch. 25/10/2036                | 2 546                               | 1 320                            | 0,00                      |
| 4,708 % éch. 25/11/2035                      | 380                                 | 373                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/10/2036                          | 26 886                              | 8 325                            | 0,01                      | 3,843 % éch. 25/11/2036                | 4 505                               | 2 497                            | 0,00                      |
| 4,708 % éch. 25/12/2035                      | 620                                 | 608                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/12/2036                          | 19 485                              | 13 206                           | 0,01                      | 3,853 % éch. 25/01/2037                | 14 300                              | 6 530                            | 0,01                      |
| 5,008 % éch. 25/05/2035                      | 1 048                               | 1 072                            | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/05/2046                          | 9 006                               | 8 507                            | 0,01                      | 3,863 % éch. 25/07/2036                | 5 949                               | 2 110                            | 0,00                      |
| 5,263 % éch. 25/03/2035                      | 867                                 | 850                              | 0,00                      | 4,103 % éch. 25/12/2036                          | 79                                  | 27                               | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/10/2036                | 1 229                               | 532                              | 0,00                      |
| 5,413 % éch. 25/12/2034                      | 575                                 | 574                              | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/03/2046                          | 15 316                              | 13 520                           | 0,01                      | 3,863 % éch. 25/11/2036                | 4 182                               | 2 324                            | 0,00                      |
| 5,463 % éch. 25/11/2034                      | 246                                 | 245                              | 0,00                      | 4,143 % éch. 25/03/2046                          | 2 506                               | 804                              | 0,00                      | 3,873 % éch. 25/10/2036                | 5 592                               | 2 900                            | 0,00                      |
| 5,513 % éch. 25/11/2034                      | 221                                 | 221                              | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/12/2036                          | 1 312                               | 450                              | 0,00                      | 3,873 % éch. 25/12/2036                | 3 173                               | 1 586                            | 0,00                      |
| Home Equity Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/08/2036                          | 2 729                               | 1 088                            | 0,00                      | 3,873 % éch. 25/02/2037                | 3 058                               | 950                              | 0,00                      |
| 3,993 % éch. 25/04/2037                      | 203                                 | 199                              | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/08/2045                          | 387                                 | 377                              | 0,00                      | 3,873 % éch. 25/03/2037                | 385                                 | 155                              | 0,00                      |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust |                                     |                                  |                           | 4,323 % éch. 25/10/2034                          | 3 587                               | 3 516                            | 0,00                      | 3,893 % éch. 25/01/2037                | 87                                  | 40                               | 0,00                      |
| 3,903 % éch. 25/11/2036                      | 3 770                               | 3 485                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/01/2036                          | 10 739                              | 9 716                            | 0,01                      | 3,893 % éch. 25/02/2037                | 37                                  | 33                               | 0,00                      |
| 3,923 % éch. 25/11/2036                      | 2 489                               | 2 324                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/02/2036                          | 8 979                               | 8 067                            | 0,01                      | 3,903 % éch. 25/10/2036                | 15 496                              | 6 709                            | 0,01                      |
| 3,953 % éch. 25/04/2037                      | 8 004                               | 5 425                            | 0,01                      | 4,543 % éch. 25/08/2035                          | 3 859                               | 3 827                            | 0,00                      | 3,903 % éch. 25/05/2037                | 19 238                              | 16 217                           | 0,01                      |
| 4,003 % éch. 25/11/2036                      | 602                                 | 503                              | 0,00                      | 4,558 % éch. 25/06/2034                          | 826                                 | 814                              | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/11/2036                | 6 120                               | 3 410                            | 0,00                      |
| 4,003 % éch. 25/04/2037                      | 13 973                              | 9 616                            | 0,01                      | 4,813 % éch. 25/06/2035                          | 3 520                               | 3 446                            | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/12/2036                | 9 380                               | 4 690                            | 0,01                      |
| 4,103 % éch. 25/04/2037                      | 8 385                               | 5 914                            | 0,01                      | 4,888 % éch. 25/04/2035                          | 2 471                               | 2 395                            | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/02/2037                | 2 971                               | 1 298                            | 0,00                      |
| 4,123 % éch. 25/06/2036                      | 1 075                               | 1 052                            | 0,00                      | 4,913 % éch. 25/09/2034                          | 504                                 | 512                              | 0,00                      | 3,923 % éch. 25/09/2036                | 456                                 | 190                              | 0,00                      |
| 4,143 % éch. 25/07/2037                      | 7 190                               | 2 800                            | 0,00                      | 5,188 % éch. 25/02/2035                          | 3 929                               | 3 662                            | 0,00                      | 3,943 % éch. 25/02/2037                | 2 125                               | 660                              | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/07/2037                      | 8 019                               | 4 425                            | 0,01                      | MASTR Asset-Backed Securities Trust              |                                     |                                  |                           | 3,963 % éch. 25/05/2037                | 6 000                               | 3 337                            | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/04/2037                      | 1 019                               | 719                              | 0,00                      | 3,863 % éch. 25/10/2036                          | 4 836                               | 1 524                            | 0,00                      | 3,973 % éch. 25/01/2037                | 4 558                               | 2 082                            | 0,00                      |
| 4,243 % éch. 25/08/2036                      | 4 573                               | 4 183                            | 0,01                      | 3,863 % éch. 25/11/2036                          | 816                                 | 227                              | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/07/2036                | 6 228                               | 5 634                            | 0,01                      |
| 4,423 % éch. 25/03/2036                      | 4 254                               | 3 947                            | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/08/2036                          | 7 846                               | 2 662                            | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/12/2036                | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 4,828 % éch. 25/08/2035                      | 1 800                               | 1 764                            | 0,00                      | 3,963 % éch. 25/10/2036                          | 4 764                               | 2 235                            | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/03/2037                | 4 791                               | 1 929                            | 0,00                      |
| 5,008 % éch. 25/03/2035                      | 992                                 | 984                              | 0,00                      | 3,983 % éch. 25/11/2036                          | 6 372                               | 1 772                            | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/02/2037                | 516                                 | 226                              | 0,00                      |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust         |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/10/2036                          | 452                                 | 195                              | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                | 3 189                               | 1 556                            | 0,00                      |
| 3,913 % éch. 25/12/2036                      | 1 043                               | 946                              | 0,00                      | 4,033 % éch. 25/08/2036                          | 6 928                               | 2 504                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                | 3 149                               | 1 122                            | 0,00                      |
| 3,983 % éch. 25/12/2036                      | 9 539                               | 4 173                            | 0,01                      | 4,053 % éch. 25/01/2037                          | 20 378                              | 5 125                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/09/2036                | 3 660                               | 1 524                            | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/10/2036                      | 16 729                              | 5 694                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/04/2036                          | 3 968                               | 775                              | 0,00                      | 4,093 % éch. 25/02/2037                | 7 765                               | 3 393                            | 0,00                      |
| 4,138 % éch. 25/05/2037                      | 2 327                               | 2 329                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/06/2036                          | 3 215                               | 1 036                            | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/06/2036                | 18 255                              | 12 362                           | 0,01                      |
| 4,143 % éch. 25/01/2037                      | 11 724                              | 8 097                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/08/2036                          | 12 687                              | 4 076                            | 0,01                      | 4,243 % éch. 25/09/2036                | 22 943                              | 7 705                            | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/12/2036                      | 11 257                              | 2 714                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/10/2036                          | 6 387                               | 2 019                            | 0,00                      | 4,258 % éch. 25/03/2036                | 4 177                               | 3 597                            | 0,00                      |
| 4,283 % éch. 25/04/2037                      | 10 634                              | 5 248                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/10/2036                          | 6 237                               | 2 926                            | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/04/2036                | 6 704                               | 6 475                            | 0,01                      |
| 4,288 % éch. 25/02/2036                      | 3 065                               | 2 659                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/05/2037                          | 3 203                               | 3 127                            | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/07/2036                | 1 495                               | 534                              | 0,00                      |
| 4,348 % éch. 25/12/2035                      | 2 796                               | 2 694                            | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/11/2036                          | 8 905                               | 5 201                            | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/02/2036                | 3 576                               | 3 656                            | 0,00                      |
| 4,378 % éch. 25/01/2036                      | 7 490                               | 7 209                            | 0,01                      | 4,243 % éch. 25/03/2036                          | 2 526                               | 1 468                            | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/03/2036                | 7 502                               | 6 253                            | 0,01                      |
| IXIS Real Estate Capital Trust               |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/06/2036                          | 192                                 | 62                               | 0,00                      | 4,318 % éch. 25/01/2036                | 2 869                               | 2 460                            | 0,00                      |
| 3,823 % éch. 25/05/2037                      | 19 786                              | 3 953                            | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/08/2036                          | 3 804                               | 1 304                            | 0,00                      | 4,333 % éch. 25/12/2035                | 4 481                               | 3 968                            | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/01/2037                      | 13 727                              | 4 310                            | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/11/2035                          | 2 082                               | 1 152                            | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/01/2036                | 1 596                               | 1 558                            | 0,00                      |
| 4,083 % éch. 25/08/2036                      | 3 370                               | 905                              | 0,00                      | 4,333 % éch. 25/01/2036                          | 952                                 | 958                              | 0,00                      | 4,343 % éch. 25/02/2036                | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 4,163 % éch. 25/03/2036                      | 1 228                               | 636                              | 0,00                      | 4,463 % éch. 25/09/2034                          | 1 592                               | 1 453                            | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/12/2035                | 3 043                               | 2 881                            | 0,00                      |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.          |                                     |                                  |                           | 4,513 % éch. 25/10/2035                          | 3 798                               | 3 913                            | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/01/2035                | 2 031                               | 2 061                            | 0,00                      |
| 2,750 % éch. 25/10/2035                      | 3 879                               | 3 511                            | 0,00                      | 4,543 % éch. 25/02/2034                          | 63                                  | 68                               | 0,00                      | 4,423 % éch. 25/11/2035                | 4 690                               | 4 540                            | 0,01                      |
| 4,273 % éch. 25/02/2036                      | 907                                 | 898                              | 0,00                      | 4,588 % éch. 25/10/2034                          | 152                                 | 151                              | 0,00                      | 4,438 % éch. 25/12/2034                | 166                                 | 165                              | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/02/2036                      | 2 711                               | 2 493                            | 0,00                      | 4,768 % éch. 25/03/2035                          | 1 381                               | 1 399                            | 0,00                      | 4,438 % éch. 25/09/2035                | 2 942                               | 2 815                            | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/03/2036                      | 4 925                               | 4 612                            | 0,01                      | 4,913 % éch. 25/08/2037                          | 5 199                               | 4 612                            | 0,01                      | 4,468 % éch. 25/12/2034                | 322                                 | 323                              | 0,00                      |
| 4,348 % éch. 25/05/2035                      | 335                                 | 333                              | 0,00                      | 4,588 % éch. 25/06/2035                          | 100                                 | 100                              | 0,00                      | 4,503 % éch. 25/01/2034                | 1 050                               | 1 069                            | 0,00                      |
| 4,393 % éch. 25/05/2035                      | 5 614                               | 5 209                            | 0,01                      | 6,250 % éch. 25/11/2035                          | 1 512                               | 604                              | 0,00                      | 4,588 % éch. 25/08/2034                | 403                                 | 397                              | 0,00                      |
| 4,468 % éch. 25/09/2035                      | 222                                 | 224                              | 0,00                      | 6,298 % éch. 25/06/2035                          | 673                                 | 737                              | 0,00                      | 4,663 % éch. 25/05/2034                | 1 013                               | 1 085                            | 0,00                      |
| 4,513 % éch. 25/06/2035                      | 1 033                               | 1 029                            | 0,00                      | MASTR Specialized Loan Trust                     |                                     |                                  |                           | 4,663 % éch. 25/08/2034                | 818                                 | 868                              | 0,00                      |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust          |                                     |                                  |                           | 4,283 % éch. 25/06/2046                          | 882                                 | 854                              | 0,00                      | 4,678 % éch. 25/07/2034                | 408                                 | 417                              | 0,00                      |
| 3,923 % éch. 25/12/2036                      | 2 750                               | 1 400                            | 0,00                      | 4,503 % éch. 25/01/2037                          | 3 326                               | 1 283                            | 0,00                      | 4,693 % éch. 25/11/2034                | 70                                  | 69                               | 0,00                      |
| 3,943 % éch. 25/07/2036                      | 455                                 | 214                              | 0,00                      | 6,763 % éch. 25/07/2035                          | 234                                 | 260                              | 0,00                      | 4,693 % éch. 25/02/2035                | 2 224                               | 2 075                            | 0,00                      |
| 3,993 % éch. 25/05/2037                      | 1 802                               | 1 772                            | 0,00                      | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           | 4,693 % éch. 25/07/2035                | 814                                 | 803                              | 0,00                      |
| 4,033 % éch. 25/08/2036                      | 5 971                               | 5 655                            | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/04/2037                          | 3 626                               | 1 522                            | 0,00                      | 4,708 % éch. 25/01/2035                | 1 778                               | 1 623                            | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/12/2036                      | 5 023                               | 2 555                            | 0,00                      | 4,123 % éch. 25/06/2037                          | 385                                 | 387                              | 0,00                      | 4,723 % éch. 25/03/2035                | 788                                 | 751                              | 0,00                      |
| 4,063 % éch. 25/03/20                        |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |



# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through |                                     |                                  |                           | 4.203 % éch. 25/01/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.923 % éch. 25/11/2036                              | \$ 1 297                            | \$ 352                           | 0,00                      | Certificates                                             |                                     |                                  |                           | 4.273 % éch. 25/04/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.103 % éch. 25/10/2036                              | 7 477                               | 2 056                            | 0,00                      | 4.393 % éch. 25/12/2035                                  | \$ 117                              | \$ 114                           | 0,00                      | 4.303 % éch. 25/07/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.103 % éch. 25/11/2036                              | 4 220                               | 1 145                            | 0,00                      | 4.453 % éch. 25/11/2035                                  | 1 437                               | 1 395                            | 0,00                      | 4.323 % éch. 25/04/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.103 % éch. 25/01/2047                              | 3 453                               | 982                              | 0,00                      | 4.498 % éch. 25/11/2035                                  | 1 250                               | 1 110                            | 0,00                      | 4.363 % éch. 25/02/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.303 % éch. 25/04/2037                              | 14 368                              | 4 911                            | 0,01                      | Ownit Mortgage Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | 4.378 % éch. 25/11/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.363 % éch. 25/02/2037                              | 3 496                               | 1 981                            | 0,00                      | 3.148 % éch. 25/12/2035                                  | 1 428                               | 782                              | 0,00                      | 4.393 % éch. 25/02/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.077 % éch. 25/10/2046                              | 4 049                               | 905                              | 0,00                      | 3.983 % éch. 25/07/2037                                  | 956                                 | 891                              | 0,00                      | 4.423 % éch. 25/12/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.263 % éch. 25/01/2047                              | 1 144                               | 319                              | 0,00                      | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through    |                                     |                                  |                           | 4.443 % éch. 25/04/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.298 % éch. 25/10/2036                              | 8 269                               | 1 749                            | 0,00                      | Certificates                                             |                                     |                                  |                           | 4.443 % éch. 25/05/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.326 % éch. 25/09/2046                              | 10 812                              | 2 171                            | 0,00                      | 4.498 % éch. 25/08/2035                                  | 2 469                               | 2 478                            | 0,00                      | 4.468 % éch. 25/09/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.488 % éch. 25/11/2036                              | 6 103                               | 1 264                            | 0,00                      | 4.498 % éch. 25/09/2035                                  | 4 722                               | 4 653                            | 0,01                      | 4.468 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.592 % éch. 25/10/2036                              | 1 650                               | 484                              | 0,00                      | 4.708 % éch. 25/09/2035                                  | 2 506                               | 2 263                            | 0,00                      | 4.483 % éch. 25/01/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| Nationstar Home Equity Loan Trust                    |                                     |                                  |                           | 4.738 % éch. 25/07/2035                                  | 5 600                               | 4 931                            | 0,01                      | 4.513 % éch. 25/04/2034                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.113 % éch. 25/06/2037                              | 2 287                               | 2 256                            | 0,00                      | 4.768 % éch. 25/06/2035                                  | 1 409                               | 1 384                            | 0,00                      | 4.543 % éch. 25/06/2034                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.403 % éch. 25/04/2037                              | 2 806                               | 2 795                            | 0,00                      | 4.798 % éch. 25/05/2035                                  | 3 000                               | 2 504                            | 0,00                      | 4.633 % éch. 25/11/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| New Century Home Equity Loan Trust                   |                                     |                                  |                           | 4.813 % éch. 25/06/2035                                  | 1 992                               | 1 791                            | 0,00                      | 4.723 % éch. 25/08/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.083 % éch. 25/08/2036                              | 2 859                               | 2 817                            | 0,00                      | 4.888 % éch. 25/03/2035                                  | 124                                 | 123                              | 0,00                      | 4.798 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.123 % éch. 25/05/2036                              | 517                                 | 517                              | 0,00                      | 5.083 % éch. 25/01/2036                                  | 4 482                               | 4 317                            | 0,01                      | 5.008 % éch. 25/03/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.408 % éch. 25/12/2035                              | 4 820                               | 4 650                            | 0,01                      | 5.338 % éch. 25/02/2035                                  | 3 707                               | 3 675                            | 0,00                      | 5.563 % éch. 25/04/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.483 % éch. 25/03/2035                              | 2 052                               | 2 079                            | 0,00                      | 5.533 % éch. 25/10/2034                                  | 4 239                               | 4 040                            | 0,00                      | 5.713 % éch. 25/11/2034                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.498 % éch. 25/10/2035                              | 6 885                               | 6 084                            | 0,01                      | 5.563 % éch. 25/12/2034                                  | 4 761                               | 4 751                            | 0,01                      | Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| 4.503 % éch. 25/08/2034                              | 1 093                               | 1 071                            | 0,00                      | 5.638 % éch. 25/10/2034                                  | 1 300                               | 1 147                            | 0,00                      | 5.400 % éch. 25/12/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.528 % éch. 25/02/2035                              | 2 769                               | 2 735                            | 0,00                      | 5.638 % éch. 25/12/2034                                  | 4 436                               | 4 239                            | 0,01                      | Saxon Asset Securities Trust                                   |                                     |                                  |                           |
| 4.648 % éch. 25/08/2034                              | 272                                 | 303                              | 0,00                      | 5.863 % éch. 25/09/2034                                  | 107                                 | 97                               | 0,00                      | 1.388 % éch. 25/11/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.693 % éch. 25/11/2034                              | 2 145                               | 2 145                            | 0,00                      | People's Choice Home Loan Securities Trust               |                                     |                                  |                           | 1.661 % éch. 25/05/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.708 % éch. 25/09/2035                              | 4 020                               | 4 015                            | 0,00                      | 4.708 % éch. 25/05/2035                                  | 207                                 | 201                              | 0,00                      | 3.943 % éch. 25/05/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.738 % éch. 25/06/2035                              | 3 688                               | 3 645                            | 0,00                      | 4.738 % éch. 25/05/2035                                  | 7 624                               | 5 611                            | 0,01                      | 3.963 % éch. 25/05/2047                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.768 % éch. 25/07/2035                              | 4 652                               | 4 655                            | 0,01                      | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust      |                                     |                                  |                           | 4.073 % éch. 25/09/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.828 % éch. 25/03/2035                              | 342                                 | 341                              | 0,00                      | 4.003 % éch. 25/09/2036                                  | 10 315                              | 1 789                            | 0,00                      | 4.163 % éch. 25/09/2047                                        |                                     |                                  |                           |
| Newcastle Mortgage Securities Trust                  |                                     |                                  |                           | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                  |                                     |                                  |                           | 4.213 % éch. 25/09/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.953 % éch. 25/04/2037                              | 1 540                               | 1 497                            | 0,00                      | 4.258 % éch. 25/07/2036                                  | 1 409                               | 1 342                            | 0,00                      | 4.253 % éch. 25/09/2047                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.993 % éch. 25/04/2037                              | 1 226                               | 1 223                            | 0,00                      | 4.383 % éch. 25/06/2047                                  | 615                                 | 575                              | 0,00                      | 4.423 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.438 % éch. 25/03/2036                              | 1 579                               | 1 582                            | 0,00                      | 5.917 % éch. 25/04/2035                                  | 205                                 | 204                              | 0,00                      | 4.483 % éch. 25/11/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust |                                     |                                  |                           | RAAC Trust                                               |                                     |                                  |                           | 4.633 % éch. 25/08/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.243 % éch. 25/03/2036                              | 1 958                               | 1 931                            | 0,00                      | 4.263 % éch. 25/02/2037                                  | 1 970                               | 1 925                            | 0,00                      | 4.738 % éch. 26/12/2034                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.258 % éch. 25/03/2036                              | 3 258                               | 3 063                            | 0,00                      | 4.523 % éch. 25/10/2046                                  | 1 483                               | 1 464                            | 0,00                      | 5.513 % éch. 25/12/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.323 % éch. 25/07/2036                              | 6 555                               | 5 723                            | 0,01                      | Renaissance Home Equity Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                 |                                     |                                  |                           |
| 4.423 % éch. 25/11/2035                              | 2 434                               | 2 360                            | 0,00                      | 4.503 % éch. 25/08/2035                                  | 2 290                               | 2 032                            | 0,00                      | 3.883 % éch. 25/12/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.423 % éch. 25/10/2036                              | 6 731                               | 1 166                            | 0,00                      | 4.523 % éch. 25/12/2032                                  | 33                                  | 31                               | 0,00                      | 3.983 % éch. 25/12/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.528 % éch. 25/05/2035                              | 1 238                               | 1 228                            | 0,00                      | 5.285 % éch. 25/01/2037                                  | 2 814                               | 819                              | 0,00                      | 4.023 % éch. 25/12/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.563 % éch. 25/02/2037                              | 7 409                               | 2 004                            | 0,00                      | 5.294 % éch. 25/01/2037                                  | 18 457                              | 5 379                            | 0,01                      | 4.023 % éch. 25/05/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.492 % éch. 25/02/2037                              | 3 964                               | 1 004                            | 0,00                      | 5.512 % éch. 25/04/2037                                  | 8 724                               | 2 038                            | 0,00                      | 4.043 % éch. 25/01/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 6.532 % éch. 25/10/2036                              | 2 512                               | 412                              | 0,00                      | 5.545 % éch. 25/01/2037                                  | 2 529                               | 773                              | 0,00                      | 4.063 % éch. 25/09/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                      |                                     |                                  |                           | 5.512 % éch. 25/04/2037                                  | 8 724                               | 2 038                            | 0,00                      | 4.063 % éch. 25/12/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 2.675 % éch. 25/06/2036                              | 2 441                               | 1 817                            | 0,00                      | 5.545 % éch. 25/01/2037                                  | 2 529                               | 773                              | 0,00                      | 4.163 % éch. 25/05/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.943 % éch. 25/09/2037                              | 3 307                               | 3 189                            | 0,00                      | 5.608 % éch. 25/05/2036                                  | 6 712                               | 2 784                            | 0,00                      | 4.203 % éch. 25/01/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.963 % éch. 25/09/2037                              | 4 959                               | 4 902                            | 0,01                      | 5.612 % éch. 25/04/2037                                  | 5 992                               | 1 426                            | 0,00                      | 4.243 % éch. 25/07/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.063 % éch. 25/09/2036                              | 5 151                               | 1 971                            | 0,00                      | 5.675 % éch. 25/06/2037                                  | 421                                 | 97                               | 0,00                      | 4.303 % éch. 25/03/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.063 % éch. 25/03/2037                              | 2 220                               | 680                              | 0,00                      | 5.731 % éch. 25/11/2036                                  | 4 836                               | 1 473                            | 0,00                      | 4.408 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.083 % éch. 25/05/2036                              | 415                                 | 413                              | 0,00                      | 5.742 % éch. 25/04/2037                                  | 19 235                              | 4 684                            | 0,01                      | 4.438 % éch. 25/01/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.103 % éch. 25/11/2036                              | 10 108                              | 3 045                            | 0,00                      | 5.744 % éch. 25/06/2037                                  | 5 934                               | 1 382                            | 0,00                      | 4.483 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.103 % éch. 25/01/2037                              | 18 042                              | 5 814                            | 0,01                      | 5.746 % éch. 25/05/2036                                  | 2 541                               | 1 079                            | 0,00                      | 4.648 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.123 % éch. 25/03/2037                              | 19 096                              | 5 849                            | 0,01                      | 5.761 % éch. 25/04/2037                                  | 2 781                               | 680                              | 0,00                      | 6.658 % éch. 25/01/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.303 % éch. 25/05/2036                              | 386                                 | 379                              | 0,00                      | 5.762 % éch. 25/08/2036                                  | 8 258                               | 2 678                            | 0,00                      | SG Mortgage Securities Trust                                   |                                     |                                  |                           |
| 4.453 % éch. 25/01/2036                              | 4 996                               | 4 738                            | 0,01                      | 5.797 % éch. 25/08/2036                                  | 12 841                              | 4 212                            | 0,01                      | 4.083 % éch. 25/07/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.498 % éch. 25/01/2036                              | 4 091                               | 3 932                            | 0,00                      | 5.812 % éch. 25/11/2036                                  | 8 748                               | 2 703                            | 0,00                      | 4.123 % éch. 25/02/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.588 % éch. 25/06/2034                              | 187                                 | 181                              | 0,00                      | 5.857 % éch. 25/05/2035                                  | 2 027                               | 1 402                            | 0,00                      | 4.303 % éch. 25/02/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 5.488 % éch. 25/12/2034                              | 683                                 | 618                              | 0,00                      | 5.879 % éch. 25/06/2037                                  | 2 974                               | 710                              | 0,00                      | 4.468 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 5.638 % éch. 25/03/2035                              | 968                                 | 961                              | 0,00                      | 5.893 % éch. 25/06/2037                                  | 28 633                              | 6 850                            | 0,01                      | 4.648 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| Option One Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           | 5.906 % éch. 25/06/2037                                  | 7 657                               | 1 836                            | 0,00                      | 4.648 % éch. 25/10/2035                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.863 % éch. 25/07/2036                              | 1 781                               | 804                              | 0,00                      | 6.011 % éch. 25/05/2036                                  | 3 091                               | 1 371                            | 0,00                      | Soundview Home Loan Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| 3.883 % éch. 25/03/2037                              | 3 012                               | 2 937                            | 0,00                      | 6.120 % éch. 25/11/2036                                  | 11 903                              | 3 875                            | 0,00                      | 3.843 % éch. 25/06/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.893 % éch. 25/07/2037                              | 7 179                               | 4 849                            | 0,01                      | 6.166 % éch. 25/05/2036                                  | 3 374                               | 1 534                            | 0,00                      | 3.883 % éch. 25/11/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.943 % éch. 25/04/2037                              | 580                                 | 283                              | 0,00                      | 6.511 % éch. 25/07/2034                                  | 797                                 | 705                              | 0,00                      | 3.913 % éch. 25/06/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.943 % éch. 25/07/2037                              | 2 988                               | 2 018                            | 0,00                      | 6.566 % éch. 25/02/2036                                  | 3 692                               | 3 186                            | 0,00                      | 3.933 % éch. 25/07/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.953 % éch. 25/07/2037                              | 1 214                               | 1 092                            | 0,00                      | 6.998 % éch. 25/09/2037                                  | 8 820                               | 3 306                            | 0,00                      | 3.933 % éch. 25/08/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.963 % éch. 25/07/2036                              | 8 672                               | 5 148                            | 0,01                      | 7.238 % éch. 25/09/2037                                  | 8 980                               | 3 364                            | 0,00                      | 3.943 % éch. 25/07/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 3.983 % éch. 25/04/2037                              | 27 565                              | 19 563                           | 0,02                      | Residential Asset Mortgage Products Trust                |                                     |                                  |                           | 3.963 % éch. 25/06/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.043 % éch. 25/01/2037                              | 13 892                              | 9 015                            | 0,01                      | 4.148 % éch. 25/12/2035                                  | 450                                 | 379                              | 0,00                      | 4.063 % éch. 25/03/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.043 % éch. 25/02/2037                              | 17 008                              | 11 243                           | 0,01                      | 4.273 % éch. 25/03/2036                                  | 1 616                               | 1 595                            | 0,00                      | 4.083 % éch. 25/01/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.043 % éch. 25/03/2037                              | 11 970                              | 6 487                            | 0,01                      | 4.303 % éch. 25/02/2036                                  | 3 004                               | 2 887                            | 0,00                      | 4.103 % éch. 25/11/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.103 % éch. 25/05/2037                              | 16 978                              | 9 090                            | 0,01                      | 4.408 % éch. 25/02/2036                                  | 398                                 | 389                              | 0,00                      | 4.163 % éch. 25/02/2037                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.203 % éch. 25/01/2037                              | 6 133                               | 3 564                            | 0,00                      | 4.443 % éch. 25/12/2035                                  | 3 229                               | 2 929                            | 0,00                      | 4.168 % éch. 25/12/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.203 % éch. 25/05/2037                              | 4 143                               | 2 501                            | 0,00                      | 4.708 % éch. 25/10/2035                                  | 1 284                               | 1 122                            | 0,00                      | 4.183 % éch. 25/06/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.263 % éch. 25/03/2037                              | 2 220                               | 1 073                            | 0,00                      | 4.813 % éch. 25/08/2035                                  | 561                                 | 558                              | 0,00                      | 4.213 % éch. 25/05/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.303 % éch. 25/01/2036                              | 14 570                              | 13 861                           | 0,01                      | 4.828 % éch. 25/05/2035                                  | 1 838                               | 1 766                            | 0,00                      | 4.228 % éch. 25/02/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.498 % éch. 25/05/2035                              | 1 166                               | 1 137                            | 0,00                      | Residential Asset Securities Corp. Trust                 |                                     |                                  |                           | 4.228 % éch. 25/06/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.558 % éch. 25/05/2034                              | 1 244                               | 1 271                            | 0,00                      | 3.983 % éch. 25/02/2037                                  | 4 902                               | 4 746                            | 0,01                      | 4.243 % éch. 25/07/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.633 % éch. 25/05/2035                              | 700                                 | 622                              | 0,00                      | 4.043 % éch. 25/07/2036                                  | 2 736                               | 2 686                            | 0,00                      | 4.263 % éch. 25/10/2036                                        |                                     |                                  |                           |
| 4.693 % éch. 25/08/2035                              | 2 680                               | 2 373                            | 0,00                      | 4.043 % éch. 25/09/2036                                  | 1 188                               | 1 183                            | 0,00                      | 4.263 % éch. 25/11/2036                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4.178 % éch. 25/01/2037                                  | 5 312                               | 4 571                            | 0,01                      | 4.280 % éch. 25/03/2036                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                      |                                     |                                  |                           | 4.198 % éch. 25/06/2036                                  | 1 953                               | 1 928                            | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,318 % éch. 25/03/2036                                 | \$ 434                              | \$ 427                           | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/05/2037                                | \$ 3 263                            | \$ 2 956                         | 0,00                      | Oakwood Mortgage Investors, Inc.   |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/10/2036                                 | 2 106                               | 2 087                            | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/07/2047                                | 3 065                               | 1 795                            | 0,00                      | 5,050 % éch. 15/11/2019            | \$ 66                               | \$ 64                            | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/01/2037                                 | 2 320                               | 2 266                            | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/01/2037                                | 16 465                              | 14 376                           | 0,01                      |                                    |                                     | 9 520                            | 0,01                      |
| 4,453 % éch. 25/12/2035                                 | 7 193                               | 6 741                            | 0,01                      | 4,143 % éch. 25/04/2037                                | 22 592                              | 8 062                            | 0,01                      |                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,513 % éch. 25/01/2035                                 | 381                                 | 353                              | 0,00                      | 4,483 % éch. 25/04/2037                                | 715                                 | 255                              | 0,00                      |                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,603 % éch. 25/08/2035                                 | 3 022                               | 2 822                            | 0,00                      | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust      |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,663 % éch. 25/10/2037                                 | 13 531                              | 10 780                           | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/05/2036                                | 677                                 | 541                              | 0,00                      | AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS |                                     |                                  |                           |
| 4,713 % éch. 25/09/2037                                 | 1 181                               | 1 007                            | 0,00                      | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust  |                                     |                                  |                           | AGL CLO Ltd.                       |                                     |                                  |                           |
| 4,738 % éch. 25/03/2036                                 | 1 892                               | 1 823                            | 0,00                      | 4,108 % éch. 25/01/2037                                | 2 139                               | 2 138                            | 0,00                      | 4,802 % éch. 02/12/2034            | 45 300                              | 45 354                           | 0,04                      |
| 4,763 % éch. 25/09/2037                                 | 3 597                               | 2 705                            | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/04/2037                                | 875                                 | 862                              | 0,00                      | 5,040 % éch. 20/04/2037            | 40 000                              | 40 049                           | 0,03                      |
| 4,798 % éch. 25/05/2035                                 | 379                                 | 379                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/07/2036                                | 2 300                               | 2 256                            | 0,00                      | AlbaCore Euro CLO DAC              |                                     |                                  |                           |
| 4,843 % éch. 25/07/2035                                 | 90                                  | 90                               | 0,00                      | 4,273 % éch. 25/05/2036                                | 2 436                               | 2 426                            | 0,00                      | 3,194 % éch. 15/07/2035            | € 30 380                            | 34 817                           | 0,03                      |
| 4,863 % éch. 25/09/2037                                 | 1 067                               | 910                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/04/2037                                | 2 000                               | 1 484                            | 0,00                      | 3,391 % éch. 15/12/2034            | 16 722                              | 19 128                           | 0,02                      |
| Southern Pacific Secured Assets Corp.                   |                                     |                                  |                           | 4,503 % éch. 25/04/2034                                | 16                                  | 16                               | 0,00                      | ALESCO Preferred Funding Ltd.      |                                     |                                  |                           |
| 4,163 % éch. 25/03/2028                                 | 23                                  | 22                               | 0,00                      | 4,763 % éch. 25/10/2034                                | 366                                 | 381                              | 0,00                      | 4,278 % éch. 23/09/2037            | \$ 5 725                            | 5 439                            | 0,00                      |
| Structured Asset Investment Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | 5,488 % éch. 25/11/2035                                | 683                                 | 683                              | 0,00                      | 4,318 % éch. 23/06/2036            | 12 908                              | 12 811                           | 0,01                      |
| 4,023 % éch. 25/07/2036                                 | 561                                 | 412                              | 0,00                      | 5,863 % éch. 25/11/2035                                | 2 472                               | 2 464                            | 0,00                      | 4,338 % éch. 23/12/2035            | 2 667                               | 2 667                            | 0,00                      |
| 4,108 % éch. 25/07/2036                                 | 13 296                              | 7 599                            | 0,01                      | 6,163 % éch. 25/12/2034                                | 375                                 | 375                              | 0,00                      | 4,358 % éch. 23/09/2037            | 2 000                               | 1 815                            | 0,00                      |
| 4,313 % éch. 25/09/2034                                 | 2 843                               | 2 727                            | 0,00                      | 6,313 % éch. 25/04/2035                                | 170                                 | 173                              | 0,00                      | 4,408 % éch. 23/12/2036            | 4 083                               | 3 961                            | 0,00                      |
| 4,363 % éch. 25/04/2036                                 | 8 014                               | 3 752                            | 0,00                      | 7,513 % éch. 25/04/2035                                | 357                                 | 390                              | 0,00                      | 4,708 % éch. 23/09/2038            | 5 432                               | 5 364                            | 0,00                      |
| 4,383 % éch. 25/01/2036                                 | 3 105                               | 2 929                            | 0,00                      |                                                        |                                     |                                  |                           | Anchorage Capital Europe CLO DAC   |                                     |                                  |                           |
| 4,393 % éch. 25/11/2035                                 | 3 420                               | 3 375                            | 0,00                      |                                                        | 2 535 803                           | 2,03                             |                           | 3,424 % éch. 15/10/2038            | € 30 000                            | 34 369                           | 0,03                      |
| 4,468 % éch. 25/03/2034                                 | 81                                  | 87                               | 0,00                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES              |                                     |                                  |                           | Aqueduct European CLO DAC          |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/04/2035                                 | 85                                  | 99                               | 0,00                      | Asset-Backed Funding Certificates Trust                |                                     |                                  |                           | 3,213 % éch. 15/08/2034            | 35 624                              | 40 759                           | 0,03                      |
| 4,483 % éch. 25/07/2035                                 | 174                                 | 166                              | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/01/2037                                | 9 179                               | 5 096                            | 0,01                      | 3,268 % éch. 15/04/2034            | 8 500                               | 9 727                            | 0,01                      |
| 4,483 % éch. 25/10/2035                                 | 54                                  | 53                               | 0,00                      | 4,203 % éch. 25/01/2037                                | 3 102                               | 1 722                            | 0,00                      | 3,511 % éch. 25/07/2039 (c)        | 35 000                              | 40 015                           | 0,03                      |
| 4,483 % éch. 25/01/2036                                 | 2 212                               | 2 144                            | 0,00                      | BNC Mortgage Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | Arbour CLO DAC                     |                                     |                                  |                           |
| 4,498 % éch. 25/09/2035                                 | 4 580                               | 4 216                            | 0,01                      | 4,013 % éch. 25/07/2037                                | 6 400                               | 5 814                            | 0,01                      | 3,004 % éch. 15/04/2034            | 13 972                              | 15 990                           | 0,01                      |
| 4,513 % éch. 25/07/2035                                 | 733                                 | 727                              | 0,00                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.      |                                     |                                  |                           | 3,064 % éch. 15/04/2034            | 13 152                              | 15 047                           | 0,01                      |
| 4,528 % éch. 25/08/2035                                 | 1 198                               | 1 169                            | 0,00                      | 5,989 % éch. 25/10/2046                                | 22                                  | 27                               | 0,00                      | 3,204 % éch. 15/10/2034            | 20 000                              | 22 884                           | 0,02                      |
| 4,663 % éch. 25/05/2035                                 | 1 164                               | 1 154                            | 0,00                      | 6,770 % éch. 25/10/2046                                | 3 892                               | 2 961                            | 0,00                      | 3,371 % éch. 15/06/2034            | 6 800                               | 7 784                            | 0,01                      |
| 4,693 % éch. 25/01/2035                                 | 2 545                               | 2 511                            | 0,00                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC      |                                     |                                  |                           | 3,433 % éch. 15/11/2037            | 44 300                              | 50 712                           | 0,04                      |
| 4,693 % éch. 25/06/2035                                 | 3 100                               | 3 031                            | 0,00                      | 2,928 % éch. 25/12/2036                                | 3 626                               | 2 938                            | 0,00                      | 3,453 % éch. 15/08/2038            | 39 900                              | 45 623                           | 0,04                      |
| 4,763 % éch. 25/09/2034                                 | 2 057                               | 2 026                            | 0,00                      | 3,089 % éch. 25/01/2037                                | 13 858                              | 3 743                            | 0,00                      | 3,581 % éch. 15/12/2038            | 28 400                              | 32 517                           | 0,03                      |
| 4,888 % éch. 25/07/2033                                 | 123                                 | 122                              | 0,00                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                    |                                     |                                  |                           | 3,613 % éch. 15/05/2038            | 39 750                              | 45 535                           | 0,04                      |
| 5,038 % éch. 25/12/2034                                 | 1 290                               | 1 273                            | 0,00                      | 3,930 % éch. 25/11/2036                                | 3 434                               | 3 188                            | 0,00                      | Arcano Euro CLO DAC                |                                     |                                  |                           |
| 5,143 % éch. 25/04/2033                                 | 13                                  | 13                               | 0,00                      | 3,945 % éch. 25/07/2036                                | 249                                 | 248                              | 0,00                      | 3,415 % éch. 25/07/2039            | 36 000                              | 41 200                           | 0,03                      |
| 5,263 % éch. 25/11/2034                                 | 190                                 | 229                              | 0,00                      | 4,023 % éch. 25/03/2037                                | 1 164                               | 1 159                            | 0,00                      | 4,215 % éch. 25/07/2039            | 500                                 | 574                              | 0,00                      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust   |                                     |                                  |                           | 4,071 % éch. 25/01/2037                                | 1 929                               | 931                              | 0,00                      | Ares European CLO DAC              |                                     |                                  |                           |
| 3,918 % éch. 25/09/2036                                 | 7 762                               | 4 643                            | 0,01                      | 4,213 % éch. 25/01/2037                                | 148                                 | 146                              | 0,00                      | 2,984 % éch. 15/10/2031            | 852                                 | 975                              | 0,00                      |
| 3,943 % éch. 25/03/2036                                 | 45                                  | 45                               | 0,00                      | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                     |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 25/04/2032            | 2 905                               | 3 324                            | 0,00                      |
| 3,983 % éch. 25/10/2037                                 | 15 818                              | 9 897                            | 0,01                      | 4,003 % éch. 25/04/2037                                | 13 798                              | 3 635                            | 0,00                      | 3,154 % éch. 15/01/2036            | 4 200                               | 4 807                            | 0,00                      |
| 3,993 % éch. 25/05/2047                                 | 3 723                               | 3 675                            | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/04/2037                                | 3 309                               | 874                              | 0,00                      | 3,160 % éch. 17/04/2032            | 4 698                               | 5 377                            | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/05/2036                                 | 1 560                               | 1 540                            | 0,00                      | 4,483 % éch. 25/04/2037                                | 3 210                               | 849                              | 0,00                      | 3,218 % éch. 20/07/2032            | 12 916                              | 14 784                           | 0,01                      |
| 4,063 % éch. 25/03/2037                                 | 2 293                               | 1 541                            | 0,00                      | Saxon Asset Securities Trust                           |                                     |                                  |                           | 3,234 % éch. 21/10/2034            | 4 956                               | 5 672                            | 0,00                      |
| 4,073 % éch. 25/08/2046                                 | 3 180                               | 2 950                            | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/10/2046                                | 16 837                              | 15 045                           | 0,01                      | 3,512 % éch. 15/07/2037            | 20 000                              | 22 866                           | 0,02                      |
| 4,083 % éch. 25/01/2037                                 | 4 961                               | 4 775                            | 0,01                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust  |                                     |                                  |                           | 4,004 % éch. 21/10/2034            | 3 000                               | 3 440                            | 0,00                      |
| 4,183 % éch. 25/02/2037                                 | 99                                  | 97                               | 0,00                      | 4,383 % éch. 25/12/2036                                | 11 110                              | 6 732                            | 0,01                      | 4,012 % éch. 15/07/2037            | 11 120                              | 12 713                           | 0,01                      |
| 4,193 % éch. 25/03/2037                                 | 3 023                               | 2 226                            | 0,00                      | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust  |                                     |                                  |                           | Armada Euro CLO DAC                |                                     |                                  |                           |
| 4,198 % éch. 25/07/2036                                 | 5 033                               | 5 184                            | 0,01                      | 4,183 % éch. 25/03/2037                                | 355                                 | 354                              | 0,00                      | 3,093 % éch. 28/07/2034            | 8 033                               | 9 193                            | 0,01                      |
| 4,223 % éch. 25/01/2037                                 | 12 776                              | 7 308                            | 0,01                      |                                                        |                                     |                                  |                           | Atlantic Avenue Ltd.               |                                     |                                  |                           |
| 4,223 % éch. 25/02/2037                                 | 6 276                               | 6 143                            | 0,01                      |                                                        |                                     |                                  |                           | 5,053 % éch. 15/10/2038            | \$ 35 000                           | 35 117                           | 0,03                      |
| 4,243 % éch. 25/01/2037                                 | 2 990                               | 2 866                            | 0,00                      | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS IMMOBILIERS PRÉFABRIQUÉS   |                                     |                                  |                           | Aurium CLO DAC                     |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/11/2037                                 | 9 432                               | 8 002                            | 0,01                      | AUTRES                                                 |                                     |                                  |                           | 3,011 % éch. 22/05/2034            | € 5 798                             | 6 634                            | 0,01                      |
| 4,288 % éch. 25/07/2036                                 | 994                                 | 962                              | 0,00                      | Conseco Finance Securitizations Corp.                  |                                     |                                  |                           | 3,030 % éch. 17/04/2034            | 1 495                               | 1 705                            | 0,00                      |
| 4,303 % éch. 25/05/2031                                 | 224                                 | 152                              | 0,00                      | 5,511 % éch. 01/09/2033                                | 397                                 | 398                              | 0,00                      | 3,113 % éch. 28/10/2034            | 20 000                              | 22 890                           | 0,02                      |
| 4,383 % éch. 25/02/2037                                 | 3 375                               | 3 280                            | 0,00                      | 7,100 % éch. 01/02/2033                                | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 3,347 % éch. 22/06/2034            | 48 671                              | 55 607                           | 0,04                      |
| 4,438 % éch. 25/04/2035                                 | 278                                 | 287                              | 0,00                      | 8,060 % éch. 01/09/2029                                | 14 402                              | 1 540                            | 0,00                      | Avoca CLO DAC                      |                                     |                                  |                           |
| 4,438 % éch. 25/06/2035                                 | 61                                  | 60                               | 0,00                      | Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust         |                                     |                                  |                           | 3,104 % éch. 15/07/2034            | 32 673                              | 37 396                           | 0,03                      |
| 4,526 % éch. 25/02/2035                                 | 1 214                               | 1 306                            | 0,00                      | 6,630 % éch. 15/04/2040                                | 342                                 | 343                              | 0,00                      | 3,164 % éch. 15/10/2034            | 35 500                              | 40 619                           | 0,03                      |
| 4,540 % éch. 25/08/2034                                 | 35                                  | 35                               | 0,00                      |                                                        |                                     |                                  |                           | Avondale Park CLO DAC              |                                     |                                  |                           |
| 4,768 % éch. 25/11/2035                                 | 125                                 | 125                              | 0,00                      |                                                        |                                     |                                  |                           | 3,407 % éch. 20/09/2034            | 8 511                               | 9 738                            | 0,01                      |
| 4,903 % éch. 25/02/2035                                 | 228                                 | 228                              | 0,00                      | PRÊTS SUR LOGEMENTS PRÉFABRIQUÉS PAR TRANCHES          |                                     |                                  |                           | Bain Capital Credit CLO Ltd.       |                                     |                                  |                           |
| 5,788 % éch. 25/07/2035                                 | 777                                 | 859                              | 0,00                      | Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust |                                     |                                  |                           | 4,656 % éch. 23/04/2035            | \$ 54 300                           | 54 362                           | 0,04                      |
| 5,840 % éch. 25/05/2031                                 | 842                                 | 578                              | 0,00                      | 7,180 % éch. 15/12/2015                                | 980                                 | 46                               | 0,00                      | 4,702 % éch. 21/10/2034            | 49 600                              | 49 623                           | 0,04                      |
| 6,388 % éch. 25/11/2035                                 | 2 270                               | 2 257                            | 0,00                      | 7,440 % éch. 15/01/2020                                | 10 140                              | 482                              | 0,00                      | 4,727 % éch. 24/07/2034            | 45 500                              | 45 524                           | 0,04                      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through |                                     |                                  |                           | 7,575 % éch. 15/06/2030                                | 936                                 | 45                               | 0,00                      | 4,762 % éch. 21/10/2034            | 41 100                              | 41 150                           | 0,03                      |
| Certificates                                            |                                     |                                  |                           | Conseco Finance Corp.                                  |                                     |                                  |                           | 4,814 % éch. 22/04/2035            | 45 000                              | 45 041                           | 0,04                      |
| 4,588 % éch. 25/01/2035                                 | 218                                 | 232                              | 0,00                      | 7,060 % éch. 01/02/2031                                | 666                                 | 613                              | 0,00                      | Bain Capital Euro CLO DAC          |                                     |                                  |                           |
| Terwin Mortgage Trust                                   |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/03/2030                                | 12 064                              | 2 477                            | 0,01                      | 3,084 % éch. 15/07/2034            | € 9 462                             | 10 829                           | 0,01                      |
| 4,103 % éch. 25/07/2037                                 | 2 666                               | 2 614                            | 0,00                      | 7,860 % éch. 01/03/2030                                | 4 456                               | 958                              | 0,00                      | 3,444 % éch. 22/01/2038            | 32 000                              | 36 627                           | 0,03                      |
| 4,321 % éch. 25/08/2036                                 | 1 084                               | 185                              | 0,00                      | Conseco Finance Securitizations Corp.                  |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 22/01/2038            | 3 000                               | 3 448                            | 0,00                      |
| 4,563 % éch. 25/09/2036                                 | 2 713                               | 929                              | 0,00                      | 7,770 % éch. 01/09/2031                                | 292                                 | 296                              | 0,00                      | Ballyrock CLO Ltd.                 |                                     |                                  |                           |
| 4,703 % éch. 25/11/2033                                 | 5                                   | 4                                | 0,00                      | 7,970 % éch. 01/05/2032                                | 1 887                               | 205                              | 0,00                      | 5,177 % éch. 25/07/2037            | \$ 37 300                           | 37 392                           | 0,03                      |
| Truman Capital Mortgage Loan Trust                      |                                     |                                  |                           | 8,260 % éch. 01/12/2030                                | 13 372                              | 1 959                            | 0,00                      | Barings Euro CLO DAC               |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/03/2036                                 | 1 091                               | 1 021                            | 0,00                      | 8,310 % éch. 01/05/2032                                | 20 172                              | 2 370                            | 0,00                      | 2,961 % éch. 24/04/2034            | € 10 179                            | 11 638                           | 0,01                      |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust               |                                     |                                  |                           | IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through     |                                     |                                  |                           | 3,145 % éch. 25/07/2035            | 15 900                              | 18 192                           | 0,01                      |
| 3,893 % éch. 25/07/2047                                 | 3 524                               | 2 071                            | 0,00                      | Certificates                                           |                                     |                                  |                           | 3,164 % éch. 15/10/2034            | 5 288                               | 6 051                            | 0,00                      |
| 3,933 % éch. 25/05/2037                                 | 2 790                               | 2 521                            | 0,00                      | 6,750 % éch. 25/02/2028                                | 5                                   | 5                                | 0,00                      | 3,184 % éch. 15/10/2034            | 16 597                              | 19 013                           | 0,02                      |
| 3,933 % éch. 25/07/2047                                 | 298                                 | 227                              | 0,00                      |                                                        |                                     |                                  |                           | 3,426 % éch. 15/08/2039            | 38 400                              | 43 938                           | 0,04                      |
| 3,988 % éch. 25/05/2037                                 | 575                                 | 549                              | 0,00                      |                                                        |                                     |                                  |                           | 3,444 % éch. 21/10/2038            | 43 300                              | 49 579                           | 0,04                      |

# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Bayfront IABS Pte Ltd.                        |                                     |                                  |                           | Clarinda Park CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           | 3,165 % éch. 25/10/2040                           | \$ 1 000                            | \$ 1 141                         | 0,00                      |
| 4,904 % éch. 11/04/2048                       | \$ 49 752                           | \$ 49 658                        | 0,04                      | 3,183 % éch. 15/02/2034                                | € 19 306                            | \$ 22 083                        | 0,02                      | FTA Santander Consumo                             | 3 519                               | 4 034                            | 0,00                      |
| 4,992 % éch. 11/07/2047                       | 42 600                              | 42 600                           | 0,03                      | Commonbond Student Loan Trust                          |                                     |                                  |                           | 3,538 % éch. 20/07/2038                           |                                     |                                  | 0,00                      |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.      |                                     |                                  |                           | 2,550 % éch. 25/05/2041                                | \$ 714                              | 685                              | 0,00                      | 3,888 % éch. 20/07/2038                           | 2 951                               | 3 390                            | 0,00                      |
| 4,941 % éch. 11/04/2045                       | 12 272                              | 12 247                           | 0,01                      | 4,613 % éch. 25/05/2041                                | 41                                  | 41                               | 0,00                      | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                                  |                           |
| 4,951 % éch. 11/04/2045                       | 13 706                              | 13 682                           | 0,01                      | Concord Music Royalties LLC                            |                                     |                                  |                           | 2,918 % éch. 25/10/2035                           | 30 029                              | 34 362                           | 0,03                      |
| 5,026 % éch. 11/04/2043                       | 9 484                               | 9 486                            | 0,01                      | 3,604 % éch. 20/10/2074                                | 34 800                              | 34 906                           | 0,03                      | 3,095 % éch. 25/02/2034                           | 18 060                              | 20 727                           | 0,02                      |
| 5,051 % éch. 11/04/2043                       | 14 155                              | 14 165                           | 0,01                      | Contego CLO BV                                         |                                     |                                  |                           | 3,158 % éch. 23/12/2036                           | 35 300                              | 40 414                           | 0,03                      |
| BBAM European CLO DAC                         |                                     |                                  |                           | 3,454 % éch. 15/04/2038                                | € 36 000                            | 41 207                           | 0,03                      | Golden Bar Securitisation SRL                     |                                     |                                  |                           |
| 3,124 % éch. 15/01/2036                       | € 16 775                            | 19 179                           | 0,02                      | Contego CLO DAC                                        |                                     |                                  |                           | 3,136 % éch. 20/12/2044                           | 85 032                              | 97 467                           | 0,08                      |
| 3,224 % éch. 15/10/2034                       | 19 500                              | 22 316                           | 0,02                      | 2,994 % éch. 15/04/2034                                | 19 606                              | 22 438                           | 0,02                      | 3,216 % éch. 22/09/2043                           | 26 027                              | 29 885                           | 0,02                      |
| BBVA Consumer FTA                             |                                     |                                  |                           | 3,111 % éch. 24/01/2034                                | 11 063                              | 12 658                           | 0,01                      | Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.          |                                     |                                  |                           |
| 2,849 % éch. 20/05/2039                       | 76 899                              | 87 860                           | 0,07                      | CQS U.S. CLO Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/10/2034                           | \$ 21 000                           | 21 025                           | 0,02                      |
| BCRED PC Static LLC                           |                                     |                                  |                           | 5,101 % éch. 17/01/2039                                | \$ 36 000                           | 36 048                           | 0,03                      | Golub Capital Partners CLO Ltd.                   |                                     |                                  |                           |
| 4,974 % éch. 27/04/2036                       | \$ 70 000                           | 69 999                           | 0,06                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd. |                                     |                                  |                           | 4,852 % éch. 25/07/2037                           | 45 000                              | 45 057                           | 0,04                      |
| 5,334 % éch. 27/04/2036                       | 10 000                              | 10 000                           | 0,01                      | 7,020 % éch. 16/02/2041 ^                              | 54 641                              | 753                              | 0,00                      | Goodgreen Trust                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,534 % éch. 27/04/2036                       | 10 000                              | 10 000                           | 0,01                      | Crosthwaite Park CLO DAC                               |                                     |                                  |                           | 3,930 % éch. 15/10/2053                           | 7 743                               | 7 189                            | 0,01                      |
| Benefit Street Partners CLO Ltd.              |                                     |                                  |                           | 3,251 % éch. 15/03/2034                                | € 4 289                             | 4 910                            | 0,00                      | Grosvenor Place CLO DAC                           |                                     |                                  |                           |
| 4,825 % éch. 20/04/2035                       | 36 000                              | 36 018                           | 0,03                      | Cumulus Static CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           | 3,383 % éch. 15/08/2039                           | € 38 400                            | 43 947                           | 0,04                      |
| Bilbao CLO DAC                                |                                     |                                  |                           | 3,483 % éch. 15/11/2033                                | 14 680                              | 16 795                           | 0,01                      | 3,444 % éch. 15/01/2039                           | 41 850                              | 47 904                           | 0,04                      |
| 3,124 % éch. 15/04/2036                       | € 9 977                             | 11 417                           | 0,01                      | CVC Cordatus Loan Fund DAC                             |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| Black Diamond CLO DAC                         |                                     |                                  |                           | 3,054 % éch. 15/07/2034                                | 10 747                              | 12 299                           | 0,01                      | 3,054 % éch. 15/01/2032                           | 17 078                              | 19 533                           | 0,02                      |
| 3,263 % éch. 15/05/2032                       | 108                                 | 123                              | 0,00                      | 3,066 % éch. 25/04/2036                                | 30 000                              | 34 321                           | 0,03                      | 3,154 % éch. 21/10/2034                           | 25 900                              | 29 634                           | 0,02                      |
| Blackrock European CLO DAC                    |                                     |                                  |                           | 3,130 % éch. 29/07/2034                                | 15 000                              | 17 148                           | 0,01                      | 3,188 % éch. 20/10/2032                           | 4 485                               | 5 131                            | 0,00                      |
| 3,118 % éch. 19/07/2035                       | 38 467                              | 44 032                           | 0,04                      | 3,179 % éch. 18/11/2033                                | 14 048                              | 16 064                           | 0,01                      | 3,464 % éch. 15/10/2038                           | 36 000                              | 41 223                           | 0,03                      |
| 3,158 % éch. 20/01/2036                       | 37 000                              | 42 347                           | 0,03                      | 3,227 % éch. 22/06/2034                                | 4 632                               | 5 302                            | 0,00                      | 3,523 % éch. 25/07/2037 (c)                       | 30 600                              | 34 985                           | 0,03                      |
| 3,220 % éch. 17/07/2034                       | 36 631                              | 41 950                           | 0,03                      | 3,259 % éch. 20/08/2034                                | 8 378                               | 9 596                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/07/2037 (c)                       | 8 800                               | 10 061                           | 0,01                      |
| BlueMountain Euro CLO DAC                     |                                     |                                  |                           | 3,285 % éch. 23/01/2039                                | 40 000                              | 45 800                           | 0,04                      | Hayfin Emerald CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 3,034 % éch. 15/04/2034                       | 4 927                               | 5 639                            | 0,00                      | 3,341 % éch. 15/12/2034                                | 28 500                              | 32 609                           | 0,03                      | 3,054 % éch. 27/05/2034                           | 12 043                              | 13 780                           | 0,01                      |
| 3,204 % éch. 15/10/2035                       | 7 250                               | 8 302                            | 0,01                      | 3,488 % éch. 15/06/2037                                | 36 000                              | 41 210                           | 0,03                      | 3,060 % éch. 17/04/2034                           | 928                                 | 1 061                            | 0,00                      |
| BlueMountain Fuji Euro CLO DAC                |                                     |                                  |                           | 3,528 % éch. 15/05/2037                                | 35 000                              | 40 115                           | 0,03                      | 3,154 % éch. 15/04/2034                           | 2 000                               | 2 288                            | 0,00                      |
| 3,114 % éch. 15/01/2033                       | 1 914                               | 2 190                            | 0,00                      | 3,603 % éch. 24/03/2038                                | 20 000                              | 22 886                           | 0,02                      | 3,184 % éch. 15/01/2035                           | 23 000                              | 26 316                           | 0,02                      |
| BNPP AM Euro CLO DAC                          |                                     |                                  |                           | 3,806 % éch. 25/04/2036                                | 10 000                              | 11 453                           | 0,01                      | 3,244 % éch. 15/10/2034                           | 4 900                               | 5 604                            | 0,00                      |
| 2,854 % éch. 15/10/2031                       | 6 418                               | 7 332                            | 0,01                      | CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC                 |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 22/01/2039                           | 30 000                              | 34 358                           | 0,03                      |
| 3,014 % éch. 22/07/2032                       | 8 899                               | 10 172                           | 0,01                      | 3,123 % éch. 15/08/2033                                | 23 086                              | 26 387                           | 0,02                      | 3,449 % éch. 17/11/2037                           | 33 400                              | 38 248                           | 0,03                      |
| 3,251 % éch. 15/12/2033                       | 4 977                               | 5 695                            | 0,00                      | Dartry Park CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           | 3,454 % éch. 15/10/2038                           | 27 300                              | 31 238                           | 0,03                      |
| Bosphorus CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | 2,963 % éch. 28/01/2034                                | 18 816                              | 21 529                           | 0,02                      | 3,498 % éch. 18/10/2039                           | 40 000                              | 45 770                           | 0,04                      |
| 3,045 % éch. 25/05/2034                       | 17 515                              | 20 039                           | 0,02                      | DB Master Finance LLC                                  |                                     |                                  |                           | Henley CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,407 % éch. 12/12/2032                       | 543                                 | 621                              | 0,00                      | 2,493 % éch. 20/11/2051                                | \$ 21 085                           | 19 906                           | 0,02                      | 3,015 % éch. 25/01/2034                           | 8 337                               | 9 539                            | 0,01                      |
| 3,614 % éch. 15/04/2038                       | 38 000                              | 43 525                           | 0,04                      | 2,791 % éch. 20/11/2051                                | 1 433                               | 1 274                            | 0,00                      | 3,115 % éch. 25/07/2034                           | 5 264                               | 6 025                            | 0,00                      |
| Boyce Park CLO Ltd.                           |                                     |                                  |                           | 4,030 % éch. 20/11/2047                                | 9 634                               | 9 541                            | 0,01                      | 3,165 % éch. 10/06/2034                           | 12 150                              | 13 915                           | 0,01                      |
| 4,672 % éch. 21/04/2035                       | \$ 36 000                           | 36 025                           | 0,03                      | Deer Park CLO DAC                                      |                                     |                                  |                           | ICG Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           |
| Bridgepoint CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | 3,214 % éch. 15/10/2034                                | € 20 000                            | 22 883                           | 0,02                      | 2,150 % éch. 15/10/2034                           | 6 000                               | 6 438                            | 0,01                      |
| 3,104 % éch. 15/04/2035                       | € 4 000                             | 4 574                            | 0,00                      | Domino's Pizza Master Issuer LLC                       |                                     |                                  |                           | 3,455 % éch. 26/01/2038                           | 31 500                              | 36 050                           | 0,03                      |
| 3,144 % éch. 15/01/2036                       | 5 000                               | 5 721                            | 0,00                      | 2,662 % éch. 25/04/2051                                | \$ 24 403                           | 23 210                           | 0,02                      | 4,055 % éch. 26/01/2038                           | 4 800                               | 5 517                            | 0,00                      |
| Cairn CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           | 3,151 % éch. 25/04/2051                                | 10 350                              | 9 500                            | 0,01                      | 4,550 % éch. 26/01/2038                           | 1 000                               | 1 149                            | 0,00                      |
| 2,820 % éch. 31/01/2030                       | 9 538                               | 10 914                           | 0,01                      | 3,668 % éch. 25/10/2049                                | 39 855                              | 38 301                           | 0,03                      | Indigo Credit Management DAC                      |                                     |                                  |                           |
| 3,038 % éch. 20/10/2033                       | 4 840                               | 5 515                            | 0,00                      | Dryden CLO Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/07/2038                           | 30 000                              | 34 352                           | 0,03                      |
| 3,170 % éch. 29/10/2034                       | 19 000                              | 21 749                           | 0,02                      | 4,907 % éch. 18/04/2031                                | 3 668                               | 3 670                            | 0,00                      | 3,464 % éch. 15/10/2037                           | 30 000                              | 34 337                           | 0,03                      |
| 3,194 % éch. 15/07/2034                       | 33 000                              | 37 760                           | 0,03                      | 4,955 % éch. 15/04/2031                                | 393                                 | 394                              | 0,00                      | Invesco CLO Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |
| 3,434 % éch. 15/01/2040                       | 35 100                              | 40 163                           | 0,03                      | Dryden Euro CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/07/2035                           | \$ 32 800                           | 32 839                           | 0,03                      |
| 4,304 % éch. 15/01/2040                       | 4 900                               | 5 644                            | 0,00                      | 1,950 % éch. 18/10/2034                                | € 1 000                             | 1 048                            | 0,00                      | Invesco Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |
| Camber PLC                                    |                                     |                                  |                           | 2,864 % éch. 15/04/2033                                | 1 266                               | 1 447                            | 0,00                      | 3,134 % éch. 15/04/2033                           | € 2 353                             | 2 694                            | 0,00                      |
| 5,785 % éch. 09/11/2053 ^                     | \$ 33 130                           | 3                                | 0,00                      | 3,024 % éch. 15/04/2034                                | 5 135                               | 5 878                            | 0,00                      | 3,144 % éch. 15/07/2034                           | 40 000                              | 45 761                           | 0,04                      |
| Canyon Capital CLO Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 3,084 % éch. 15/04/2034                                | 6 081                               | 6 959                            | 0,01                      | 3,194 % éch. 15/01/2035                           | 13 131                              | 15 020                           | 0,01                      |
| 4,683 % éch. 15/10/2034                       | 38 100                              | 38 134                           | 0,03                      | 3,088 % éch. 20/07/2034                                | 19 879                              | 22 749                           | 0,02                      | 3,224 % éch. 15/01/2034                           | 13 952                              | 15 962                           | 0,01                      |
| 4,773 % éch. 15/10/2034                       | 40 000                              | 40 049                           | 0,03                      | 3,143 % éch. 15/05/2034                                | 56                                  | 64                               | 0,00                      | 3,260 % éch. 30/10/2038                           | 36 500                              | 41 783                           | 0,03                      |
| Capital Four CLO DAC                          |                                     |                                  |                           | 3,144 % éch. 15/01/2034                                | 44 673                              | 51 142                           | 0,04                      | 3,277 % éch. 15/07/2037                           | 39 200                              | 44 872                           | 0,04                      |
| 3,224 % éch. 15/10/2034                       | € 6 000                             | 6 865                            | 0,01                      | 3,154 % éch. 15/04/2035                                | 28 500                              | 32 613                           | 0,03                      | 3,454 % éch. 22/10/2036                           | 33 500                              | 38 345                           | 0,03                      |
| 3,394 % éch. 15/04/2038                       | 34 000                              | 38 876                           | 0,03                      | 3,218 % éch. 18/10/2034                                | 10 000                              | 11 443                           | 0,01                      | Invesco U.S. CLO Ltd.                             |                                     |                                  |                           |
| 3,415 % éch. 25/10/2038                       | 32 800                              | 37 546                           | 0,03                      | 3,220 % éch. 17/01/2033                                | 2 930                               | 3 354                            | 0,00                      | 4,831 % éch. 20/07/2037                           | \$ 40 000                           | 40 036                           | 0,03                      |
| 3,854 % éch. 15/04/2038                       | 14 000                              | 16 029                           | 0,01                      | 3,238 % éch. 18/10/2034                                | 18 000                              | 20 614                           | 0,02                      | Jubilee CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |
| Capital Four U.S. CLO Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 3,498 % éch. 18/10/2039                                | 36 000                              | 41 193                           | 0,03                      | 3,034 % éch. 15/07/2034                           | € 7 515                             | 8 599                            | 0,01                      |
| 4,879 % éch. 15/07/2037 (c)                   | \$ 36 000                           | 36 000                           | 0,03                      | Euro-Galaxy CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           | 3,164 % éch. 15/10/2035                           | 15 000                              | 17 162                           | 0,01                      |
| Carlyle Euro CLO DAC                          |                                     |                                  |                           | 2,781 % éch. 24/04/2034                                | 4 975                               | 5 685                            | 0,00                      | Latitude Australia Personal Loans Trust           |                                     |                                  |                           |
| 3,014 % éch. 15/01/2034                       | € 2 467                             | 2 824                            | 0,00                      | 3,050 % éch. 30/07/2034                                | 7 000                               | 8 009                            | 0,01                      | 5,303 % éch. 17/09/2033                           | AUD 5 865                           | 4 066                            | 0,00                      |
| 3,151 % éch. 15/03/2032                       | 2 901                               | 3 319                            | 0,00                      | 3,233 % éch. 15/02/2034                                | 19 977                              | 22 865                           | 0,02                      | Lyra Music Assets Delaware LP                     |                                     |                                  |                           |
| 3,493 % éch. 15/08/2038                       | 46 900                              | 53 728                           | 0,04                      | Fair Oaks Loan Funding DAC                             |                                     |                                  |                           | 5,760 % éch. 22/12/2064                           | \$ 86 931                           | 87 532                           | 0,07                      |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC |                                     |                                  |                           | 3,054 % éch. 15/04/2034                                | 11 301                              | 12 934                           | 0,01                      | Madison Park Euro Funding DAC                     |                                     |                                  |                           |
| 3,034 % éch. 15/04/2034                       | 11 380                              | 13 020                           | 0,01                      | 3,084 % éch. 15/04/2034                                | 19 996                              | 22 891                           | 0,02                      | 2,905 % éch. 25/10/2030                           | € 2 448                             | 2 800                            | 0,00                      |
| 3,188 % éch. 10/11/2035                       | 23 100                              | 26 428                           | 0,02                      | 3,174 % éch. 15/01/2035                                | 20 000                              | 22 891                           | 0,02                      | 3,004 % éch. 15/07/2032                           | 65 186                              | 74 618                           | 0,06                      |
| Castlelake Aircraft Structured Trust          |                                     |                                  |                           | 3,204 % éch. 15/10/2034                                | 32 450                              | 37 155                           | 0,03                      | 3,024 % éch. 15/04/2032                           | 16 118                              | 18 442                           | 0,01                      |
| 5,465 % éch. 15/08/2050                       | \$ 46 754                           | 46 513                           | 0,04                      | 3,439 % éch. 15/10/2036                                | 31 500                              | 36 032                           | 0,03                      | 3,084 % éch. 15/07/2035                           | 19 249                              | 22 027                           | 0,02                      |
| 5,783 % éch. 15/02/2050                       | 24 097                              | 24 198                           | 0,02                      | FCT Ponant                                             |                                     |                                  |                           | 3,115 % éch. 27/07/2034                           | 32 988                              | 37 780                           | 0,03                      |
| CIFC European Funding CLO DAC                 |                                     |                                  |                           | 2,855 % éch. 27/09/2038                                | 8 880                               | 10 159                           | 0,01                      | Marble Point CLO Ltd.                             |                                     |                                  |                           |
| 3,188 % éch. 18/08/2035                       | € 32 392                            | 37 065                           | 0,03                      | Flexicommercial ABS Trust                              |                                     |                                  |                           | 4,667 % éch. 16/11/2034                           | \$ 36 000                           | 36 039                           | 0,03                      |
| 3,194 % éch. 23/11/2034                       | 31 130                              | 35 618                           | 0,03                      | 5,550 % éch. 14/06/2031                                | AUD 22 856                          | 15 876                           | 0,01                      | Margay CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |
|                                               |                                     |                                  |                           | Fondo de Titulizacion Santander Consumo                |                                     |                                  |                           | 3,439 % éch. 15/07/2037                           | € 33 700                            | 38 569                           | 0,03                      |
|                                               |                                     |                                  |                           | 2,865 % éch. 25/10/2040                                | € 97 000                            | 111 090                          | 0,09                      |                                                   |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>Marzio Finance SRL</b>                          |                                     |                                  |                           | <b>Raptor Aircraft Finance LLC</b>           |                                     |                                  |                           | <b>Tikehau U.S. CLO Ltd.</b>                      |                                     |                                  |                           |
| 2,641 % éch. 30/06/2050                            | € 32 314                            | \$ 36 997                        | 0,03                      | 4,213 % éch. 23/08/2044                      | \$ 23 260                           | \$ 22 269                        | 0,02                      | 4,767 % éch. 18/01/2035                           | \$ 38 000                           | \$ 38 018                        | 0,03                      |
| 2,751 % éch. 28/09/2049                            | 27 996                              | 32 098                           | 0,03                      | <b>RIN LLC</b>                               |                                     |                                  |                           | <b>Toro European CLO DAC</b>                      |                                     |                                  |                           |
| 2,801 % éch. 28/05/2049                            | 5 022                               | 5 763                            | 0,00                      | 5,044 % éch. 20/07/2037 (c)                  | 30 000                              | 30 000                           | 0,02                      | 3,093 % éch. 15/02/2034                           | € 3 201                             | 3 662                            | 0,00                      |
| <b>METAL Ltd.</b>                                  |                                     |                                  |                           | 5,344 % éch. 20/07/2037 (c)                  | 5 000                               | 5 000                            | 0,00                      | 3,155 % éch. 25/07/2034                           | 85 707                              | 98 062                           | 0,08                      |
| 4,581 % éch. 15/10/2042                            | \$ 20 803                           | 14 783                           | 0,01                      | 5,594 % éch. 20/07/2037 (c)                  | 5 500                               | 5 492                            | 0,00                      | 3,194 % éch. 15/07/2034                           | 44 368                              | 50 775                           | 0,04                      |
| <b>Mila BV</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>Riserva CLO Ltd.</b>                      |                                     |                                  |                           | 3,474 % éch. 15/04/2037                           | 25 000                              | 28 616                           | 0,02                      |
| 2,936 % éch. 16/09/2041                            | € 14 679                            | 16 816                           | 0,01                      | 4,725 % éch. 18/01/2034                      | 46 954                              | 46 976                           | 0,04                      | 4,154 % éch. 15/04/2037                           | 5 000                               | 5 724                            | 0,00                      |
| <b>Montmartre Euro CLO DAC</b>                     |                                     |                                  |                           | <b>Rockfield Park CLO DAC</b>                |                                     |                                  |                           | <b>Trapeza CDO Ltd.</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 3,164 % éch. 15/07/2034                            | 1 055                               | 1 208                            | 0,00                      | 3,143 % éch. 16/07/2034                      | € 19 117                            | 21 873                           | 0,02                      | 4,189 % éch. 09/11/2042                           | \$ 509                              | 494                              | 0,00                      |
| <b>MV Credit Euro CLO DAC</b>                      |                                     |                                  |                           | <b>Rockford Tower CLO Ltd.</b>               |                                     |                                  |                           | 4,280 % éch. 06/07/2041                           | 4 660                               | 4 473                            | 0,00                      |
| 3,583 % éch. 15/02/2038                            | 29 300                              | 33 524                           | 0,03                      | 5,004 % éch. 20/05/2031                      | \$ 204                              | 205                              | 0,00                      | 4,340 % éch. 06/07/2041                           | 9 000                               | 8 055                            | 0,01                      |
| <b>National Collegiate Student Loan Trust</b>      |                                     |                                  |                           | 5,097 % éch. 20/10/2031                      | 995                                 | 995                              | 0,00                      | <b>Trinitas CLO Ltd.</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 4,073 % éch. 25/05/2032                            | \$ 554                              | 553                              | 0,00                      | <b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b>         |                                     |                                  |                           | 4,675 % éch. 15/07/2034                           | 20 000                              | 20 010                           | 0,02                      |
| 4,113 % éch. 25/03/2033                            | 1 775                               | 1 770                            | 0,00                      | 3,038 % éch. 20/04/2034                      | € 2 425                             | 2 774                            | 0,00                      | 4,715 % éch. 20/07/2035                           | 44 800                              | 44 801                           | 0,04                      |
| 4,133 % éch. 25/06/2033                            | 405                                 | 403                              | 0,00                      | 3,121 % éch. 24/01/2035                      | 43 800                              | 50 886                           | 0,04                      | 4,727 % éch. 25/01/2035                           | 57 000                              | 57 047                           | 0,05                      |
| <b>Navient Private Education Loan Trust</b>        |                                     |                                  |                           | 3,489 % éch. 29/08/2036                      | 35 000                              | 40 062                           | 0,03                      | 4,777 % éch. 25/01/2034                           | 30 693                              | 30 719                           | 0,02                      |
| 5,190 % éch. 16/07/2040                            | 2 832                               | 2 839                            | 0,00                      | <b>RRE Loan Management DAC</b>               |                                     |                                  |                           | 4,785 % éch. 20/10/2033                           | 29 667                              | 29 688                           | 0,02                      |
| <b>Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC</b> |                                     |                                  |                           | 3,154 % éch. 15/01/2037                      | 19 013                              | 21 763                           | 0,02                      | 4,825 % éch. 20/10/2034                           | 45 500                              | 45 553                           | 0,04                      |
| 3,085 % éch. 25/10/2034                            | € 15 825                            | 18 083                           | 0,01                      | 3,494 % éch. 15/12/2039                      | 39 600                              | 45 297                           | 0,04                      | <b>Trinitas Euro CLO DAC</b>                      |                                     |                                  |                           |
| 3,414 % éch. 15/07/2039                            | 28 500                              | 32 624                           | 0,03                      | <b>Sabadell Consumo FT</b>                   |                                     |                                  |                           | 3,414 % éch. 15/07/2039                           | € 32 500                            | 37 228                           | 0,03                      |
| 3,964 % éch. 15/07/2039                            | 1 000                               | 1 145                            | 0,00                      | 3,085 % éch. 22/10/2035                      | 35 587                              | 40 777                           | 0,03                      | <b>Tropic CDO Ltd.</b>                            |                                     |                                  |                           |
| <b>North Westerly ESG CLO DAC</b>                  |                                     |                                  |                           | <b>SC Germany S.A., Compartment Consumer</b> |                                     |                                  |                           | 4,255 % éch. 15/07/2036                           | \$ 12 024                           | 11 694                           | 0,01                      |
| 3,123 % éch. 15/05/2034                            | 12 035                              | 13 752                           | 0,01                      | 2,779 % éch. 14/01/2038                      | 10 363                              | 11 861                           | 0,01                      | <b>Tymon Park CLO DAC</b>                         |                                     |                                  |                           |
| <b>OAK Hill European Credit Partners DAC</b>       |                                     |                                  |                           | 2,829 % éch. 14/05/2038                      | 30 148                              | 34 565                           | 0,03                      | 3,154 % éch. 21/07/2034                           | € 24 862                            | 28 442                           | 0,02                      |
| 3,184 % éch. 21/01/2035                            | 10 000                              | 11 447                           | 0,01                      | 2,859 % éch. 14/12/2038                      | 13 759                              | 15 778                           | 0,01                      | <b>VB-S1 Issuer LLC</b>                           |                                     |                                  |                           |
| <b>Ocean Trails CLO</b>                            |                                     |                                  |                           | <b>Sculptor European CLO DAC</b>             |                                     |                                  |                           | 4,693 % éch. 15/03/2056                           | \$ 166 000                          | 162 405                          | 0,13                      |
| 4,705 % éch. 20/07/2034                            | \$ 39 000                           | 39 018                           | 0,03                      | 3,028 % éch. 18/04/2034                      | 17 072                              | 19 503                           | 0,02                      | <b>Venture CLO Ltd.</b>                           |                                     |                                  |                           |
| 4,973 % éch. 15/10/2034                            | 1 000                               | 1 001                            | 0,00                      | 3,054 % éch. 15/04/2034                      | 23 801                              | 27 225                           | 0,02                      | 5,195 % éch. 15/01/2032                           | 1 347                               | 1 349                            | 0,00                      |
| <b>OCF Euro CLO DAC</b>                            |                                     |                                  |                           | 3,082 % éch. 10/10/2034                      | 34 200                              | 39 127                           | 0,03                      | <b>Voya Euro CLO DAC</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 3,058 % éch. 20/04/2033                            | € 13 170                            | 15 065                           | 0,01                      | 3,254 % éch. 15/10/2034                      | 31 856                              | 36 487                           | 0,03                      | 3,164 % éch. 15/07/2035                           | € 36 637                            | 41 913                           | 0,03                      |
| 3,158 % éch. 20/04/2035                            | 38 000                              | 43 484                           | 0,04                      | 3,365 % éch. 27/04/2038                      | 25 000                              | 28 629                           | 0,02                      | 3,174 % éch. 15/10/2034                           | 20 000                              | 22 881                           | 0,02                      |
| 3,468 % éch. 20/10/2039                            | 36 000                              | 41 191                           | 0,03                      | <b>SLM Private Credit Student Loan Trust</b> |                                     |                                  |                           | 3,244 % éch. 15/04/2035                           | 4 000                               | 4 577                            | 0,00                      |
| 3,478 % éch. 20/07/2036                            | 35 500                              | 40 620                           | 0,03                      | 4,256 % éch. 15/06/2039                      | \$ 6 582                            | 6 497                            | 0,01                      | <b>Whetstone Park CLO Ltd.</b>                    |                                     |                                  |                           |
| 3,513 % éch. 15/04/2037                            | 25 000                              | 28 582                           | 0,02                      | <b>SLM Student Loan Trust</b>                |                                     |                                  |                           | 4,745 % éch. 20/01/2035                           | \$ 45 000                           | 45 030                           | 0,04                      |
| 4,063 % éch. 15/04/2037                            | 10 000                              | 11 433                           | 0,01                      | 2,565 % éch. 25/10/2039                      | € 2 930                             | 3 135                            | 0,00                      | <b>Wingstop Funding LLC</b>                       |                                     |                                  |                           |
| <b>Palmer Square BDC CLO Ltd.</b>                  |                                     |                                  |                           | 2,715 % éch. 25/07/2039                      | 10 105                              | 10 947                           | 0,01                      | 5,858 % éch. 05/12/2054                           | 25 000                              | 25 253                           | 0,02                      |
| 5,273 % éch. 15/07/2037                            | \$ 36 800                           | 36 822                           | 0,03                      | 2,715 % éch. 25/01/2040                      | 19 766                              | 21 217                           | 0,02                      |                                                   |                                     | 8 324 152                        | 6,67                      |
| <b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>     |                                     |                                  |                           | 2,951 % éch. 15/12/2033                      | 5 665                               | 6 134                            | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,054 % éch. 15/10/2034                            | € 38 196                            | 43 665                           | 0,04                      | 4,542 % éch. 25/01/2075                      | \$ 9 648                            | 9 643                            | 0,01                      |                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,134 % éch. 15/07/2035                            | 33 324                              | 38 121                           | 0,03                      | 4,680 % éch. 25/04/2023                      | 254                                 | 254                              | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,150 % éch. 15/10/2035                            | 25 700                              | 29 418                           | 0,02                      | 5,630 % éch. 25/07/2023                      | 2 006                               | 2 014                            | 0,00                      |                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,253 % éch. 15/05/2033                            | 5 727                               | 6 555                            | 0,01                      | <b>SMB Private Education Loan Trust</b>      |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,253 % éch. 15/08/2033                            | 12 481                              | 14 286                           | 0,01                      | 3,500 % éch. 16/12/2041                      | 3 469                               | 3 427                            | 0,00                      | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b> |                                     |                                  |                           |
| 3,273 % éch. 15/05/2034                            | 25 662                              | 29 376                           | 0,02                      | 4,540 % éch. 15/02/2036                      | 151                                 | 151                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/05/2037                           | 1 363                               | 1 298                            | 0,00                      |
| 3,283 % éch. 15/05/2034                            | 18 135                              | 20 759                           | 0,02                      | <b>SoFi Alternative Trust</b>                |                                     |                                  |                           | 4,963 % éch. 25/06/2036                           | 616                                 | 618                              | 0,00                      |
| 3,754 % éch. 15/10/2034                            | 5 000                               | 5 716                            | 0,00                      | 4,833 % éch. 15/06/2050                      | 8 304                               | 7 852                            | 0,01                      | 5,598 % éch. 25/10/2036                           | 51                                  | 50                               | 0,00                      |
| 3,983 % éch. 15/08/2033                            | 12 200                              | 13 983                           | 0,01                      | 5,255 % éch. 16/05/2050                      | 8 704                               | 8 257                            | 0,01                      | 5,713 % éch. 25/11/2039                           | 382                                 | 442                              | 0,00                      |
| 4,100 % éch. 15/10/2035                            | 1 000                               | 1 145                            | 0,00                      | <b>Soloso CDO Ltd.</b>                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/10/2036                           | 2 314                               | 724                              | 0,00                      |
| 4,133 % éch. 15/05/2034                            | 6 350                               | 7 292                            | 0,01                      | 4,200 % éch. 07/10/2037                      | 2 776                               | 2 693                            | 0,00                      | 6,913 % éch. 25/12/2042                           | 467                                 | 592                              | 0,00                      |
| 4,173 % éch. 15/05/2034                            | 35 600                              | 40 831                           | 0,03                      | <b>Sound Point Euro CLO Funding DAC</b>      |                                     |                                  |                           | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>        |                                     |                                  |                           |
| <b>Penta CLO DAC</b>                               |                                     |                                  |                           | 3,085 % éch. 25/04/2035                      | € 6 000                             | 6 855                            | 0,01                      | 4,163 % éch. 25/11/2046                           | 1 923                               | 1 902                            | 0,00                      |
| 3,015 % éch. 25/07/2036                            | 19 000                              | 21 746                           | 0,02                      | 3,154 % éch. 15/04/2033                      | 3 281                               | 3 756                            | 0,00                      | 4,183 % éch. 25/01/2037                           | 1 485                               | 1 467                            | 0,00                      |
| 3,135 % éch. 25/07/2034                            | 15 988                              | 18 293                           | 0,01                      | 3,181 % éch. 24/10/2034                      | 9 500                               | 10 875                           | 0,01                      | 4,198 % éch. 25/11/2036                           | 1 875                               | 1 877                            | 0,00                      |
| 3,484 % éch. 15/01/2038                            | 20 000                              | 22 878                           | 0,02                      | <b>St. Paul's CLO DAC</b>                    |                                     |                                  |                           | 4,213 % éch. 25/01/2037                           | 434                                 | 417                              | 0,00                      |
| <b>Pepper Iberia Consumer</b>                      |                                     |                                  |                           | 2,994 % éch. 22/04/2035                      | 17 293                              | 19 793                           | 0,02                      | 4,228 % éch. 25/08/2036                           | 2 144                               | 2 016                            | 0,00                      |
| 3,142 % éch. 25/04/2037                            | 19 400                              | 22 176                           | 0,02                      | 3,090 % éch. 17/01/2032                      | 23 195                              | 26 541                           | 0,02                      | 4,243 % éch. 25/11/2036                           | 1 175                               | 1 124                            | 0,00                      |
| <b>Pikes Peak CLO</b>                              |                                     |                                  |                           | 3,124 % éch. 15/04/2033                      | 3 331                               | 3 789                            | 0,00                      | 4,258 % éch. 25/10/2036                           | 349                                 | 346                              | 0,00                      |
| 4,883 % éch. 15/07/2034                            | \$ 25 000                           | 25 028                           | 0,02                      | 3,145 % éch. 25/10/2035                      | 20 000                              | 22 885                           | 0,02                      | 4,438 % éch. 25/03/2037                           | 3 321                               | 3 306                            | 0,00                      |
| 4,895 % éch. 11/10/2034                            | 25 000                              | 25 030                           | 0,02                      | 3,354 % éch. 15/01/2032                      | 4 650                               | 5 326                            | 0,00                      | 5,830 % éch. 25/11/2034                           | 121                                 | 121                              | 0,00                      |
| <b>PK ALIFT Loan Funding LP</b>                    |                                     |                                  |                           | <b>START Ltd.</b>                            |                                     |                                  |                           | 6,352 % éch. 25/05/2036                           | 913                                 | 315                              | 0,00                      |
| 5,052 % éch. 15/10/2039                            | 21 010                              | 20 992                           | 0,02                      | 4,089 % éch. 15/03/2044                      | \$ 6 291                            | 6 311                            | 0,01                      | 6,851 % éch. 25/05/2036                           | 460                                 | 159                              | 0,00                      |
| <b>Planet Fitness Master Issuer LLC</b>            |                                     |                                  |                           | <b>Symphony CLO Ltd.</b>                     |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 25/05/2036                           | 9 763                               | 4 719                            | 0,01                      |
| 5,274 % éch. 06/12/2055                            | 10 873                              | 10 798                           | 0,01                      | 4,816 % éch. 23/10/2035                      | 32 900                              | 32 940                           | 0,03                      | <b>Curzon Mortgages PLC</b>                       |                                     |                                  |                           |
| <b>Plenti PL &amp; Green ABS Trust</b>             |                                     |                                  |                           | 4,823 % éch. 15/10/2035                      | 32 300                              | 32 341                           | 0,03                      | 4,592 % éch. 28/07/2049                           | £ 40 000                            | 53 110                           | 0,04                      |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                            | AUD 23 952                          | 16 576                           | 0,01                      | <b>Taberna Preferred Funding Ltd.</b>        |                                     |                                  |                           | <b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>         |                                     |                                  |                           |
| 5,486 % éch. 11/04/2036                            | 8 841                               | 6 134                            | 0,00                      | 4,280 % éch. 05/12/2036                      | 14 841                              | 13 802                           | 0,01                      | 3,878 % éch. 25/07/2036                           | \$ 710                              | 683                              | 0,00                      |
| <b>Project Silver</b>                              |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 05/11/2035                      | 9 562                               | 9 275                            | 0,01                      | 3,883 % éch. 25/11/2036                           | 5 203                               | 4 918                            | 0,01                      |
| 3,967 % éch. 15/07/2044                            | \$ 9 597                            | 9 341                            | 0,01                      | <b>Taco Bell Funding LLC</b>                 |                                     |                                  |                           | 3,883 % éch. 25/12/2036                           | 5 398                               | 5 123                            | 0,01                      |
| <b>Providus CLO DAC</b>                            |                                     |                                  |                           | 1,946 % éch. 25/08/2051                      | 36 614                              | 35 973                           | 0,03                      | 3,963 % éch. 25/03/2037                           | 7 397                               | 3 484                            | 0,01                      |
| 3,188 % éch. 18/07/2034                            | € 19 510                            | 22 331                           | 0,02                      | 2,294 % éch. 25/08/2051                      | 29 426                              | 27 452                           | 0,02                      | 3,983 % éch. 25/12/2037                           | 218                                 | 210                              | 0,00                      |
| 3,189 % éch. 20/05/2034                            | 37 000                              | 42 355                           | 0,03                      | 2,542 % éch. 25/08/2051                      | 15 612                              | 13 675                           | 0,01                      | 4,043 % éch. 25/12/2036                           | 11 892                              | 4 597                            | 0,01                      |
| 3,364 % éch. 15/10/2038                            | 25 000                              | 28 628                           | 0,02                      | <b>Tikehau CLO DAC</b>                       |                                     |                                  |                           | 4,052 % éch. 25/07/2034                           | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 3,374 % éch. 15/07/2038                            | 39 000                              | 44 594                           | 0,04                      | 3,184 % éch. 15/01/2035                      | € 10 000                            | 11 442                           | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/08/2036                           | 750                                 | 718                              | 0,00                      |
| 3,415 % éch. 20/11/2038                            | 18 300                              | 20 933                           | 0,02                      | 3,301 % éch. 07/09/2035                      | 5 800                               | 6 636                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                           | 562                                 | 265                              | 0,00                      |
| 3,513 % éch. 15/11/2039                            | 40 600                              | 46 472                           | 0,04                      | 3,404 % éch. 15/10/2038                      | 42 750                              | 48 959                           | 0,04                      | 4,073 % éch. 25/07/2036                           | 2 798                               | 2 717                            | 0,00                      |
| 3,995 % éch. 20/11/2038                            | 16 700                              | 19 126                           | 0,02                      | 3,458 % éch. 20/01/2037                      | 35 000                              | 40 085                           | 0,03                      | 4,073 % éch. 25/09/2036                           | 4 257                               | 4 020                            | 0,01                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 3,483 % éch. 20/04/2038                      | 28 000                              | 32 059                           | 0,03                      | 4,083 % éch. 25/04/2036                           | 3 388                               | 3 345                            | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           | 4,098 % éch. 20/04/2038                      | 7 000                               | 8 017                            | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/06/2036                           | 3 136                               | 3 107                            | 0,00                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/12/2037                           | 4 375                               | 4 067                            | 0,01                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/12/2037                           | 6 462                               | 6 004                            | 0,01                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                              |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/08/2036                           | 4 891                               | 4 709                            | 0,01                      |

## PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE

| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust |    |        |        |      |
|--------------------------------------------|----|--------|--------|------|
| 4,263 % éch. 25/05/2037                    |    | 1 363  | 1 298  | 0,00 |
| 4,963 % éch. 25/06/2036                    |    | 616    | 618    | 0,00 |
| 5,598 % éch. 25/10/2036                    |    | 51     | 50     | 0,00 |
| 5,713 % éch. 25/11/2039                    |    | 382    | 442    | 0,00 |
| 6,500 % éch. 25/10/2036                    |    | 2 314  | 724    | 0,00 |
| 6,913 % éch. 25/12/2042                    |    | 467    | 592    | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.        |    |        |        |      |
| 4,163 % éch. 25/11/2046                    |    | 1 923  | 1 902  | 0,00 |
| 4,183 % éch. 25/01/2037                    |    | 1 485  | 1 467  | 0,00 |
| 4,198 % éch. 25/11/2036                    |    | 1 875  | 1 877  | 0,00 |
| 4,213 % éch. 25/01/2037                    |    | 434    | 417    | 0,00 |
| 4,228 % éch. 25/08/2036                    |    | 2 144  | 2 016  | 0,00 |
| 4,243 % éch. 25/11/2036                    |    | 1 175  | 1 124  | 0,00 |
| 4,258 % éch. 25/10/2036                    |    | 349    | 346    | 0,00 |
| 4,438 % éch. 25/03/2037                    |    | 3 321  | 3 306  | 0,00 |
| 5,830 % éch. 25/11/2034                    |    | 121    | 121    | 0,00 |
| 6,352 % éch. 25/05/2036                    |    | 913    | 315    | 0,00 |
| 6,851 % éch. 25/05/2036                    |    | 460    | 159    | 0,00 |
| 7,250 % éch. 25/05/2036                    |    | 9 763  | 4 719  | 0,01 |
| Curzon Mortgages PLC                       |    |        |        |      |
| 4,592 % éch. 28/07/2049                    | £  | 40 000 | 53 110 | 0,04 |
| First Franklin Mortgage Loan Trust         |    |        |        |      |
| 3,878 % éch. 25/07/2036                    | \$ | 710    | 683    | 0,00 |
| 3,883 % éch. 25/11/2036                    |    | 5 203  | 4 918  | 0,01 |
| 3,883 % éch. 25/12/2036                    |    | 5 398  | 5 123  | 0,01 |
| 3,963 % éch. 25/03/2037                    |    | 7 397  | 3 484  | 0,01 |
| 3,983 % éch. 25/12/2037                    |    | 218    | 210    | 0,00 |
| 4,043 % éch. 25/12/2036                    |    | 11 892 | 4 597  | 0,01 |
| 4,052 % éch. 25/07/2034                    |    | 0      | 0      | 0,00 |
| 4,063 % éch. 25/08/2036                    |    | 750    | 718    | 0,00 |
| 4,063 % éch. 25/03/2037                    |    | 562    | 265    | 0,00 |
| 4,073 % éch. 25/07/2036                    |    | 2 798  | 2 717  | 0,00 |
| 4,073 % éch. 25/09/2036                    |    | 4 257  | 4 020  | 0,01 |
| 4,083 % éch. 25/04/2036                    |    | 3 388  | 3 345  | 0,00 |
| 4,083 % éch. 25/06/2036                    |    | 3 136  | 3 107  | 0,00 |
| 4,083 % éch. 25/12/2037                    |    | 4 375  | 4 067  | 0,01 |
| 4,183 % éch. 25/12/2037                    |    | 6 462  | 6 004  | 0,01 |
| 4,243 % éch. 25/08/2036                    |    | 4 891  | 4 709  | 0,01 |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,243 % éch. 25/10/2036                            | \$ 11 454                           | \$ 7 382                         | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement australien  |                                     |                                  |                           | Development Bank of Kazakhstan JSC                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/02/2036                            | 3 044                               | 2 882                            | 0,00                      | 1,750 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 18,400 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,438 % éch. 25/11/2035                            | 433                                 | 432                              | 0,00                      | 21/06/2051 AUD                                        | 204 800                             | \$ 72 914                        | 0,06                      | 16/10/2028 KZT                                                      | 58 906 000                          | \$ 128 295                       | 0,10                      |
| 4,453 % éch. 25/01/2036                            | 2 894                               | 2 717                            | 0,00                      | Baiterek National Investment Holding JSC              |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/08/2034                            | 494                                 | 472                              | 0,00                      | 16,950 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 10,500 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/11/2035                            | 1 891                               | 1 762                            | 0,00                      | 02/04/2029 KZT                                        | 65 946 500                          | 140 136                          | 0,11                      | 15/03/2037 DOP                                                      | 1 887 650                           | 33 845                           | 0,03                      |
| 4,513 % éch. 25/12/2035                            | 2 968                               | 2 880                            | 0,00                      | 16,950 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 10,750 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,573 % éch. 25/10/2035                            | 2 568                               | 3 157                            | 0,00                      | 02/04/2031                                            | 53 151 500                          | 114 453                          | 0,09                      | 01/06/2036                                                          | 287 400                             | 5 228                            | 0,00                      |
| 4,663 % éch. 25/07/2035                            | 610                                 | 606                              | 0,00                      | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos        |                                     |                                  |                           | Eagle Funding Luxco SARL                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,708 % éch. 25/06/2034                            | 460                                 | 457                              | 0,00                      | 4,700 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,708 % éch. 25/03/2035                            | 151                                 | 173                              | 0,00                      | 01/09/2030 CLP                                        | 13 530 000                          | 14 489                           | 0,01                      | 17/08/2030                                                          | \$ 508 800                          | 511 497                          | 0,41                      |
| 4,708 % éch. 25/09/2035                            | 2 797                               | 2 647                            | 0,00                      | 5,000 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                  |                                     |                                  |                           |
| 5,188 % éch. 25/10/2034                            | 232                                 | 234                              | 0,00                      | 01/03/2035                                            | 9 180 000                           | 9 701                            | 0,01                      | 19,698 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |
| 5,563 % éch. 25/09/2034                            | 1 213                               | 1 348                            | 0,00                      | 5,800 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 14/10/2030 EGP                                                      | 18 213 800                          | 352 938                          | 0,28                      |
| GSAMP Trust                                        |                                     |                                  |                           | 01/10/2029                                            | 21 210 000                          | 23 672                           | 0,02                      | 21,954 % éch.                                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,485 % éch. 25/11/2034                            | 700                                 | 681                              | 0,00                      | 5,800 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 04/03/2028                                                          | 12 282 700                          | 242 365                          | 0,19                      |
| 4,813 % éch. 25/06/2034                            | 654                                 | 657                              | 0,00                      | 6,000 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi   |                                     |                                  |                           |
| Lehman XS Trust                                    |                                     |                                  |                           | 01/04/2033                                            | 18 010 000                          | 20 231                           | 0,02                      | 4,625 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,963 % éch. 25/02/2037                            | 8 287                               | 7 952                            | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien   |                                     |                                  |                           | 20/04/2033                                                          | \$ 249 600                          | 248 788                          | 0,20                      |
| 4,073 % éch. 25/03/2037                            | 1 404                               | 1 344                            | 0,00                      | 4,000 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/05/2036                            | 2 572                               | 2 332                            | 0,00                      | 23/04/2030                                            | € 307 400                           | 352 726                          | 0,28                      | 30/04/2029                                                          | 101 400                             | 102 157                          | 0,08                      |
| 4,103 % éch. 25/10/2036                            | 1 227                               | 1 143                            | 0,00                      | 4,875 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,103 % éch. 25/12/2036                            | 2 738                               | 2 741                            | 0,00                      | 23/04/2033                                            | 98 600                              | 113 233                          | 0,09                      | 30/04/2034                                                          | 104 300                             | 106 085                          | 0,09                      |
| 4,183 % éch. 25/06/2046                            | 3 044                               | 2 931                            | 0,00                      | 5,500 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | Export-Import Bank of Korea                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,223 % éch. 25/02/2037                            | 2 597                               | 2 162                            | 0,00                      | 23/04/2036                                            | 98 100                              | 113 496                          | 0,09                      | 0,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,283 % éch. 25/05/2046                            | 1 288                               | 1 216                            | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement bulgare     |                                     |                                  |                           | 27/01/2027 (f)                                                      | 50 900                              | 100 140                          | 0,08                      |
| 4,283 % éch. 25/02/2047                            | 1 486                               | 1 378                            | 0,00                      | 4,125 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement israélien                 |                                     |                                  |                           |
| 4,343 % éch. 25/09/2036                            | 2 329                               | 2 429                            | 0,00                      | 07/05/2038                                            | 59 600                              | 68 359                           | 0,06                      | 5,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,961 % éch. 25/01/2036                            | 1 612                               | 1 445                            | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement colombien   |                                     |                                  |                           | 30/10/2026                                                          | € 473 300                           | 544 787                          | 0,44                      |
| 6,063 % éch. 25/12/2037                            | 641                                 | 664                              | 0,00                      | 1,000 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,260 % éch. 25/11/2035                            | 2 375                               | 1 083                            | 0,00                      | 22/08/2029 COP                                        | 178 100                             | 50                               | 0,00                      | 19/02/2030                                                          | \$ 102 800                          | 104 252                          | 0,08                      |
| 6,390 % éch. 25/04/2036                            | 8                                   | 12                               | 0,00                      | 26/03/2031                                            | 15 946 100                          | 3 817                            | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement japonais                  |                                     |                                  |                           |
| RAAC Trust                                         |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 1,800 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/06/2044                            | 728                                 | 675                              | 0,00                      | 19/09/2028                                            | € 33 300                            | 37 881                           | 0,03                      | 20/03/2054                                                          | ¥ 5 601 000                         | 22 139                           | 0,02                      |
| 5,063 % éch. 25/06/2047                            | 1 773                               | 1 731                            | 0,00                      | 4,500 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 2,100 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| Residential Asset Mortgage Products Trust          |                                     |                                  |                           | 26/11/2030                                            | 152 300                             | 174 718                          | 0,14                      | 20/09/2054                                                          | 20 806 050                          | 88 336                           | 0,07                      |
| 4,113 % éch. 25/10/2036                            | 2 486                               | 2 445                            | 0,00                      | 5,000 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,533 % éch. 25/02/2035                            | 931                                 | 931                              | 0,00                      | 19/09/2032                                            | 25 400                              | 28 877                           | 0,02                      | 20/06/2054                                                          | 2 483 000                           | 10 819                           | 0,01                      |
| 4,543 % éch. 25/09/2035                            | 923                                 | 904                              | 0,00                      | 5,375 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,738 % éch. 25/07/2035                            | 1 106                               | 1 047                            | 0,00                      | 21/01/2029                                            | \$ 113 100                          | 112 896                          | 0,09                      | 20/12/2054                                                          | 19 349 050                          | 86 148                           | 0,07                      |
| 4,783 % éch. 25/05/2035                            | 98                                  | 101                              | 0,00                      | 5,625 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,888 % éch. 25/06/2035                            | 2 280                               | 2 237                            | 0,00                      | 19/02/2036                                            | € 31 800                            | 36 156                           | 0,03                      | 20/03/2045                                                          | 10 094 000                          | 52 396                           | 0,04                      |
| 4,963 % éch. 25/01/2035                            | 1 689                               | 1 644                            | 0,00                      | 5,750 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust     |                                     |                                  |                           | 26/11/2034                                            | 55 300                              | 64 401                           | 0,05                      | 20/03/2055                                                          | 22 997 800                          | 104 867                          | 0,08                      |
| 3,923 % éch. 25/08/2036                            | 2 557                               | 817                              | 0,00                      | 6,125 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/05/2036                            | 6 488                               | 3 473                            | 0,00                      | 21/01/2031                                            | \$ 31 500                           | 31 845                           | 0,03                      | 20/09/2045                                                          | 16 876 300                          | 91 251                           | 0,07                      |
| 4,043 % éch. 25/09/2036                            | 2 865                               | 2 594                            | 0,00                      | 6,500 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/03/2036                            | 2 293                               | 1 456                            | 0,00                      | 21/01/2033                                            | 29 300                              | 29 798                           | 0,02                      | 20/09/2055                                                          | 126 150 000                         | 681 501                          | 0,55                      |
| 4,083 % éch. 25/09/2036                            | 1 339                               | 959                              | 0,00                      | 6,500 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/10/2036                            | 983                                 | 320                              | 0,00                      | 26/11/2038                                            | € 66 500                            | 80 057                           | 0,06                      | 20/12/2055                                                          | 47 618 850                          | 267 407                          | 0,21                      |
| 4,103 % éch. 25/08/2036                            | 11 312                              | 3 615                            | 0,01                      | TES colombien                                         |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/11/2035                            | 2 727                               | 2 374                            | 0,00                      | 6,500 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 20/03/2056                                                          | 11 180 000                          | 66 484                           | 0,05                      |
| 4,723 % éch. 25/01/2036                            | 401                                 | 387                              | 0,00                      | 22/01/2031 (h) COP                                    | 5 391 542                           | 1 550                            | 0,00                      | Obligation internationale du gouvernement du Koweït                 |                                     |                                  |                           |
| Specialty Underwriting & Residential Finance Trust |                                     |                                  |                           | 30/06/2032                                            | 27 102 400                          | 6 236                            | 0,01                      | 4,016 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,983 % éch. 25/09/2037                            | 2 914                               | 952                              | 0,00                      | 9,250 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 09/10/2028                                                          | \$ 109 100                          | 107 699                          | 0,09                      |
| 4,003 % éch. 25/04/2037                            | 652                                 | 481                              | 0,00                      | 28/05/2042                                            | 508 470 300                         | 120 087                          | 0,10                      | 4,804 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/09/2037                            | 5 584                               | 5 307                            | 0,01                      | 11,000 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 20/04/2033 (k)                                                      | 294 300                             | 293 802                          | 0,24                      |
| 4,063 % éch. 25/06/2037                            | 1 634                               | 990                              | 0,00                      | 11,000 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/11/2037                            | 7 675                               | 4 178                            | 0,01                      | 11,500 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,163 % éch. 25/04/2037                            | 2 454                               | 1 815                            | 0,00                      | 25/07/2046                                            | 215 249 100                         | 60 566                           | 0,05                      | 27/11/2031 (h) MXN                                                  | 5 377                               | 282                              | 0,00                      |
| 4,463 % éch. 25/03/2037                            | 1 775                               | 913                              | 0,00                      | 11,750 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,463 % éch. 25/04/2037                            | 350                                 | 259                              | 0,00                      | 24/01/2035                                            | 1 467 941 700                       | 418 188                          | 0,34                      | 03/12/2026 (h)                                                      | 2 733                               | 156                              | 0,00                      |
| 4,738 % éch. 25/12/2035                            | 237                                 | 237                              | 0,00                      | 12,000 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,933 % éch. 25/12/2035                            | 478                                 | 474                              | 0,00                      | 13/03/2058                                            | 20 516 900                          | 5 883                            | 0,01                      | 19/09/2029                                                          | € 146 600                           | 166 520                          | 0,13                      |
| Valerie Asset Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | 12,500 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,219 % éch.                                       |                                     |                                  |                           | 27/02/2030                                            | 871 809 900                         | 254 473                          | 0,20                      | 30/11/2028 (h) MXN                                                  | 68 582                              | 3 926                            | 0,00                      |
| 15/09/2050 (k)                                     | 87 573                              | 86 146                           | 0,07                      | 12,750 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,267 % éch.                                       |                                     |                                  |                           | 28/11/2040                                            | 1 265 360 500                       | 382 892                          | 0,31                      | 4,625 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 15/09/2050 (k)                                     | 12 433                              | 11 176                           | 0,01                      | 13,250 % éch.                                         |                                     |                                  |                           | 04/05/2033                                                          | € 37 400                            | 43 650                           | 0,04                      |
|                                                    |                                     | 320 527                          | 0,26                      | 09/02/2033                                            | 1 150 300 900                       | 352 055                          | 0,28                      | 5,625 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     | 13 527 207                       | 10,84                     | Obligation internationale du gouvernement costaricain |                                     |                                  |                           | 09/02/2034                                                          | \$ 130 600                          | 128 674                          | 0,10                      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin |                                     |                                  |                           | 21/11/2030                                            | € 94 000                            | 113 074                          | 0,09                      | 27/08/2037                                                          | 93 800                              | 93 921                           | 0,08                      |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                            | 271 393                             | 196 684                          | 0,16                      | 5,950 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 09/07/2029                            | 12 753                              | 11 637                           | 0,01                      | 27/04/2033                                            | 96 000                              | 117 096                          | 0,09                      | 26/05/2033                                                          | MXN 236 300                         | 12 645                           | 0,01                      |
| 3,500 % éch. 09/07/2041                            | 198 256                             | 148 692                          | 0,12                      | 6,001 % éch.                                          |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                            | 278 448                             | 218 267                          | 0,18                      | 16/01/2036                                            | 129 750                             | 157 063                          | 0,13                      | 29/05/2031                                                          | 3 844 000                           | 213 900                          | 0,17                      |
| 4,125 % éch. 09/07/2046                            | 7 501                               | 5 753                            | 0,01                      |                                                       |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 09/01/2038                            | 115 791                             | 96 917                           | 0,08                      |                                                       |                                     |                                  |                           | 01/03/2029                                                          | 3 207 000                           | 186 298                          | 0,15                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch.                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 31/05/2029                                                          | 1 375 000                           | 79 788                           | 0,06                      |



| DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JU<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | ACTIONS        | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|----------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                    |                                     |                               |                           | 12,750 % éch. 23/08/2022 ^                                          | \$ 6 170                            | \$ 3 455                         | 0,00                      | SVB Financial Trust                  |                |                                  |                           |      |
| 5,350 % éch. 12/08/2040                                               | PEN 12 700                          | \$ 3 253                      | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 07/11/2032             | 300            | \$ 138                           | 0,00                      |      |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                                               | 168 441                             | 48 276                        | 0,04                      |                                                                     |                                     | 15 017 318                       | 12,04                     | Windstream Holdings LLC              |                |                                  |                           |      |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                                               | 1 520 140                           | 482 841                       | 0,39                      | ACTIONS                                                             |                                     |                                  |                           | 11,000 %                             | 15 471         | 17 246                           | 0,02                      |      |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                                               | 564 060                             | 174 098                       | 0,14                      | ACTIONS ORDINAIRES                                                  |                                     |                                  |                           |                                      |                | 19 905                           | 0,02                      |      |
| 6,900 % éch. 12/08/2037                                               | 310 217                             | 93 228                        | 0,08                      | SERVICES DE COMMUNICATION                                           |                                     |                                  |                           | SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER |                |                                  |                           |      |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                                               | 1 234 739                           | 411 927                       | 0,33                      | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (e)                            | 26 868 244                          | 65 021                           | 0,05                      | VICI Properties, Inc.                | 5 793 243      | 153 811                          | 0,12                      |      |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                               | 1 314 800                           | 431 984                       | 0,35                      | iHeartMedia, Inc. « A » (e)                                         | 5 585 956                           | 23 964                           | 0,02                      |                                      |                |                                  |                           |      |
| 7,600 % éch. 12/08/2039                                               | 331 200                             | 104 340                       | 0,08                      | iHeartMedia, Inc. « B » (e)                                         | 4 913 662                           | 18 129                           | 0,02                      | INSTRUMENTS A COURT TERME            |                |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                      |                                     |                               |                           | Incora (e)(k)                                                       | 339 313                             | 13 375                           | 0,01                      | BILLET A COURT TERME                 |                |                                  |                           |      |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                               | \$ 196 300                          | 197 355                       | 0,16                      | SES S.A. (e)                                                        | 4 659 508                           | 70 475                           | 0,06                      | Discovery Global Holdings, Inc.      | \$ 23 275      | 23 128                           | 0,02                      |      |
| Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique |                                     |                               |                           | Uniti Group, Inc. (e)                                               | 437 955                             | 5 023                            | 0,00                      | Kona Spc Ltd.                        |                |                                  |                           |      |
| 3,750 % éch. 30/01/2028                                               | € 4 618                             | 5 378                         | 0,00                      |                                                                     |                                     | 195 987                          | 0,16                      | 5,718 % éch. 15/09/2026              | € 27 500       | 31 453                           | 0,02                      |      |
| 3,900 % éch. 30/01/2033                                               | 9 948                               | 11 883                        | 0,01                      | SERVICES FINANCIERS                                                 |                                     |                                  |                           |                                      |                | 54 581                           | 0,04                      |      |
| 4,000 % éch. 30/01/2037                                               | 6 211                               | 7 367                         | 0,01                      | Adler Group S.A. (e)                                                | 250 790                             | 0                                | 0,00                      | BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN              |                |                                  |                           |      |
| 4,200 % éch. 30/01/2042                                               | 3 488                               | 4 134                         | 0,00                      | Cairo Mezz PLC (e)                                                  | 3 408 327                           | 945                              | 0,00                      | 23,650 % éch. 13/10/2026             |                |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement roumain                     |                                     |                               |                           | Corestate Capital Holding S.A. (e)(k)                               | 2 109 837                           | 0                                | 0,00                      | (f)(g)                               | EGP 834 200    | 15 919                           | 0,01                      |      |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                                               | 1 700                               | 1 766                         | 0,00                      | MNSN Holdings, Inc. (e)(k)                                          |                                     | 22                               | 0,00                      | 23,799 % éch. 22/09/2026             |                | 995 900                          | 19 258                    | 0,02 |
| 2,000 % éch. 14/04/2033                                               | 8 700                               | 8 185                         | 0,01                      | UBS Group AG                                                        | 126 509                             | 6 280                            | 0,01                      | 24,000 % éch. 13/10/2026             |                | 161 900                          | 3 090                     | 0,00 |
| 3,500 % éch. 03/04/2034                                               | 6 800                               | 6 945                         | 0,01                      | XBP Global Holdings, Inc. (e)                                       | 45 877                              | 107                              | 0,00                      | 24,449 % éch. 04/08/2026             | (f)(g)         | 287 200                          | 5 715                     | 0,01 |
| 5,125 % éch. 24/09/2031                                               | 78 000                              | 91 219                        | 0,07                      |                                                                     |                                     | 7 354                            | 0,01                      |                                      |                | 43 982                           | 0,04                      |      |
| 5,250 % éch. 10/03/2030                                               | 137 400                             | 163 217                       | 0,13                      | SOINS DE SANTÉ                                                      |                                     |                                  |                           | BONS DU TRÉSOR NIGÉRIEN              |                |                                  |                           |      |
| 5,250 % éch. 30/05/2032                                               | 88 600                              | 103 424                       | 0,08                      | Amsurg Escrow (e)                                                   | 3 513 233                           | 3 267                            | 0,00                      | 21,097 % éch. 07/07/2026             |                |                                  |                           |      |
| 5,375 % éch. 22/03/2031                                               | 74 260                              | 88 028                        | 0,07                      | INDUSTRIE                                                           |                                     |                                  |                           | (f)(g)                               | NGN 10 241 000 | 7 441                            | 0,01                      |      |
| 5,375 % éch. 07/06/2033                                               | 41 500                              | 47 938                        | 0,04                      | DreamWell Ltd. (e)(k)                                               | 421                                 | 3                                | 0,00                      | 21,137 % éch. 06/10/2026             |                | 3 977 258                        | 2 743                     | 0,00 |
| 5,625 % éch. 30/05/2037                                               | 45 300                              | 51 108                        | 0,04                      | Sierra Hamilton Holder LLC (e)(k)                                   | 2 210 032                           | 0                                | 0,00                      | (f)(g)                               |                | 9 943 139                        | 7 183                     | 0,01 |
| 6,250 % éch. 10/09/2034                                               | 125 400                             | 151 508                       | 0,12                      | SSB Manufacturing Co. (e)(k)                                        | 421                                 | 0                                | 0,00                      | 21,241 % éch. 14/07/2026             | (f)(g)         |                                  |                           |      |
| 6,375 % éch. 18/09/2033                                               | 73 670                              | 89 818                        | 0,07                      | Westmoreland Mining LLC (e)(k)                                      | 50 992                              | 134                              | 0,00                      | 21,322 % éch. 28/07/2026             | (f)(g)         | 4 772 706                        | 3 420                     | 0,00 |
| 6,750 % éch. 11/07/2039                                               | 89 900                              | 109 112                       | 0,09                      | Westmoreland Mining LLC « L » (e)(k)                                | 51 186                              | 34                               | 0,00                      | 21,450 % éch. 07/07/2026             | (f)(g)         | 12 801 200                       | 9 302                     | 0,01 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien                    |                                     |                               |                           |                                                                     |                                     | 171                              | 0,00                      | 21,480 % éch. 28/07/2026             | (f)(g)         | 5 965 900                        | 4 275                     | 0,00 |
| 4,125 % éch. 12/01/2029                                               | \$ 271 000                          | 267 138                       | 0,21                      | TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION                                       |                                     |                                  |                           | 21,587 % éch. 04/08/2026             | (f)(g)         | 2 329 700                        | 1 661                     | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                |                                     |                               |                           | Unity Bancorp, Inc. (e)                                             | 2 425 142                           | 27 816                           | 0,02                      | 21,625 % éch. 11/08/2026             | (f)(g)         | 23 352 000                       | 16 592                    | 0,01 |
| 6,250 % éch. 31/03/2036                                               | ZAR 709 000                         | 37 085                        | 0,03                      | IMMOBILIER                                                          |                                     |                                  |                           | 21,638 % éch. 11/08/2026             | (f)(g)         | 15 361 400                       | 10 914                    | 0,01 |
| 7,000 % éch. 28/02/2031                                               | 5 116 300                           | 301 521                       | 0,24                      | Country Garden Holdings Co. Ltd. (e)                                | 9 001 909                           | 193                              | 0,00                      | 21,659 % éch. 25/08/2026             | (f)(g)         | 8 960 800                        | 6 318                     | 0,01 |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                               | 582 800                             | 35 857                        | 0,03                      | Kaisa Group Holdings Ltd. (e)                                       | 4 274 544                           | 26                               | 0,00                      | 21,675 % éch. 18/08/2026             | (f)(g)         | 5 120 500                        | 3 624                     | 0,00 |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                               | 2 750 700                           | 167 192                       | 0,13                      |                                                                     |                                     | 219                              | 0,00                      | (f)(g)                               |                | 21,676 % éch. 11/08/2026         |                           |      |
| 8,750 % éch. 28/02/2035                                               | 11 056 410                          | 699 097                       | 0,56                      | BONS DE SOUSCRIPTION                                                |                                     |                                  |                           | 21,690 % éch. 07/07/2026             | (f)(g)         | 11 676 100                       | 8 484                     | 0,01 |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                               | 3 529 340                           | 217 835                       | 0,18                      | Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071 (k) | 4                                   | 0                                | 0,00                      | 21,699 % éch. 25/08/2026             | (f)(g)         | 7 005 700                        | 4 940                     | 0,00 |
| 9,875 % éch. 31/03/2039                                               | 533 400                             | 35 221                        | 0,03                      | Windstream Holdings II LLC - Exp. 01/08/2035                        | 472 430                             | 5 414                            | 0,00                      | 21,704 % éch. 01/09/2026             | (f)(g)         | 7 005 700                        | 4 922                     | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement turc                        |                                     |                               |                           |                                                                     |                                     | 5 414                            | 0,00                      |                                      |                | 101 751                          | 0,08                      |      |
| 5,250 % éch. 13/03/2030                                               | \$ 107 900                          | 104 852                       | 0,08                      | TITRES PRIVILÉGIÉS                                                  |                                     |                                  |                           | BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN          |                |                                  |                           |      |
| 6,125 % éch. 24/10/2028                                               | 28 000                              | 28 284                        | 0,02                      | Clover Holdings, Inc. 0,000 % (k)                                   | 23 175                              | 444                              | 0,00                      | 7,046 % éch. 27/01/2027 (f)(g)       | ZAR 1 135 900  | 66 642                           | 0,05                      |      |
| 7,625 % éch. 26/04/2029                                               | 91 000                              | 95 137                        | 0,08                      | Nationwide Building Society 10,250 %                                | 12 140                              | 2 077                            | 0,00                      | 7,066 % éch. 28/10/2026 (f)(g)       |                | 93 200                           | 5 567                     | 0,00 |
| 40,305 % éch. 06/09/2028                                              | TRY 297 400                         | 6 408                         | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,304 % éch. 19/08/2026 (f)(g)       |                | 537 000                          | 32 484                    | 0,03 |
| 40,760 % éch. 19/08/2026                                              | 27 100                              | 583                           | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,305 % éch. 18/11/2026 (f)(g)       |                | 934 900                          | 55 622                    | 0,05 |
| 40,760 % éch. 17/05/2028                                              | 6 207 700                           | 134 330                       | 0,11                      |                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,393 % éch. 22/07/2026 (f)(g)       |                | 1 047 800                        | 63 717                    | 0,05 |
| Türkiye İhracat Kredi Bankası A/Ş                                     |                                     |                               |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,400 % éch. 05/08/2026 (f)(g)       |                | 148 400                          | 9 000                     | 0,01 |
| 6,875 % éch. 03/07/2028                                               | \$ 18 400                           | 18 692                        | 0,02                      |                                                                     |                                     |                                  |                           | 7,400 % éch. 07/10/2026 (f)(g)       |                | 37 200                           | 2 230                     | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien                   |                                     |                               |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2030                                               | 547                                 | 394                           | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2034                                               | 2 044                               | 1 160                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2035                                               | 1 727                               | 1 042                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2036                                               | 13                                  | 8                             | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 0,000 % éch. 01/02/2036 (l)                                           | 1 426                               | 859                           | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2034                                               | 2 537                               | 1 788                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2035                                               | 3 538                               | 2 459                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 4,500 % éch. 01/02/2036                                               | 3 936                               | 2 701                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien                 |                                     |                               |                           |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 6,000 % éch. 09/12/2020 ^                                             | 9 289                               | 3 971                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 7,000 % éch. 31/03/2038 ^                                             | 14 628                              | 6 436                         | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 7,650 % éch. 21/04/2025 ^                                             | 30 067                              | 13 530                        | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 7,750 % éch. 13/10/2019 ^                                             | 5 850                               | 2 602                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 8,250 % éch. 13/10/2024 ^                                             | 39 772                              | 18 096                        | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 9,000 % éch. 07/05/2023 ^                                             | 13 516                              | 6 420                         | 0,01                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 9,250 % éch. 15/09/2027 ^                                             | 41 619                              | 20 549                        | 0,02                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 9,250 % éch. 07/05/2028 ^                                             | 54 776                              | 26 429                        | 0,02                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 11,750 % éch. 21/10/2026 ^                                            | 5 690                               | 3 130                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |
| 11,950 % éch. 05/08/2031 ^                                            | 6 300                               | 3 433                         | 0,00                      |                                                                     |                                     |                                  |                           |                                      |                |                                  |                           |      |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS      | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------|---------------------------|
| 7,401 % éch.<br>05/08/2026 (f)(g)   | \$ 594 800                          | \$ 36 073                        | 0,03                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                                                 |              |                                  |                           |
| 7,420 % éch.<br>04/11/2026 (f)(g)   | 17 500                              | 1 044                            | 0,00                      | PIMCO ETFs plc -<br>Fonds PIMCO<br>US Dollar Short<br>Maturity UCITS<br>ETF (i) | 2 903 000    | \$ 291 694                       | 0,23                      |
| Total des Instruments à court terme |                                     | 472 693                          | 0,38                      |                                                                                 |              |                                  |                           |
| Total des Valeurs mobilières        | \$ 171 706 134                      | 137,63                           |                           | Total des Fonds d'investissement                                                | \$ 2 520 685 | 2,02                             |                           |

| ACTIONS                                                                                      |             |           |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|-----------|------|
| FONDS D'INVESTISSEMENT<br>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF                                  |             |           |      |
| PIMCO Select Funds<br>plc - Fonds PIMCO<br>US Dollar Short-<br>Term Floating NAV<br>Fund (i) | 223 518 705 | 2 228 991 | 1,79 |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | Garantie<br>(reçue)                                                                                                                        | Contrats de<br>mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|--------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BAR          | 0,150 %         | 30/06/2026           | 13/07/2026         | \$ 190 459              | Barclays Bank PLC 4,050 % échéance 02/09/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | \$ (190 380)                                                                                                                               | \$ 190 459                                        | \$ 190 459                                                                     | 0,15                   |
| BOM          | 2,240           | 10/06/2026           | 07/07/2026         | CAD 400 000             | Hydro-Québec 0,000 % échéance 15/02/2045<br>Province de l'Ontario<br>0,000 % - 3,750 % échéance 02/06/2041 - 02/12/2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | (19 981)<br>(272 823)<br>(8 011)                                                                                                           | 281 938                                           | 282 304                                                                        | 0,23                   |
|              | 2,240           | 16/06/2026           | 07/07/2026         | 550 000                 | Hydro-Québec 0,000 % échéance 15/08/2045<br>Province de Colombie-Britannique<br>0,000 % échéance 18/12/2055<br>Province du Manitoba 0,000 % échéance 05/09/2045<br>Province du Nouveau-Brunswick<br>3,550 % - 4,450 % échéance 14/08/2033 - 03/06/2043<br>Province de l'Ontario<br>0,000 % - 4,650 % échéance 02/06/2032 - 02/06/2048<br>Province du Québec<br>2,850 % - 3,250 % échéance 01/09/2032 - 01/12/2053                                                                                                                                                                                                                                                     | (23 266)<br>(11 073)<br>(84 464)<br>(190 443)<br>(80 213)                                                                                  | 387 665                                           | 388 023                                                                        | 0,31                   |
|              | 2,240           | 16/06/2026           | 14/07/2026         | 550 000                 | Hydro-Québec<br>0,000 % - 4,000 % échéance 01/12/2038 - 15/02/2063<br>Province du Manitoba 0,000 % échéance 05/03/2063<br>Province de l'Ontario<br>0,000 % - 4,150 % échéance 02/06/2035 - 02/12/2054<br>Province du Québec<br>3,500 % échéance 01/12/2045 - 01/12/2048                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | (110 786)<br>(9 353)<br>(228 684)<br>(50 032)                                                                                              | 387 665                                           | 388 023                                                                        | 0,31                   |
|              | 2,260           | 25/06/2026           | 06/07/2026         | 500 000                 | Hydro-Québec<br>0,000 % - 6,000 % échéance 15/02/2040 -15/02/2050<br>Province du Nouveau-Brunswick 4,800 %<br>échéance 03/06/2041<br>Province de l'Ontario<br>0,000 % - 2,900 % échéance 02/06/2035 - 02/12/2055<br>Province du Québec 4,400 % échéance 01/12/2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | (106 827)<br>(25 833)<br>(185 166)<br>(40 937)                                                                                             | 352 423                                           | 352 554                                                                        | 0,28                   |
| BPS          | 3,880           | 21/05/2026           | 08/07/2026         | \$ 9 488                | Walmart, Inc. 3,050 % échéance 08/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | (10 145)                                                                                                                                   | 9 488                                             | 9 529                                                                          | 0,01                   |
|              | 3,880           | 21/05/2026           | 20/08/2026         | 229 343                 | Advanced Micro Devices, Inc.<br>4,212 % échéance 24/09/2026<br>AerCap Ireland Capital DAC<br>3,300 % échéance 30/01/2032<br>Apple, Inc. 3,450 % échéance 09/02/2045<br>Broadcom Corp. 3,500 % échéance 15/01/2028<br>Broadcom, Inc. 4,150 % échéance 15/11/2030<br>Citibank N.A. 4,576 % échéance 29/05/2027<br>Citigroup, Inc. 2,520 % échéance 03/11/2032<br>Constellation Brands, Inc. 2,250 % échéance 01/08/2031<br>Goldman Sachs Group, Inc. 2,615 % échéance 22/04/2032<br>Intercontinental Exchange, Inc.<br>1,850 % échéance 15/09/2032<br>JPMorgan Chase & Co. 2,580 % échéance 22/04/2032<br>Shell International Finance BV<br>2,500 % échéance 12/09/2026 | (11 129)<br>(9 282)<br>(5 319)<br>(14 044)<br>(14 767)<br>(14 032)<br>(35 460)<br>(29 445)<br>(35 934)<br>(32 879)<br>(27 192)<br>(13 960) | 229 343                                           | 230 310                                                                        | 0,18                   |
|              | 3,880           | 29/05/2026           | 20/08/2026         | 9 013                   | Enbridge, Inc. 2,500 % échéance 01/08/2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | (9 499)                                                                                                                                    | 9 013                                             | 9 045                                                                          | 0,01                   |
|              | 3,880           | 29/06/2026           | 20/08/2026         | 167 675                 | Amazon.com, Inc. 3,850 % échéance 13/03/2028<br>Bank of America Corp. 5,045 % échéance 06/02/2037<br>Cigna Group 5,250 % échéance 15/01/2036<br>ENEL Finance International NV<br>3,500 % échéance 06/04/2028<br>Fifth Third Bancorp 6,339 % échéance 27/07/2029<br>Siemens Financieringsmaatschappij NV<br>1,700 % échéance 11/03/2028<br>UBS AG 4,864 % échéance 10/01/2028<br>Westpac Banking Corp. 4,150 % échéance 11/05/2028                                                                                                                                                                                                                                     | (18 090)<br>(26 145)<br>(26 706)<br>(24 747)<br>(37 122)<br>(17 325)<br>(15 388)<br>(11 022)                                               | 167 675                                           | 167 711                                                                        | 0,13                   |

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                                                                                                       | Garantie (reçue)         | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BUS                                   | 2,240 %      | 16/06/2026        | 07/07/2026      | CAD 2 260 000        | Province de l'Ontario 4,150 % échéance 02/12/2054<br>Province du Québec 3,100 % - 4,400 % échéance 01/12/2051 - 01/12/2055                        | \$ (290 479)             | \$ 1 592 952                             | \$ 1 595 953                                                       | 1,28                |
|                                       | 2,240        | 26/06/2026        | 07/07/2026      | 600 000              | Province de l'Ontario 3,450 % échéance 02/06/2045<br>Province du Québec 2,850 % échéance 01/12/2053                                               | (1 400 040)<br>(287 984) | 422 907                                  | 423 589                                                            | 0,34                |
| CEW                                   | 2,240        | 18/06/2026        | 02/07/2026      | 130 000              | Province de l'Ontario 3,750 % - 4,600 % échéance 02/12/2053 - 02/12/2056                                                                          | (93 887)                 | 91 630                                   | 91 703                                                             | 0,07                |
|                                       | 2,270        | 25/06/2026        | 02/07/2026      | 800 000              | Province de l'Ontario 1,900 % - 2,800 % échéance 02/06/2048 - 02/12/2051<br>Province du Québec 4,200 % - 4,400 % échéance 01/12/2055 - 01/12/2057 | (173 435)<br>(403 342)   | 563 878                                  | 564 087                                                            | 0,45                |
| RBC                                   | 2,250        | 18/06/2026        | 02/07/2026      | 650 000              | Province de l'Ontario 3,900 % échéance 02/06/2036                                                                                                 | (474 423)                | 458 150                                  | 458 517                                                            | 0,37                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                                                                                                                   | \$ (5 295 977)           | \$ 5 145 186                             | \$ 5 151 807                                                       | 4,12                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

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

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

##### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2027           | 33 453             | \$ (78 866)                       | (0,06)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2028           | 49 812             | (98 785)                          | (0,08)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2026           | 33 453             | (48 742)                          | (0,04)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2027           | 38 138             | (101 219)                         | (0,08)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars                                          | Long  | 06/2027           | 16 494             | (40 326)                          | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                     | Long  | 12/2026           | 33 453             | (69 302)                          | (0,06)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                     | Long  | 12/2027           | 25 471             | (55 223)                          | (0,04)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026           | 39 193             | 42 954                            | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026           | 3 071              | (1 598)                           | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 12 791             | (16 774)                          | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026           | 46                 | (5)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Court | 09/2026           | 32 157             | 5 974                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 38 284             | 7 341                             | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 182 972            | 157 606                           | 0,13                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 26 910             | (24 483)                          | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 14 936             | (35 381)                          | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 69 677             | 204 135                           | 0,16                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 55 324             | 152 248                           | 0,12                |
|                                                                                               |       |                   |                    | \$ (446)                          | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | \$ (446)                          | 0,00                |

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

##### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc.                      | 1,000 %              | 20/12/2027      | \$ 57 700                        | \$ (111)                          | 0,00                |
| AT&T, Inc.                      | 1,000                | 20/06/2028      | 29 400                           | 516                               | 0,00                |
| Bank of America Corp.           | 1,000                | 20/12/2026      | 131 400                          | (1 135)                           | 0,00                |
| Barclays PLC                    | 1,000                | 20/12/2030      | € 16 200                         | 8                                 | 0,00                |
| Boeing Co.                      | 1,000                | 20/12/2029      | \$ 700                           | 18                                | 0,00                |
| Boeing Co.                      | 1,000                | 20/12/2030      | 24 400                           | 15                                | 0,00                |
| Crédit Agricole S.A.            | 1,000                | 20/12/2030      | € 30 000                         | 211                               | 0,00                |
| Danske Bank A/S                 | 1,000                | 20/12/2030      | 51 600                           | 108                               | 0,00                |
| Deutsche Bank AG                | 1,000                | 20/12/2029      | 148 900                          | 2 796                             | 0,00                |
| Deutsche Bank AG                | 1,000                | 20/12/2030      | 25 900                           | 27                                | 0,00                |
| Deutsche Bank AG                | 1,000                | 20/12/2031      | 18 100                           | 571                               | 0,00                |
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 25 100                        | 144                               | 0,00                |
| Ford Motor Co.                  | 5,000                | 20/12/2026      | 4 400                            | (444)                             | 0,00                |
| Ford Motor Co.                  | 5,000                | 20/06/2027      | 3 300                            | (174)                             | 0,00                |
| Ford Motor Co.                  | 5,000                | 20/12/2028      | 15 700                           | (678)                             | 0,00                |
| Ford Motor Credit Co. LLC       | 5,000                | 20/06/2027      | 11 500                           | (718)                             | 0,00                |
| General Electric Co.            | 1,000                | 20/12/2026      | 6 700                            | (52)                              | 0,00                |
| Lloyds Banking Group PLC        | 1,000                | 20/12/2030      | € 3 300                          | (1)                               | 0,00                |
| MetLife, Inc.                   | 1,000                | 20/06/2031      | \$ 19 400                        | 110                               | 0,00                |
| Oracle Corp.                    | 1,000                | 20/12/2028      | 13 900                           | 61                                | 0,00                |
| Oracle Corp.                    | 1,000                | 20/06/2030      | 95 700                           | (3 524)                           | 0,00                |
| Prudential Financial, Inc.      | 1,000                | 20/06/2031      | 30 100                           | 202                               | 0,00                |
| Rolls-Royce PLC                 | 1,000                | 20/12/2026      | € 114 700                        | 6 424                             | 0,01                |
| Rolls-Royce PLC                 | 1,000                | 20/06/2027      | 18 100                           | 1 807                             | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Entité de référence          | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Stellantis NV                | 5,000 %                 | 20/12/2030         | € 6 200                             | \$ (179)                                | 0,00                   |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                   | 20/12/2026         | \$ 32 300                           | (632)                                   | 0,00                   |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                   | 20/06/2028         | 36 150                              | 502                                     | 0,00                   |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                   | 20/12/2028         | 7 100                               | 118                                     | 0,00                   |
| Electricité de France S.A.   | 1,000                   | 20/06/2030         | € 33 300                            | 343                                     | 0,00                   |
|                              |                         |                    |                                     | \$ 6 333                                | 0,01                   |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %                | 20/12/2030         | \$ 687 980                          | \$ (1 438)                              | 0,00                   |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans             | 1,000 %                 | 20/12/2026         | \$ 493 028                          | \$ 39 261                               | 0,03                   |
| Indice CDX.EM-37 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2027         | 6 958                               | 614                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2027         | 62 500                              | 5 775                                   | 0,01                   |
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2028         | 9 100                               | 697                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2028         | 151 600                             | 8 283                                   | 0,01                   |
| Indice CDX.EM-41 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2029         | 48 800                              | 2 208                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-42 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2029         | 69 200                              | 2 359                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-43 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2030         | 5 700                               | 212                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2030         | 22 000                              | 418                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 21 000                              | 538                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-37 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2026         | 145 065                             | (5 041)                                 | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-38 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2027         | 26 315                              | 1 016                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2027         | 27 552                              | 537                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-43 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2029         | 41 768                              | (567)                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-43 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2029         | 79 674                              | 719                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2030         | 21 658                              | 125                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2030         | 1 937 994                           | (16 219)                                | (0,01)                 |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2030         | 3 356 196                           | 1 075                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2031         | 3 924 756                           | 86 705                                  | 0,07                   |
| Indice CDX.IG-37 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2026         | 1 400                               | (25)                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2030         | 1 174 620                           | (254)                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 1 292 650                           | 4 879                                   | 0,00                   |
| Indice iTraxx Europe Main 44 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2030         | € 138 020                           | 129                                     | 0,00                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 389 825                             | 1 245                                   | 0,00                   |
|                                            |                         |                    |                                     | \$ 134 689                              | 0,11                   |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 0,500 %      | 16/09/2030         | £ 254 700            | \$ (9 818)                              | (0,01)                 |
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2028         | 3 040 600            | 28 738                                  | 0,02                   |
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500        | 18/03/2031         | 3 899 400            | (9 863)                                 | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,700        | 28/03/2034         | 24 100               | 1 174                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000        | 18/03/2036         | 828 020              | 11 849                                  | 0,01                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000        | 20/09/2026         | ¥ 48 830 000         | (5 012)                                 | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000        | 15/03/2029         | 344 670 000          | (655)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,020        | 20/09/2028         | 395 820 000          | (3 111)                                 | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,176        | 27/04/2027         | 22 270 000           | 233                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400        | 15/06/2032         | 31 750 700           | 2 295                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500        | 15/03/2042         | 15 498 000           | 4 334                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,700        | 18/09/2029         | 264 680 000          | 3 629                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,711        | 27/04/2042         | 5 408 000            | 1 579                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000        | 18/09/2034         | 136 260 000          | 20 165                                  | 0,02                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250        | 18/06/2035         | 21 746 000           | 4 310                                   | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,500        | 16/06/2028         | \$ 2 503 737         | (40 631)                                | (0,03)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,550        | 15/01/2031         | 4 567 800            | 704 959                                 | 0,56                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,674        | 05/08/2030         | 62 900               | 9 019                                   | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,678        | 29/07/2030         | 65 200               | 9 312                                   | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,711        | 28/07/2030         | 69 000               | 9 774                                   | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,715        | 27/07/2030         | 200 000              | 28 321                                  | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,750        | 30/03/2031         | 963 600              | 145 322                                 | 0,12                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,750        | 16/06/2031         | 3 358 883            | (203 783)                               | (0,16)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,800        | 15/01/2051         | 1 479 300            | 852 611                                 | 0,68                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,975        | 17/06/2052         | 52 200               | 23 489                                  | 0,02                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,990        | 24/06/2052         | 75 000               | 33 471                                  | 0,03                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000        | 15/06/2027         | 386 590              | (1 595)                                 | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000        | 15/06/2029         | 495 770              | 16 586                                  | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000        | 16/12/2030         | 120 615              | 15 279                                  | 0,01                   |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,035 %   | 28/06/2052      | \$ 25 900         | \$ 11 477                         | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,144     | 04/11/2050      | 49 600            | (24 690)                          | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,150     | 30/03/2051      | 191 500           | 22 695                            | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,215     | 13/10/2050      | 83 500            | (41 622)                          | (0,03)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,235     | 12/05/2028      | 75 400            | 4 568                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 15/12/2026      | 1 654 500         | (44 252)                          | (0,04)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 15/06/2032      | 15 560            | 1 582                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 15/06/2032      | 635 270           | (35 928)                          | (0,03)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 16/06/2051      | 1 456 600         | 79 729                            | 0,06                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,280     | 24/03/2028      | 423 400           | (19 506)                          | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,306     | 02/11/2051      | 48 000            | 20 632                            | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,317     | 16/12/2050      | 33 800            | (15 837)                          | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,350     | 20/01/2027      | 109 100           | 1 924                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360     | 15/02/2027      | 387 430           | 6 950                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360     | 20/07/2031      | 91 400            | 12 170                            | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,370     | 19/07/2031      | 61 300            | 8 128                             | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,380     | 04/01/2027      | 212 800           | (3 102)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,405     | 07/09/2031      | 154 300           | 20 555                            | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,418     | 20/01/2027      | 71 900            | (1 103)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,420     | 24/02/2027      | 269 100           | 4 618                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,425     | 18/01/2027      | 146 000           | (2 072)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,443     | 18/01/2027      | 157 300           | (2 192)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450     | 17/02/2027      | 361 600           | 6 105                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450     | 16/07/2031      | 137 000           | 17 907                            | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,485     | 13/01/2051      | 78 100            | (35 756)                          | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 15/12/2028      | 473 684           | (40 418)                          | (0,03)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 12/01/2029      | 85 443            | 5 776                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 05/10/2031      | 89 100            | (11 621)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518     | 20/01/2029      | 43 100            | (2 804)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535     | 15/10/2031      | 88 600            | (11 458)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535     | 22/10/2031      | 59 100            | (7 587)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,545     | 26/10/2031      | 58 900            | (7 540)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,550     | 20/01/2027      | 485 100           | (5 914)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570     | 11/01/2027      | 121 400           | (1 578)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570     | 12/01/2027      | 76 200            | (1 003)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,573     | 28/02/2027      | 96 300            | (1 999)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,580     | 16/02/2027      | 150 400           | (1 920)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,595     | 13/01/2051      | 82 600            | (36 299)                          | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600     | 15/02/2027      | 1 549 700         | (18 801)                          | (0,02)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,618     | 09/02/2029      | 27 100            | (1 727)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,620     | 18/04/2027      | 153 700           | (2 983)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630     | 20/01/2029      | 60 000            | (3 711)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630     | 26/01/2029      | 72 000            | (4 409)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,650     | 24/02/2027      | 897 000           | (10 119)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,650     | 08/02/2032      | 91 900            | (10 820)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,655     | 24/01/2032      | 72 000            | (8 891)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700     | 17/02/2027      | 1 446 200         | (15 404)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700     | 12/01/2029      | 310 700           | (18 031)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,730     | 24/02/2032      | 86 300            | (9 785)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,735     | 12/01/2032      | 57 800            | (6 885)                           | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 15/06/2029      | 190 144           | 988                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 15/06/2032      | 209 290           | 5 701                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 15/06/2032      | 96 400            | (4 975)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,765     | 16/03/2032      | 30 400            | (3 357)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,770     | 14/02/2032      | 81 500            | (9 079)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,783     | 22/04/2027      | 114 300           | (2 013)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,785     | 12/08/2051      | 76 100            | 33 115                            | 0,03                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,788     | 03/05/2027      | 114 800           | (2 021)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,815     | 24/01/2052      | 14 400            | (5 947)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,817     | 05/04/2032      | 318 600           | (34 167)                          | (0,03)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,867     | 26/01/2052      | 14 400            | (5 811)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,872     | 06/04/2032      | 160 000           | (16 660)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,928     | 25/03/2027      | 159 500           | (2 760)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,945     | 23/06/2051      | 127 800           | 51 729                            | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,988     | 09/02/2032      | 22 000            | 2 244                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 21/12/2027      | 193 480           | (6 595)                           | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 21/12/2029      | 910 590           | (17 461)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 18/02/2032      | 133 700           | (13 500)                          | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 21/12/2032      | 1 477 810         | 5 147                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 15/12/2051      | 324 000           | 46 154                            | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,008     | 09/02/2032      | 36 700            | 3 777                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,185     | 21/04/2029      | 96 000            | (4 530)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,243     | 07/08/2026      | 291 100           | 982                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,370     | 21/06/2027      | 159 400           | (1 881)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,385     | 08/06/2032      | 26 800            | 1 905                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,430     | 30/09/2027      | 230 020           | 6 907                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450     | 04/10/2027      | 221 690           | 6 539                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,451     | 08/06/2032      | 90 600            | 6 222                             | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,468     | 27/07/2028      | 79 800            | (1 614)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,537     | 24/07/2053      | 20 300            | (4 300)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,550     | 21/07/2053      | 20 300            | (4 271)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,590     | 23/07/2026      | 616 200           | (56)                              | 0,00                |



## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,605 %   | 28/06/2027      | \$ 158 600        | \$ (3 585)                        | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,675     | 24/07/2028      | 81 100            | (1 211)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,680     | 11/07/2032      | 27 300            | (1 779)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,690     | 11/07/2032      | 27 300            | (1 756)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,700     | 21/07/2028      | 79 700            | (1 132)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,850     | 30/08/2027      | 137 400           | (2 355)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,880     | 30/09/2027      | 657 200           | (8 953)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,900     | 04/10/2027      | 633 400           | (8 476)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,955     | 04/10/2027      | 141 800           | (1 782)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 17/06/2028      | 7 019 100         | (45 522)                          | (0,04)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 19/03/2030      | 1 423 210         | (11 250)                          | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2030      | 2 179 420         | 42 788                            | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2033      | 710 885           | 30 349                            | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050     | 07/09/2027      | 69 900            | (899)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050     | 08/09/2029      | 69 900            | (1 885)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050     | 06/09/2032      | 104 600           | (4 821)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080     | 23/02/2053      | 29 400            | (5 163)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100     | 09/09/2029      | 70 000            | (1 753)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,231     | 18/09/2034      | 56 700            | 3 400                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,232     | 10/09/2034      | 28 250            | 1 731                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,240     | 16/09/2034      | 28 400            | 1 714                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,248     | 18/09/2034      | 56 300            | 3 304                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 21/06/2028      | 126 300           | (93)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 21/06/2028      | 1 919 560         | 28 893                            | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2030      | 9 400 600         | (111 205)                         | (0,09)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 19/03/2032      | 1 087 280         | (3 101)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2032      | 152 030           | 3 452                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2035      | 94 960            | 2 904                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2055      | 421 880           | 15 030                            | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,278     | 16/09/2034      | 112 900           | 6 465                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 28/02/2029      | 232 300           | 4 493                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 30/06/2031      | 165 600           | 5 722                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 06/03/2033      | 54 100            | (1 885)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 15/11/2053      | 58 140            | 9 225                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,328     | 30/04/2031      | 53 440            | 1 400                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340     | 23/02/2030      | 86 000            | (1 509)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350     | 14/12/2032      | 28 200            | 1 103                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,368     | 15/11/2049      | 26 380            | 3 517                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370     | 01/03/2033      | 52 300            | (1 541)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370     | 12/07/2053      | 40 100            | (5 451)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,375     | 15/10/2034      | 59 900            | (2 484)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,385     | 17/10/2034      | 60 400            | (2 465)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,395     | 17/10/2034      | 90 400            | (3 624)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400     | 23/02/2033      | 49 800            | (1 379)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400     | 17/10/2034      | 30 200            | (1 199)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405     | 01/03/2033      | 53 700            | (1 472)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,410     | 05/09/2034      | 56 600            | 2 639                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420     | 24/05/2033      | 88 200            | (2 407)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425     | 01/03/2033      | 53 900            | (1 435)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430     | 27/02/2033      | 53 600            | (1 403)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,431     | 30/04/2031      | 89 340            | 1 908                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,446     | 23/10/2034      | 60 700            | (2 224)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450     | 07/03/2033      | 109 100           | (2 770)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450     | 11/10/2034      | 59 800            | (2 124)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,463     | 23/10/2034      | 60 200            | (2 116)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,464     | 15/11/2049      | 35 220            | 4 174                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,465     | 30/10/2034      | 122 100           | (4 233)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470     | 22/02/2030      | 102 500           | (1 290)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470     | 04/09/2034      | 28 400            | 1 187                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,481     | 29/10/2034      | 60 600            | (2 033)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,495     | 30/10/2034      | 61 000            | (1 975)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 22/06/2030      | 175 800           | (2 038)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      | 44 830            | (315)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      | 4 093 815         | 156 533                           | 0,13                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      | 270 360           | 5 734                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 22/05/2033      | 5 163 180         | 29 225                            | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 205 880           | (545)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 353 380           | 3 305                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 21/06/2033      | 117 200           | (2 583)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      | 290 730           | (594)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/09/2055      | 525 200           | 10 897                            | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,510     | 30/11/2028      | 53 670            | 645                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,514     | 04/09/2034      | 56 400            | 2 165                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,515     | 30/11/2028      | 80 530            | 959                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,515     | 06/11/2034      | 348 700           | (10 626)                          | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525     | 02/03/2030      | 37 900            | (428)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525     | 04/09/2034      | 56 800            | 2 130                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,527     | 15/11/2049      | 14 210            | 1 544                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,532     | 20/08/2034      | 56 300            | 2 079                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,551     | 17/09/2035      | 65 000            | 2 572                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,555     | 28/08/2034      | 56 700            | 1 995                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,555     | 05/03/2054      | 21 800            | (2 164)                           | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,558 %   | 21/08/2034      | \$ 56 000         | \$ 1 945                          | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,564     | 31/01/2033      | 42 330            | 887                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,565     | 28/08/2034      | 56 700            | 1 945                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,569     | 14/08/2034      | 56 300            | 1 906                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,594     | 09/01/2034      | 53 500            | 1 266                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,595     | 19/08/2034      | 112 000           | 3 588                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,599     | 28/08/2034      | 56 600            | 1 792                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 17/01/2034      | 51 000            | 1 421                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610     | 12/12/2032      | 56 700            | 1 320                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,611     | 28/08/2034      | 125 700           | 3 916                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,613     | 22/08/2034      | 56 200            | 1 720                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,620     | 31/01/2034      | 26 100            | (462)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,643     | 28/08/2034      | 56 600            | 1 600                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,645     | 07/08/2034      | 56 300            | 1 582                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,648     | 08/01/2034      | 52 100            | 1 276                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 10/07/2033      | 60 400            | (1 063)                           | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 05/03/2034      | 54 400            | (870)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,655     | 24/01/2034      | 26 500            | (409)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,665     | 24/01/2034      | 53 000            | (784)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,670     | 08/01/2034      | 52 900            | 1 221                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 13/08/2034      | 56 300            | 1 445                             | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 15/02/2036      | 49 680            | 1 306                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684     | 03/01/2034      | 26 000            | 570                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,685     | 24/01/2034      | 53 200            | (711)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 06/06/2033      | 3 050 720         | 25 849                            | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 05/03/2034      | 27 300            | (354)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,710     | 05/03/2034      | 54 100            | (669)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,715     | 07/08/2034      | 56 300            | 1 306                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,725     | 07/02/2034      | 26 000            | (254)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730     | 03/08/2033      | 30 800            | (344)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 07/08/2033      | 33 100            | (347)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 23/01/2034      | 26 700            | (262)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,738     | 23/01/2034      | 15 900            | (153)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 13/12/2027      | 141 600           | 862                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/12/2028      | 1 360 714         | 210                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 3 846 760         | 36 127                            | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 3 913 260         | 132 963                           | 0,11                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      | 1 749 430         | 36 413                            | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 861 310           | 21 990                            | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 1 468 420         | 7 648                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 1 027 700         | 25 135                            | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 15/05/2032      | 1 831 573         | 17 734                            | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2032      | 1 516 820         | 41 403                            | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2032      | 1 969 960         | 55 116                            | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/03/2033      | 4 576 709         | 92 834                            | 0,07                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 12/07/2033      | 57 200            | (579)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 02/01/2034      | 26 000            | 444                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 674 050           | 7 435                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 435 920           | 13 151                            | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 07/05/2035      | 126 800           | (1 592)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035      | 489 200           | 13 816                            | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 214 420           | 7 849                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,755     | 15/02/2036      | 103 490           | 2 072                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760     | 23/08/2033      | 97 900            | (837)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,783     | 07/02/2034      | 20 700            | (119)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,795     | 06/08/2034      | 56 600            | 959                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 10/03/2028      | 104 800           | (118)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 22/08/2030      | 24 500            | (49)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 30/08/2033      | 49 300            | (288)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810     | 02/01/2034      | 26 000            | 336                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830     | 12/10/2053      | 15 600            | (883)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,840     | 08/01/2035      | 62 200            | (409)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842     | 26/12/2033      | 26 000            | 275                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 05/08/2034      | 56 600            | 711                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 08/01/2035      | 31 200            | (181)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854     | 29/12/2033      | 52 000            | 508                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 21/02/2034      | 106 200           | (118)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,865     | 20/11/2034      | 178 300           | (502)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,866     | 14/11/2034      | 177 500           | (514)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 05/03/2035      | 31 200            | 345                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 17/10/2053      | 15 700            | (789)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,874     | 05/03/2035      | 62 400            | 669                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 10/07/2034      | 112 500           | 1 083                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 16/10/2053      | 15 700            | (762)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,884     | 25/03/2035      | 62 800            | 605                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,890     | 03/03/2035      | 31 200            | 307                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,896     | 08/01/2035      | 62 300            | (125)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,899     | 11/03/2035      | 184 800           | 1 624                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 30/08/2033      | 49 400            | 48                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 10/04/2034      | 55 300            | 24                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 15/04/2034      | 27 100            | 10                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 08/01/2035      | 62 000            | (119)                             | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,905 %   | 12/03/2035      | \$ 62 200         | \$ 493                            | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,908     | 04/03/2035      | 62 300            | 516                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,930     | 24/03/2035      | 125 200           | 771                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,933     | 06/01/2035      | 62 700            | 71                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 22/02/2029      | 159 500           | 424                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 13/09/2033      | 146 600           | 698                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 19/12/2033      | 51 500            | 149                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 16/04/2034      | 55 100            | 193                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 27/02/2029      | 54 000            | 186                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 15/01/2035      | 31 200            | 106                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,975     | 15/11/2053      | 156 800           | 2 987                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,994     | 02/07/2034      | 83 200            | 63                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 15 920            | 557                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 1 890 060         | (5 980)                           | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 318 500           | 212                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 26/02/2035      | 90 250            | 89                                | 0,00                |
| À recevoir(4)                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 15/02/2036      | 51 570            | 79                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,010     | 15/11/2053      | 18 120            | 598                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 30/12/2034      | 62 900            | 474                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 15/11/2053      | 18 160            | 585                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,025     | 15/11/2053      | 498 000           | 1 923                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 04/10/2033      | 103 700           | 1 078                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 15/12/2033      | 51 700            | (133)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,052     | 15/02/2056      | 23 340            | 538                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,059     | 15/02/2056      | 24 810            | 541                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060     | 02/07/2034      | 55 100            | (232)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,066     | 15/02/2046      | 18 700            | 399                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,071     | 15/01/2035      | 62 600            | 701                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,076     | 15/02/2046      | 42 490            | 848                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,078     | 29/04/2034      | 55 300            | 640                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 17/04/2034      | 55 300            | 686                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 05/06/2034      | 56 200            | (242)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,082     | 15/11/2053      | 19 300            | 411                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,083     | 15/11/2053      | 28 870            | 611                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 22/04/2034      | 55 300            | 731                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 15/11/2053      | 447 893           | 8 993                             | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 30/04/2034      | 166 400           | 2 963                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 22/01/2035      | 62 800            | 787                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,100     | 21/01/2035      | 31 400            | 420                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,105     | 24/04/2034      | 84 800            | 1 184                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,130     | 03/05/2034      | 55 000            | 821                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 12/10/2033      | 49 900            | 965                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 22/04/2034      | 56 400            | 972                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165     | 27/09/2033      | 115 400           | 2 364                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170     | 03/10/2033      | 81 600            | 1 684                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175     | 10/10/2033      | 50 000            | 1 036                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200     | 18/10/2033      | 39 900            | 890                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220     | 20/10/2033      | 50 300            | 1 195                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230     | 23/10/2033      | 25 100            | 616                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 20/03/2029      | 208 940           | 4 888                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 20/03/2031      | 239 020           | 7 144                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 22/11/2033      | 51 700            | (922)                             | 0,00                |
| À recevoir(4)                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 15/11/2052      | 1 600 800         | (7 055)                           | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255     | 23/10/2033      | 25 100            | 661                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393     | 25/10/2033      | 23 500            | 843                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435     | 01/11/2033      | 26 400            | 1 043                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 31/10/2033      | 29 800            | 1 196                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 01/11/2033      | 51 700            | 2 104                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,998     | 04/01/2027      | 669 600           | (11 907)                          | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,037    | 04/01/2027      | 163 900           | (2 871)                           | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,041    | 04/01/2027      | 696 800           | (12 240)                          | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,072    | 04/01/2027      | 388 330           | (5 839)                           | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,090    | 04/01/2027      | 1 313 900         | (22 746)                          | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,098    | 04/01/2027      | 1 174 240         | (17 500)                          | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,138    | 04/01/2027      | 326 900           | (5 571)                           | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,165    | 04/01/2027      | 595 440           | (8 676)                           | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,170    | 04/01/2027      | 993 630           | (14 453)                          | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,183    | 04/01/2027      | 1 784 770         | (25 832)                          | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,203    | 04/01/2027      | 1 390 590         | (19 997)                          | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,210    | 04/01/2027      | 200 330           | (2 874)                           | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,256    | 04/01/2027      | 1 389 360         | (19 616)                          | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,328    | 04/01/2027      | 1 084 260         | (14 927)                          | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,250    | 04/01/2027      | 32 000            | (487)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,275    | 04/01/2027      | 16 100            | (241)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,290    | 04/01/2027      | 16 200            | (241)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,731    | 04/01/2027      | 8 300             | (93)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,746    | 04/01/2027      | 35 900            | (398)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,901    | 04/01/2027      | 85 800            | (842)                             | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,800    | 02/01/2031      | 4 720 200         | (32 212)                          | (0,03)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,841    | 02/01/2031      | 1 763 600         | (11 372)                          | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,172    | 02/01/2031      | 1 373 400         | (5 744)                           | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,180    | 02/01/2031      | 5 126 600         | (19 215)                          | (0,02)              |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |        |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|--------|
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,200 %  | 02/01/2031      | BRL               | 165 900 \$                        | (647)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,235    | 02/01/2031      |                   | 239 200                           | (892)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,245    | 02/01/2031      |                   | 77 900                            | (296)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,250    | 02/01/2031      |                   | 237 700                           | (843)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,255    | 02/01/2031      |                   | 702 300                           | (2 482)             | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,260    | 02/01/2031      |                   | 71 500                            | (258)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,291    | 02/01/2029      |                   | 1 153 900                         | (5 057)             | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,300    | 02/01/2031      |                   | 100 500                           | (343)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,315    | 02/01/2031      |                   | 249 200                           | (832)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,330    | 02/01/2031      |                   | 82 000                            | (267)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,350    | 02/01/2031      |                   | 167 900                           | (552)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,354    | 02/01/2029      |                   | 2 301 600                         | (9 687)             | (0,01) |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,435    | 02/01/2031      |                   | 56 540                            | (160)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,440    | 02/01/2031      |                   | 56 760                            | (159)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,520    | 02/01/2031      |                   | 531 600                           | (1 321)             | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,560    | 02/01/2031      |                   | 270 800                           | (607)               | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | CDI BRL à un an                   | 13,670    | 02/01/2031      |                   | 70 700                            | (121)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,681    | 02/01/2031      |                   | 1 110 800                         | (1 131)             | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,694    | 02/01/2031      |                   | 617 600                           | (1 001)             | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,698    | 02/01/2031      |                   | 253 800                           | (387)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,724    | 02/01/2031      |                   | 698 000                           | (870)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,725    | 02/01/2031      |                   | 31 400                            | (44)                | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,790    | 02/01/2031      |                   | 184 900                           | (173)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,882    | 02/01/2031      |                   | 909 000                           | (465)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,899    | 02/01/2031      |                   | 699 100                           | (390)               | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,927    | 04/01/2027      |                   | 1 761 500                         | (2 873)             | 0,00   |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 14,009    | 04/01/2027      |                   | 1 254 000                         | (1 701)             | 0,00   |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,000     | 16/06/2047      | CAD               | 2 600                             | (78)                | 0,00   |
| À recevoir                       | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 1,300     | 16/06/2047      |                   | 2 500                             | (73)                | 0,00   |
| À payer                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,400     | 20/06/2029      |                   | 6 300                             | 104                 | 0,00   |
| À payer                          | BBR NZD à 3 mois                  | 4,750     | 19/06/2029      | NZD               | 486 100                           | 7 435               | 0,01   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR               | 474 900                           | (257)               | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,740     | 15/04/2036      |                   | 257 300                           | 10                  | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,800     | 16/04/2036      |                   | 258 700                           | 78                  | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,800     | 21/04/2036      |                   | 130 600                           | 38                  | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,820     | 16/04/2036      |                   | 544 200                           | 210                 | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,822     | 08/04/2036      |                   | 336 800                           | 140                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,830     | 16/04/2036      |                   | 267 700                           | 115                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,855     | 16/04/2036      |                   | 270 500                           | 146                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,860     | 17/04/2036      |                   | 283 800                           | 159                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,885     | 17/04/2036      |                   | 129 400                           | 86                  | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,910     | 22/04/2036      |                   | 470 700                           | 360                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,950     | 22/04/2036      |                   | 121 680                           | 114                 | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,950     | 07/05/2036      |                   | 181 500                           | 164                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,960     | 22/04/2036      |                   | 128 080                           | 126                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,000     | 03/01/2031      |                   | 295 900                           | 499                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,000     | 23/04/2036      |                   | 174 300                           | 201                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,001     | 06/01/2031      |                   | 295 900                           | 502                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,010     | 07/01/2031      |                   | 288 500                           | 497                 | 0,00   |
| À payer <sup>(4)</sup>           | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,010     | 08/05/2036      |                   | 318 330                           | 370                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,030     | 07/01/2031      |                   | 288 500                           | 511                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,053     | 07/01/2031      |                   | 288 500                           | 527                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,058     | 07/01/2031      |                   | 288 500                           | 531                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,063     | 08/01/2031      |                   | 880 400                           | 1 629               | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,080     | 08/01/2031      |                   | 409 900                           | 776                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,080     | 24/04/2036      |                   | 204 900                           | 307                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,140     | 28/04/2036      |                   | 177 300                           | 310                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,150     | 28/04/2036      |                   | 205 600                           | 369                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,203     | 10/01/2031      |                   | 1 472 900                         | 3 233               | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,360     | 07/08/2028      |                   | 550 900                           | 771                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,380     | 04/08/2028      |                   | 275 800                           | 394                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,400     | 07/08/2028      |                   | 550 900                           | 799                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,410     | 31/07/2028      |                   | 252 300                           | 371                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,410     | 04/08/2028      |                   | 664 400                           | 974                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,410     | 07/08/2028      |                   | 162 900                           | 238                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,415     | 31/07/2028      |                   | 201 400                           | 297                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,415     | 04/08/2028      |                   | 275 800                           | 406                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,420     | 31/07/2028      |                   | 753 500                           | 1 117               | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,421     | 04/08/2028      |                   | 281 900                           | 417                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,426     | 01/08/2028      |                   | 304 400                           | 451                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,428     | 31/07/2028      |                   | 501 600                           | 748                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,460     | 01/08/2028      |                   | 513 900                           | 783                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,460     | 02/08/2028      |                   | 520 900                           | 795                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,464     | 02/08/2028      |                   | 522 200                           | 800                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,543     | 04/08/2028      |                   | 280 700                           | 459                 | 0,00   |
| À payer                          | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,550     | 03/08/2028      |                   | 554 000                           | 910                 | 0,00   |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,000     | 21/03/2027      | AUD               | 1 179 040                         | (30 899)            | (0,02) |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,000     | 18/09/2029      |                   | 1 733 400                         | (41 915)            | (0,03) |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,000     | 17/09/2030      |                   | 984 900                           | (26 823)            | (0,02) |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 20/03/2034      |                   | 662 900                           | (4 423)             | 0,00   |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/09/2034      |                   | 53 300                            | (1 333)             | 0,00   |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/06/2035      |                   | 3 047 150                         | (84 943)            | (0,07) |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,480 %   | 11/03/2036      | CZK               | \$ 112 500                        | 129 0,00            |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,830     | 09/12/2052      | €                 | 1 064 900                         | 138 201 0,11        |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      |                   | 2 945 240                         | (23 312) (0,02)     |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 18/03/2036      |                   | 232 000                           | 1 479 0,00          |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      |                   | 446 250                           | 549 0,00            |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 18/03/2056      |                   | 255 000                           | (3 569) 0,00        |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      |                   | 890 830                           | (6 185) (0,01)      |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      | MXN               | 12 814 800                        | (4 737) 0,00        |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 7,498     | 15/01/2032      |                   | 772 200                           | (1 033) 0,00        |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      |                   | 6 144 600                         | (5 766) 0,00        |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,990     | 18/12/2029      |                   | 446 400                           | 1 235 0,00          |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,020     | 17/12/2029      |                   | 595 900                           | 1 685 0,00          |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,108     | 13/03/2030      |                   | 2 323 000                         | 7 137 0,01          |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,135     | 27/12/2029      |                   | 546 800                           | 1 642 0,00          |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,150     | 31/12/2029      |                   | 559 600                           | 1 690 0,00          |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,000     | 15/09/2031      | £                 | 53 800                            | (7 555) (0,01)      |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,020     | 15/10/2031      |                   | 69 900                            | (9 127) (0,01)      |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,055     | 15/09/2031      |                   | 49 800                            | (6 820) (0,01)      |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,066     | 15/09/2031      |                   | 96 800                            | (11 503) (0,01)     |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,140     | 15/10/2031      |                   | 135 400                           | (15 270) (0,01)     |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,250     | 15/11/2031      |                   | 135 600                           | (10 781) (0,01)     |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,400     | 15/10/2031      |                   | 60 700                            | (5 085) 0,00        |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ 1 755 138                      | 1,40                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ 1 894 722                      | 1,52                |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,110 %         | 26/07/2032        | 59 200                           | \$ 9 590  | \$ 2 778     | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,110           | 26/07/2032        | 85 900                           | 13 916    | 27 817       | 0,02                |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,170           | 19/07/2032        | 68 100                           | 10 801    | 3 201        | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,170           | 19/07/2032        | 76 800                           | 12 180    | 24 283       | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,400           | 20/07/2027        | 68 100                           | 8 986     | 439          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,400           | 20/07/2027        | 76 800                           | 10 134    | 22 903       | 0,02                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 65 607 | \$ 81 421    | 0,06                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable       | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime       | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------------|--------------|---------------------|
| FAR          | Option d'achat - Taux d'intérêt plafond à 2 ans hors cote   | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,022 %         | 08/08/2026        | 291 100                          | \$ (5 021)  | \$ (1 076)   | 0,00                |
|              | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,022           | 08/08/2026        | 291 100                          | (5 021)     | 0            | 0,00                |
| MYC          | Option d'achat - Taux d'intérêt plafond à 2 ans hors cote   | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,026           | 23/07/2026        | 616 200                          | (10 898)    | (1 689)      | 0,00                |
|              | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,026           | 23/07/2026        | 616 200                          | (10 898)    | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                               |                 |                   |                                  | \$ (31 838) | \$ (2 765)   | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.



SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                    | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 5 500                         | \$ (241)               | \$ 263                            | \$ 22        | 0,00                |
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 14 700                           | (705)                  | 778                               | 73           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2027      | 2 900                            | (259)                  | 275                               | 16           | 0,00                |
| BRC          | SW Finance PLC                                         | 1,000                | 20/06/2035      | 10 300                           | (1 255)                | 87                                | (1 168)      | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2026      | 42 900                           | (1 989)                | 2 117                             | 128          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 10 600                           | (381)                  | 434                               | 53           | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                    | 1,000                | 20/12/2026      | 13 800                           | (134)                  | 145                               | 11           | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement argentin     | 5,000                | 20/12/2026      | 24 700                           | 522                    | (2)                               | 520          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 17 600                           | (687)                  | 774                               | 87           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2027      | 8 200                            | (731)                  | 776                               | 45           | 0,00                |
|              | Equinix, Inc.                                          | 5,000                | 20/06/2027      | 9 000                            | 1 258                  | (864)                             | 394          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement indonésien   | 1,000                | 20/06/2031      | 12 700                           | 12                     | 52                                | 64           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain     | 1,000                | 20/12/2027      | 2 400                            | (101)                  | 123                               | 22           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain     | 1,000                | 20/12/2028      | 9 800                            | (103)                  | 225                               | 122          | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                                  | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 569 600                        | (290)                  | 90                                | (200)        | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 4 800                         | (215)                  | 234                               | 19           | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2026      | 2 200                            | (101)                  | 108                               | 7            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 3 500                            | (135)                  | 152                               | 17           | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                                  | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 838 400                        | (429)                  | 134                               | (295)        | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | \$ 21 700                        | (781)                  | 888                               | 107          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2027      | 24 900                           | (2 220)                | 2 357                             | 137          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain     | 1,000                | 20/12/2026      | 44 400                           | 68                     | 103                               | 171          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain     | 1,000                | 20/06/2027      | 40 600                           | (137)                  | 426                               | 289          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain     | 1,000                | 20/06/2028      | 17 300                           | (335)                  | 534                               | 199          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain     | 1,000                | 20/12/2028      | 74 600                           | (787)                  | 1 715                             | 928          | 0,00                |
|              | Nissan Motor Co. Ltd.                                  | 1,000                | 20/12/2030      | ¥ 691 700                        | (354)                  | 111                               | (243)        | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                    | 1,000                | 20/06/2027      | \$ 10 400                        | (131)                  | 130                               | (1)          | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/12/2026      | 124 200                          | (5 441)                | 5 941                             | 500          | 0,00                |
|              |                                                        |                      |                 |                                  | \$ (16 082)            | \$ 18 106                         | \$ 2 024     | 0,00                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice ABX.HE.AA.6-1 Index                        | 0,320 %              | 25/07/2045      | \$ 532                           | \$ (184)               | \$ 139                            | \$ (45)      | 0,00                |
|              | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index                       | 0,110                | 25/05/2046      | 22 872                           | (6 117)                | 4 306                             | (1 811)      | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AS.6 Index                         | 1,000                | 11/05/2063      | 80                               | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 147 260                          | 33 500                 | (2 164)                           | 31 336       | 0,03                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 64 610                           | 14 837                 | (1 088)                           | 13 749       | 0,01                |
| BRC          | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index                       | 0,110                | 25/05/2046      | \$ 1 799                         | (479)                  | 337                               | (142)        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | 100 000                          | (1 840)                | 2 409                             | 569          | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AS.6 Index                         | 1,000                | 11/05/2063      | 552                              | (19)                   | 19                                | 0            | 0,00                |
|              | Indice PRIMEX.ARM.2-AAA Index                     | 4,580                | 25/12/2037      | 151                              | 6                      | (6)                               | 0            | 0,00                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 25 773                           | 5 846                  | (362)                             | 5 484        | 0,01                |
| DUB          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | \$ 142 188                       | (2 554)                | 2 678                             | 124          | 0,00                |
| GST          | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index                       | 0,110                | 25/05/2046      | 590                              | (149)                  | 102                               | (47)         | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 711 564                          | (4 620)                | 5 239                             | 619          | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 911 690                          | 2 355                  | 308                               | 2 663        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | 86 300                           | (1 494)                | 1 985                             | 491          | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.15 Index                       | 0,500                | 18/11/2064      | 472 943                          | (13 682)               | 14 549                            | 867          | 0,00                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 107 610                          | 24 644                 | (1 745)                           | 22 899       | 0,02                |
| JPS          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | \$ 104 308                       | (1 848)                | 1 939                             | 91           | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 171 634                          | (1 350)                | 1 851                             | 501          | 0,00                |
| MEI          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 45 500                           | (336)                  | 472                               | 136          | 0,00                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 40 591                           | 0                      | 35                                | 35           | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 364 660                          | 0                      | 1 065                             | 1 065        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 923 900                          | 0                      | 2 761                             | 2 761        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | 379 100                          | 0                      | 2 156                             | 2 156        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.14 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | 171 300                          | 0                      | 881                               | 881          | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.15 Index                       | 0,500                | 18/11/2064      | 74 281                           | 0                      | 136                               | 136          | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AS.6 Index                         | 1,000                | 11/05/2063      | 48                               | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 493 238                          | (3 133)                | 3 562                             | 429          | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 664 307                          | (913)                  | 2 853                             | 1 940        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 1 548 700                        | (13 824)               | 18 452                            | 4 628        | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | 88 800                           | 0                      | 505                               | 505          | 0,00                |
| UAG          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 9 433                            | (268)                  | 276                               | 8            | 0,00                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 28 378              | \$ 63 650                         | \$ 92 028    | 0,07                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|----------------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index | 159 093                      | 1,248 %       | \$ 36 650         | 21/12/2026      | \$ 325                 | \$ (311)                         | \$ 14        | 0,00                |
| JPM          | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index | 156 508                      | 1,248         | 36 075            | 21/12/2026      | 324                    | (289)                            | 35           | 0,00                |
| MYC          | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index | 961 562                      | 1,248         | 221 180           | 21/09/2026      | 1 726                  | (2 287)                          | (561)        | 0,00                |
|              | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index | 53 127                       | 1,249         | 12 200            | 21/09/2026      | 52                     | (103)                            | (51)         | 0,00                |
|              | À recevoir         | Indice iBoxx USD Liquid Leveraged Loan Index | 294 551                      | 1,248         | 67 900            | 21/12/2026      | 514                    | (443)                            | 71           | 0,00                |
|              |                    |                                              |                              |               |                   |                 | \$ 2 941               | \$ (3 433)                       | \$ (492)     | 0,00                |

### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                                                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 3,690 %       | \$ 250 000        | 06/07/2026      | \$ 0                   | \$ 4 689                         | \$ 4 689     | 0,00                |
| SOG          | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 3,670         | 1 335 000         | 02/07/2026      | 0                      | 7 849                            | 7 849        | 0,01                |
|              | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 3,670         | 906 000           | 14/07/2026      | 0                      | 1 037                            | 1 037        | 0,00                |
|              | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 3,660         | 290 700           | 21/07/2026      | 0                      | (253)                            | (253)        | 0,00                |
|              | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 3,670         | 700 100           | 22/07/2026      | 0                      | (100)                            | (100)        | 0,00                |
|              | À recevoir         | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | 0                            | 3,670         | 405 400           | 24/07/2026      | 0                      | 335                              | 335          | 0,00                |
|              |                    |                                                        |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ 13 557                        | \$ 13 557    | 0,01                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 332 899           | \$ 238 049         | \$ 7 417              | \$ 0                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 8 261             | 5 993              | 170                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 97 696            | 14 466             | 74                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 486 144         | 885 099            | 39 706                | 0                                      | 0,03                |
|              | 07/2026           | SGD             | 166 382           | 130 483            | 1 849                 | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 289 829           | 513 062            | 2 027                 | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 513 062           | 290 157            | 0                     | (2 025)                                | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 15 966            | 22 622             | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 295 160         | 250 059            | 231                   | (399)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 702 135           | 508 948            | 14 051                | 0                                      | 0,01                |
| BOA          | 07/2026           | £               | 88 949            | 118 910            | 852                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 206               | 71                 | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 44 576            | 471                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 9 446 059         | 6 203              | 102                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 249 775           | 25 255             | 13                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 51 264            | 15 144             | 114                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 620 567         | 1 268 980          | 16 077                | 0                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 291 880           | 1 559 779          | 9 471                 | 0                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 81 585          | CNH               | 551 677            | 0                     | (312)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16 662          | COP               | 57 415 763         | 0                     | (85)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 17 959          | €                 | 15 430             | 0                     | (318)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 202           | £                 | 897                | 0                     | (11)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 24 706          | ¥                 | 3 929 885          | 0                     | (526)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | 49 913          | NOK               | 463 526            | 0                     | (3 071)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15 144          | PEN               | 51 252             | 0                     | (115)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 682           | PLN               | 32 783             | 39                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 163 882           | 55 102             | 43                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN             | 63 476            | 18 287             | 0                     | (292)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 140             | 8 923              | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 231             | SGD               | 299                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BPS          | 08/2026           | ZAR             | 660 170           | 37 771             | 0                     | (2 360)                                | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 135 204 762       | 34 270             | 0                     | (4 267)                                | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 5 955 233         | 11 835             | 0                     | (303)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 205 816           | 11 609             | 0                     | (95)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 70 040            | 20 367             | 0                     | (100)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 28 247            | 146 196            | 0                     | (421)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | 7 559           | INR               | 718 539            | 0                     | (18)                                   | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 58 772 015        | 16 662             | 73                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | \$              | 247 849           | 1 311 803          | 372                   | (241)                                  | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR             | 90 197            | 5 524              | 73                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | 17 986          |                   | 1 002              | 0                     | (85)                                   | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | 447 167 713       | 114 276            | 0                     | (10 449)                               | (0,01)              |
|              | 12/2026           | PEN             | 147 011           | 42 582             | 0                     | (256)                                  | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 11 138            | 196 435            | 0                     | (47)                                   | 0,00                |
|              | 01/2027           | ZAR             | 1 088 904         | 66 229             | 886                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 78 467            | 54 534             | 172                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 880 803         | 362 596            | 363                   | (1 141)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 185 783           | 134 601            | 3 652                 | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 69 264            | 88 051             | 2 184                 | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 487 157           | 71 990             | 223                   | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 5 696             | 274                | 5                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 3 085 155         | 3 593 636          | 67 133                | (755)                                  | 0,05                |
|              | 07/2026           | £               | 491 383           | 658 289            | 6 286                 | (185)                                  | 0,01                |
|              | 07/2026           | HUF             | 5 716             | 18                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer   | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | IDR 9 376 292 472 | \$ 523 212        | \$ 433             | \$ (308)              | \$ 125                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 268 677       | 91 164            | 944                | 0                     | 944                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 17 364 194    | 180 790           | 0                  | (2 650)               | (2 650)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 41 031 030    | 26 905            | 403                | 0                     | 403                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 208 510       | 21 202            | 130                | 0                     | 130                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 2 435 970     | 74 264            | 997                | (122)                 | 875                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 107 369       | 2 301             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 11 699         | BRL 59 008        | 0                  | (299)                 | (299)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 22 213            | CAD 30 900        | 0                  | (433)                 | (433)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 681 180         | € 2 350 368       | 5 996              | 0                     | 5 996                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 172 857           | £ 131 037         | 1 062              | 0                     | 1 062                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 38                | HKD 296           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 61                | HUF 18 828        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 514 176           | INR 48 766 212    | 1 179              | (934)                 | 245                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 132 298           | ¥ 21 169 782      | 0                  | (2 043)               | (2 043)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 123 367           | KRW 189 240 799   | 0                  | (1 116)               | (1 116)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 563             | KWD 2 004         | 0                  | (91)                  | (91)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16 089            | NOK 152 775       | 0                  | (650)                 | (650)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 595             | NZD 2 735         | 0                  | (39)                  | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 180             | PLN 8 189         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 071             | TRY 51 003        | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 910             | TWD 123 383       | 0                  | (39)                  | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 39 309            | ZAR 644 890       | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 2 333 260       | \$ 2 665 241      | 0                  | (5 949)               | (5 949)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 114 164         | 150 901           | 0                  | (620)                 | (620)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 32 101        | 10 765            | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 25 403         | BRL 129 380       | 0                  | (601)                 | (601)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 1 043 504 603 | \$ 57 460         | 0                  | (382)                 | (382)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 100 799       | 29 417            | 0                  | (54)                  | (54)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 2 191 728     | 67 569            | 1 179              | 0                     | 1 179                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 332 563        | IDR 5 886 997 097 | 372                | (6 615)               | (6 243)                                 | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 49 231            | INR 4 676 838     | 0                  | (149)                 | (149)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 13 319            | THB 436 530       | 1                  | (97)                  | (96)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | 311 428           | BRL 1 650 944     | 899                | (236)                 | 663                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | 36 498            | IDR 664 499 198   | 92                 | 0                     | 92                                      | 0,00                |
|              | 06/2027           | 5 109             | KWD 1 550         | 0                  | (67)                  | (67)                                    | 0,00                |
|              | 05/2029           | KWD 5 701         | \$ 19 600         | 1 006              | 0                     | 1 006                                   | 0,00                |
|              | 07/2029           | 2 919             | 10 040            | 517                | 0                     | 517                                     | 0,00                |
|              | 05/2030           | 16 336            | 56 257            | 2 884              | 0                     | 2 884                                   | 0,00                |
|              | 08/2030           | 4 054             | 13 671            | 419                | 0                     | 419                                     | 0,00                |
|              | 01/2031           | 2 700             | 9 098             | 268                | 0                     | 268                                     | 0,00                |
|              | 06/2031           | 8 570             | 28 832            | 780                | 0                     | 780                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | CAD 4 053 352     | 2 908 532         | 51 025             | 0                     | 51 025                                  | 0,04                |
|              | 07/2026           | CNH 3             | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 55 141 805    | 14 523            | 0                  | (1 374)               | (1 374)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 328 946       | 111 140           | 682                | 0                     | 682                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 9 068 231     | 190 103           | 0                  | (2 545)               | (2 545)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 41 915         | CAD 58 328        | 0                  | (802)                 | (802)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16 018            | COP 55 141 805    | 0                  | (120)                 | (120)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 36 151            | £ 27 354          | 154                | 0                     | 154                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 142             | SGD 1 468         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 603 749           | TRY 28 843 668    | 5 970              | 0                     | 5 970                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 194 346           | ZAR 3 156 750     | 0                  | (2 048)               | (2 048)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 573 346       | \$ 32 406         | 0                  | (2 517)               | (2 517)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 34 255 952    | 9 072             | 0                  | (788)                 | (788)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 57             | TRY 2 728         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 55 141 805    | \$ 15 817         | 100                | 0                     | 100                                     | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | BRL 858 644       | 165 325           | 35                 | (601)                 | (566)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 9 601 119       | 11 185 687        | 208 727            | 0                     | 208 727                                 | 0,17                |
|              | 07/2026           | PEN 113 975       | 33 563            | 366                | (210)                 | 156                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 44 760         | BRL 226 166       | 0                  | (1 065)               | (1 065)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 419 595           | ¥ 66 713 848      | 0                  | (9 111)               | (9 111)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 85 127            | NZD 150 667       | 580                | 0                     | 580                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16 067            | PEN 54 822        | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 150 667       | \$ 85 223         | 0                  | (580)                 | (580)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 681 161       | 200 377           | 1 352              | (352)                 | 1 000                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 165 325        | BRL 865 286       | 590                | (41)                  | 549                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP 14 695 614    | 16 688            | 739                | 0                     | 739                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 591 719       | 173 499           | 1 553              | (1 042)               | 511                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | 277 578           | 80 959            | 109                | (243)                 | (134)                                   | 0,00                |
|              | 12/2026           | 24 902            | 7 359             | 104                | 0                     | 104                                     | 0,00                |
| CBK          | 02/2027           | 35 875            | 10 306            | 0                  | (121)                 | (121)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 515           | 76                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 184 284 600   | 48 300            | 0                  | (4 987)               | (4 987)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 4 450           | 5 149             | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 13 171        | 44                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 299 573       | 103 125           | 2 530              | 0                     | 2 530                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 11 691 136    | 123 910           | 402                | 0                     | 402                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 295 990       | 31 907            | 1 996              | 0                     | 1 996                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 603 731       | 174 375           | 323                | (2 938)               | (2 615)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 72 638        | 7 862             | 356                | 0                     | 356                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 810          | AUD 6 806         | 0                  | (95)                  | (95)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 11 101            | CAD 15 359        | 0                  | (276)                 | (276)                                   | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer   | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | \$ 89 938         | COP 313 175 160   | \$ 700             | \$ (165)              | \$ 535                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | 26 379            | € 22 617          | 0                  | (521)                 | (521)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 132 994           | £ 98 898          | 0                  | (1 732)               | (1 732)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 546               | HUF 166 795       | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 100 548           | IDR 1 804 014 020 | 156                | 0                     | 156                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 120 652           | INR 11 691 136    | 2 857              | 0                     | 2 857                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 13 555            | KRW 20 490 990    | 0                  | (320)                 | (320)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 102 457           | PEN 349 024       | 98                 | (216)                 | (118)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 66 714            | PLN 243 789       | 0                  | (1 859)               | (1 859)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 397             | TWD 44 193        | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 54 304 165    | \$ 14 284         | 0                  | (1 298)               | (1 298)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 10 290        | 1 315             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 417 428       | 144 322           | 4 086              | 0                     | 4 086                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 496 763       | 142 615           | 40                 | (2 904)               | (2 864)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 26 471         | ILS 78 612        | 0                  | (59)                  | (59)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP 49 842 721    | \$ 57 413         | 3 320              | 0                     | 3 320                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 360 367 278   | 90 869            | 0                  | (11 845)              | (11 845)                                | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR 3 818 999 679 | 211 548           | 0                  | (136)                 | (136)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 1 171 721     | 12 192            | 0                  | (105)                 | (105)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 12 474 130    | 24 715            | 0                  | (711)                 | (711)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 1 091 981     | 315 026           | 491                | (4 734)               | (4 243)                                 | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 2 626 479     | 79 313            | 0                  | (246)                 | (246)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 69 041         | IDR 1 231 273 057 | 0                  | (790)                 | (790)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 33 308            | MXN 595 791       | 573                | 0                     | 573                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 25 572            | PEN 88 407        | 276                | 0                     | 276                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP 147 581 210   | \$ 41 738         | 142                | (76)                  | 66                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 167 409       | 49 307            | 415                | 0                     | 415                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 174 005 098   | 48 200            | 0                  | (662)                 | (662)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN 239 076       | 69 997            | 318                | (40)                  | 278                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 854 380 637   | 217 377           | 0                  | (20 928)              | (20 928)                                | (0,02)              |
|              | 12/2026           | PEN 178 714       | 52 000            | 0                  | (54)                  | (54)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 110 999        | IDR 2 018 006 942 | 121                | 0                     | 121                                     | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN 151 825       | \$ 44 642         | 465                | 0                     | 465                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 270           | 40                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 6 155         | 296               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 241 535 065   | 13 505            | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 4 502 779     | 47 682            | 156                | 0                     | 156                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT 3 303 002     | 6 939             | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 179 273       | 53 000            | 437                | 0                     | 437                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 186 318       | 146 070           | 2 022              | 0                     | 2 022                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 51             | HUF 15 895        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 31 820            | INR 3 069 268     | 555                | 0                     | 555                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 24 086            | NOK 223 793       | 0                  | (1 470)               | (1 470)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 66 607            | PLN 247 145       | 0                  | (859)                 | (859)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 90 123            | ZAR 1 458 912     | 0                  | (1 251)               | (1 251)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 420 872       | \$ 23 776         | 0                  | (1 860)               | (1 860)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT 21 203 484    | 43 872            | 128                | (1)                   | 127                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 260 054       | 77 131            | 987                | 0                     | 987                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 11             | CNH 73            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 192               | SGD 247           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 2 338 122 586 | \$ 129 982        | 378                | 0                     | 378                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 78 514        | 22 651            | 0                  | (308)                 | (308)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 42 376         | IDR 769 512 100   | 275                | 0                     | 275                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 47 682            | INR 4 533 295     | 0                  | (161)                 | (161)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | KZT 13 011 274    | \$ 26 248         | 158                | 0                     | 158                                     | 0,00                |
| FAR          | 12/2026           | COP 146 125 207   | 36 706            | 0                  | (4 051)               | (4 051)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 400 663       | 287 684           | 5 217              | 0                     | 5 217                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 496 439       | 73 370            | 237                | (2)                   | 235                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 68 397        | 8 738             | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | HUF 13 192        | 44                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 331 833 070     | 2 050 125         | 8 389              | 0                     | 8 389                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD 756           | 583               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 19 190         | CAD 26 720        | 0                  | (356)                 | (356)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 197 050           | CNH 1 340 325     | 406                | 0                     | 406                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 359 978         | € 3 822 872       | 10 712             | 0                     | 10 712                                  | 0,01                |
|              | 07/2026           | 711 656           | £ 537 952         | 2 340              | 0                     | 2 340                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 118             | HKD 8 771         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 90 157            | ¥ 14 326 297      | 0                  | (2 009)               | (2 009)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 380 938           | PLN 1 395 450     | 0                  | (9 703)               | (9 703)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 4 465             | SEK 43 330        | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 127 849           | ZAR 2 109 864     | 677                | 0                     | 677                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 1 337 379     | \$ 197 050        | 0                  | (391)                 | (391)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 3 822 872       | 4 365 857         | 0                  | (10 687)              | (10 687)                                | (0,01)              |
|              | 08/2026           | £ 537 952         | 711 634           | 0                  | (2 345)               | (2 345)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 173 811       | 60 711            | 2 324              | 0                     | 2 324                                   | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | SEK 43 253        | 4 465             | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 734          | CNH 11 763        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 050 125         | ¥ 330 967 800     | 0                  | (8 416)               | (8 416)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 583               | SGD 754           | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 386 987           | MXN 6 789 025     | 113                | (1 024)               | (911)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 7 134 523     | \$ 1 375 003      | 645                | (4 041)               | (3 396)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 168           | 120               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 3 478 650     | 915               | 0                  | (92)                  | (92)                                    | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|------|
| IND          | 07/2026           | KRW             | 38 523 633        | \$                 | 24 949                | \$                                      | 76                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | TRY             | 1 615             |                    | 34                    |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 861 205         | BRL                | 9 953 146             |                                         | 61 756              | 0,05   |      |
|              | 07/2026           |                 | 12                | CNH                | 81                    |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 43 317            | COP                | 152 258 271           |                                         | 675                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 96 710            | IDR                | 1 734 001 873         |                                         | 270                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 24 949            | KRW                | 38 518 144            |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 55 909            | TRY                | 2 670 988             |                                         | 997                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 3 012             | ZAR                | 49 730                |                                         | 18                  | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | NGN             | 3 305 925         | \$                 | 2 099                 |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | PEN             | 66 474            |                    | 19 718                |                                         | 247                 | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | \$              | 41 307            | BRL                | 211 090               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           |                 | 39 043            | INR                | 3 744 569             |                                         | 352                 | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | ZAR             | 606 962           | \$                 | 34 049                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | COP             | 4 330 878         |                    | 1 241                 |                                         | 7                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 744 156 374     |                    | 96 710                |                                         | 29                  | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | MXN             | 194 822           |                    | 11 097                |                                         | 18                  | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | THB             | 6 932 067         |                    | 214 806               |                                         | 4 828               | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | \$              | 1 032 413         | BRL                | 5 392 294             |                                         | 884                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 197 812           | IDR                | 3 551 939 895         |                                         | 398                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 127 059           | INR                | 12 217 057            |                                         | 1 156               | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 38 380            | MXN                | 668 839               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 10/2026           |                 | 790 006           | BRL                | 4 194 858             |                                         | 3 090               | 0,00   |      |
|              | 11/2026           | COP             | 152 273 597       | \$                 | 42 058                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 12/2026           |                 | 2 989 444 559     |                    | 764 014               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | JPM               | 07/2026         | HUF               | 5 716              |                       | 19                                      |                     | 0      | 0,00 |
|              |                   | 08/2026         | HKD               | 422                |                       | 54                                      |                     | 0      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | AUD               | 1 440 839          |                       | 1 027 170                               |                     | 28 957 | 0,02 |
|              |                   | 07/2026         | BRL               | 802 476            |                       | 154 441                                 |                     | 0      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CAD               | 845 961            |                       | 594 705                                 |                     | 0      | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | CHF               | 545 353            |                       | 697 702                                 |                     | 21 630 | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | £                 | 633 020            |                       | 849 465                                 |                     | 9 289  | 0,01 |
| 07/2026      |                   | ILS             | 842 912           |                    | 282 295               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | INR             | 3 744 779         |                    | 39 689                |                                         | 129                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | KRW             | 11 904 014        |                    | 7 691                 |                                         | 5                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | KZT             | 1 703 441         |                    | 3 562                 |                                         | 21                  | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | NOK             | 345 002           |                    | 34 854                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | NZD             | 61 923            |                    | 36 585                |                                         | 1 360               | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | \$              | 35 649            | BRL                | 181 691               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 13 086            | CAD                | 18 242                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 17                | CNH                | 116                   |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 22 572            | €                  | 19 354                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 1 690             | HUF                | 516 600               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 14 692            | IDR                | 264 122 664           |                                         | 47                  | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 39 657            | INR                | 3 744 779             |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 11 550            | KRW                | 17 736 291            |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 34 013            | NZD                | 60 313                |                                         | 296                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 82 171            | PLN                | 299 747               |                                         | 34                  | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 10 222            | SGD                | 13 032                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 53 390            | THB                | 1 784 603             |                                         | 347                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 7 122             | ZAR                | 116 103               |                                         | 6                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | ILS             | 683 560           | \$                 | 234 787               |                                         | 5 150               | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | KZT             | 7 919 130         |                    | 16 311                |                                         | 7                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | \$              | 2 506             | €                  | 2 195                 |                                         | 7                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 3 614             | HKD                | 28 272                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 34 854            | NOK                | 345 153               |                                         | 10                  | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | IDR             | 278 650 209       | \$                 | 15 427                |                                         | 11                  | 0,00   |      |
| 09/2026      | INR               | 4 225 795       |                   | 44 423             |                       | 81                                      | 0,00                |        |      |
| 09/2026      | MXN               | 547 954         |                   | 31 052             |                       | 22                                      | 0,00                |        |      |
| 09/2026      | THB               | 5 378 671       |                   | 164 829            |                       | 2 450                                   | 0,00                |        |      |
| 09/2026      | \$                | 75 748          | INR               | 7 224 765          |                       | 0                                       | 0,00                |        |      |
| 09/2026      |                   | 487 500         | MXN               | 8 530 937          |                       | 0                                       | 0,00                |        |      |
| 10/2026      |                   | 154 441         | BRL               | 820 035            |                       | 577                                     | 0,00                |        |      |
| 11/2026      | ZAR               | 895 018         | \$                | 51 064             |                       | 0                                       | 0,00                |        |      |
| 12/2026      | \$                | 856 937         | MXN               | 15 116 547         |                       | 0                                       | 0,00                |        |      |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 5 990             | \$                 | 4 287                 |                                         | 138                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | CAD             | 780 673           |                    | 556 638               |                                         | 6 384               | 0,01   |      |
|              | 07/2026           | CHF             | 188 521           |                    | 235 856               |                                         | 2 821               | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | €               | 425 789           |                    | 493 180               |                                         | 6 375               | 0,01   |      |
|              | 07/2026           | £               | 69 710            |                    | 93 846                |                                         | 1 328               | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | IDR             | 24 627 066        |                    | 1 377                 |                                         | 1                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | INR             | 4 520 570         |                    | 47 870                |                                         | 156                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | KRW             | 162 589 756       |                    | 107 257               |                                         | 2 240               | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | NOK             | 113 522           |                    | 11 453                |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | SEK             | 160               |                    | 17                    |                                         | 1                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 141 345           | AUD                | 199 824               |                                         | 179                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 114 782           | CAD                | 159 592               |                                         | 27                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 233 194           | €                  | 201 720               |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 125 749           | £                  | 93 798                |                                         | 16                  | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 407               | ILS                | 1 198                 |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 73 804            | INR                | 7 114 200             |                                         | 1 236               | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 400 728           | ¥                  | 63 677 651            |                                         | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 40 371            | NOK                | 374 339               |                                         | 0                   | 0,00   |      |



# Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |          |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|----------|
| MYI          | 07/2026           | \$              | 47 496            | NZD 83 293         | \$ 250                | \$ (365)                                | \$ (115)            | 0,00     |
|              | 07/2026           |                 | 2 718             | SEK 26 461         | 16                    | 0                                       | 16                  | 0,00     |
|              | 08/2026           | ILS             | 13 271            | \$ 4 434           | 0                     | (25)                                    | (25)                | 0,00     |
|              | 08/2026           | SEK             | 26 414            | 2 718              | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00     |
|              | 08/2026           | \$              | 31 086            | € 27 222           | 79                    | 0                                       | 79                  | 0,00     |
|              | 08/2026           |                 | 4 697             | NOK 46 697         | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,00     |
|              | 09/2026           | PEN             | 20 212            | \$ 5 840           | 0                     | (69)                                    | (69)                | 0,00     |
|              | 09/2026           | THB             | 1 539 237         | 46 099             | 0                     | (526)                                   | (526)               | 0,00     |
|              | 09/2026           | \$              | 43                | IDR 774 140        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | 09/2026           |                 | 213 877           | INR 20 454 718     | 932                   | (283)                                   | 649                 | 0,00     |
|              | 09/2026           |                 | 20 979            | MXN 366 161        | 0                     | (157)                                   | (157)               | 0,00     |
|              | 10/2026           | ZAR             | 34 924            | \$ 1 963           | 0                     | (152)                                   | (152)               | 0,00     |
|              | 07/2026           | AUD             | 2                 | 1                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | CAD             | 768               | 550                | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | CHF             | 2 757             | 3 410              | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00     |
|              | 07/2026           | CNH             | 119               | 18                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | €               | 145               | 168                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | £               | 87                | 115                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | HUF             | 105               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | NSL               | 07/2026         | \$                | 3 263              | AUD 4 731             | 15                                      | 0                   | 15       |
| 07/2026      |                   |                 | 4 124             | CNH 28 049         | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 7 018             | € 6 142            | 9                     | (3)                                     | 6                   | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 89 103            | £ 66 432           | 17                    | (949)                                   | (932)               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 166               | HUF 51 689         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 13 391            | ¥ 2 150 741        | 0                     | (156)                                   | (156)               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 3 680             | SGD 4 760          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 90 013            | IDR 1 605 028 365  | 0                     | (247)                                   | (247)               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 74 637            | INR 7 180 294      | 1 150                 | 0                                       | 1 150               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 10 370            | TRY 487 805        | 34                    | 0                                       | 34                  | 0,00     |
| 09/2026      |                   | IDR             | 1 614 029 702     | \$ 90 013          | 546                   | 0                                       | 546                 | 0,00     |
| 09/2026      |                   | \$              | 42 244            | IDR 751 719 186    | 0                     | (576)                                   | (576)               | 0,00     |
| 07/2026      |                   | CAD             | 350               | \$ 251             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00     |
| 07/2026      |                   | \$              | 4 290             | £ 3 246            | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00     |
| 07/2026      |                   | CAD             | 387 812           | \$ 281 619         | 8 271                 | 0                                       | 8 271               | 0,01     |
| 07/2026      |                   | €               | 15 651            | 18 209             | 315                   | 0                                       | 315                 | 0,00     |
| 07/2026      |                   | £               | 1 121 784         | 1 502 407          | 13 519                | 0                                       | 13 519              | 0,01     |
| 07/2026      |                   | ¥               | 14 280            | 88                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
| 07/2026      |                   | PEN             | 12 180            | 3 603              | 32                    | 0                                       | 32                  | 0,00     |
| SCX          |                   | 07/2026         | SGD               | 175                | 136                   | 1                                       | 0                   | 1        |
|              | 07/2026           | \$              | 3 799             | £ 2 832            | 0                     | (40)                                    | (40)                | 0,00     |
|              | 07/2026           |                 | 34 139            | IDR 612 620 138    | 47                    | 0                                       | 47                  | 0,00     |
|              | 07/2026           |                 | 98 226            | INR 9 415 216      | 1 149                 | 0                                       | 1 149               | 0,00     |
|              | 07/2026           |                 | 12 910            | NZD 22 838         | 82                    | 0                                       | 82                  | 0,00     |
|              | 07/2026           |                 | 11 310            | PEN 38 559         | 29                    | (32)                                    | (3)                 | 0,00     |
|              | 08/2026           |                 | 2 469             | HKD 19 314         | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00     |
|              | 08/2026           |                 | 97 073            | INR 9 300 861      | 776                   | 0                                       | 776                 | 0,00     |
|              | 08/2026           |                 | 88                | ¥ 14 243           | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 837 332 933     | \$ 101 779         | 0                     | (64)                                    | (64)                | 0,00     |
|              | 09/2026           | KZT             | 1 955 706         | 3 886              | 0                     | (101)                                   | (101)               | 0,00     |
|              | 09/2026           | PEN             | 26 463            | 7 706              | 0                     | (33)                                    | (33)                | 0,00     |
|              | 09/2026           | THB             | 2 470 725         | 76 517             | 1 677                 | 0                                       | 1 677               | 0,00     |
|              | 09/2026           | \$              | 107 706           | IDR 1 933 425 956  | 142                   | (680)                                   | (538)               | 0,00     |
|              | 11/2026           | NGN             | 2 211 123         | \$ 1 367           | 0                     | (153)                                   | (153)               | 0,00     |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 051 286         | 746 517            | 6 238                 | (977)                                   | 5 261               | 0,00     |
|              | 07/2026           | CNH             | 821 893           | 121 496            | 416                   | 0                                       | 416                 | 0,00     |
|              | 07/2026           | £               | 5 530             | € 6 375            | 0                     | (51)                                    | (51)                | 0,00     |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 055 403         | \$ 6 522           | 28                    | 0                                       | 28                  | 0,00     |
|              | SOG               | 07/2026         | \$                | 523 468            | AUD 758 649           | 2 124                                   | 0                   | 2 124    |
| 07/2026      |                   |                 | 1 792             | CAD 2 531          | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 3 753 780         | € 3 286 973        | 4 271                 | (54)                                    | 4 217               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 752 299           | £ 568 803          | 2 645                 | 0                                       | 2 645               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 1 018 922         | ¥ 161 873 497      | 0                     | (22 932)                                | (22 932)            | (0,02)   |
| 07/2026      |                   |                 | 1 512 322         | SGD 1 959 877      | 2 910                 | 0                                       | 2 910               | 0,00     |
| 08/2026      |                   | AUD             | 758 649           | \$ 523 132         | 0                     | (2 152)                                 | (2 152)             | 0,00     |
| 08/2026      |                   | €               | 3 284 600         | 3 756 069          | 0                     | (4 246)                                 | (4 246)             | 0,00     |
| 08/2026      |                   | £               | 568 803           | 752 276            | 0                     | (2 650)                                 | (2 650)             | 0,00     |
| 08/2026      |                   | KZT             | 2 025 728         | 4 138              | 0                     | (29)                                    | (29)                | 0,00     |
| 08/2026      |                   | SGD             | 1 955 396         | 1 512 322          | 0                     | (2 931)                                 | (2 931)             | 0,00     |
| 08/2026      |                   | \$              | 6 522             | ¥ 1 052 651        | 0                     | (28)                                    | (28)                | 0,00     |
| 07/2026      |                   | CAD             | 37 145            | \$ 26 720          | 538                   | 0                                       | 538                 | 0,00     |
| 07/2026      |                   | €               | 12 694            | 14 577             | 64                    | 0                                       | 64                  | 0,00     |
| 07/2026      |                   | SGD             | 62                | 48                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
| 07/2026      |                   | \$              | 8 147             | CAD 11 374         | 0                     | (130)                                   | (130)               | 0,00     |
| 07/2026      |                   |                 | 72                | SGD 93             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
| 08/2026      |                   | €               | 3 428 198         | \$ 3 913 741       | 0                     | (10 968)                                | (10 968)            | (0,01)   |
| 09/2026      |                   | \$              | 1 628             | MXN 28 520         | 2                     | (8)                                     | (6)                 | 0,00     |
| UAG          |                   | 11/2026         | COP               | 396 272 316        | \$ 99 963             | 0                                       | (11 159)            | (11 159) |
|              | 07/2026           | CAD             | 51 253            | 36 660             | 537                   | (3)                                     | 534                 | 0,00     |
|              | 07/2026           | CNH             | 15                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | COP             | 343 374 726       | 90 225             | 0                     | (8 913)                                 | (8 913)             | (0,01)   |
|              | 07/2026           | KRW             | 70 221            | 46                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00     |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 237             | 1 728              | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00     |
|              | 07/2026           | \$              | 2 429             | COP 8 355 304      | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00     |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| WST          | 07/2026           | \$ 5 100        | HKD 39 994        | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 67 802          | PLN 247 762       | 0                  | (1 890)               | (1 890)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 20              | SGD 26            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 77 655 441  | \$ 20 576         | 0                  | (1 776)               | (1 776)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 22          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 8 355 304   | 2 392             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 233 878     | 13 336            | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 291 082     | 8 871             | 54                 | 0                     | 54                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 200 828      | MXN 3 537 568     | 0                  | (1 093)               | (1 093)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 467 052         | CHF 377 091       | 427                | 0                     | 427                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 375 742     | \$ 467 052        | 0                  | (436)                 | (436)                                   | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 736 904         | \$ (379 898)          | \$ 357 006                              | 0,29                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation, Institutions en AUD (couverte) de distribution, Investisseurs en AUD (couverte) de capitalisation, Investisseurs en AUD (couverte) de distribution, Administrations en AUD (couverte) de capitalisation, Administrations en AUD (couverte) de distribution, E en AUD (couverte) de distribution, H Institutions en AUD (couverte) de distribution et Z en AUD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 580 255     | \$ 400 086        | \$ 0               | \$ (1 915)            | \$ (1 915)                              | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 743 535      | AUD 1 044 065     | 0                  | (20 207)              | (20 207)                                | (0,02)              |
| BOA          | 08/2026           | 399 831         | 580 255           | 1 935              | 0                     | 1 935                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 113             | 158               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD 4 515       | \$ 3 152          | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 317        | AUD 4 814         | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | AUD 581         | \$ 409            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | 607 263         | 421 805           | 1 093              | 0                     | 1 093                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 598 356      | AUD 839 597       | 0                  | (16 683)              | (16 683)                                | (0,01)              |
| CBK          | 08/2026           | 421 535         | 607 263           | 0                  | (1 069)               | (1 069)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 7 886       | \$ 5 639          | 176                | 0                     | 176                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | \$ 12 048       | AUD 17 089        | 0                  | (208)                 | (208)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 80 871          | 113 225           | 0                  | (2 429)               | (2 429)                                 | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD 591 821     | \$ 410 967        | 953                | 0                     | 953                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 773 700      | AUD 1 084 578     | 0                  | (22 304)              | (22 304)                                | (0,02)              |
| JPM          | 08/2026           | 410 708         | 591 821           | 0                  | (934)                 | (934)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 1 000 601   | \$ 699 962        | 6 746              | 0                     | 6 746                                   | 0,01                |
| MBC          | 07/2026           | \$ 54           | AUD 75            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 697 463         | 997 724           | 0                  | (6 644)               | (6 644)                                 | (0,01)              |
| MYI          | 07/2026           | AUD 623 801     | \$ 429 623        | 51                 | (2 597)               | (2 546)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 46 213       | AUD 66 385        | 153                | (374)                 | (221)                                   | 0,00                |
| RYL          | 08/2026           | AUD 5 245       | \$ 3 616          | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 426 030      | AUD 619 077       | 2 615              | 0                     | 2 615                                   | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD 876         | \$ 613            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 155          | AUD 218           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| 08/2026      | 07/2026           | AUD 10 362      | \$ 7 150          | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 183 410      | AUD 257 756       | 0                  | (4 836)               | (4 836)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | 7 145           | 10 362            | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 13 806          | \$ (80 253)           | \$ (66 447)                             | (0,05)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en BRL (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | BRL 820 812     | \$ 157 440        | \$ 0               | \$ (1 142)            | \$ (1 142)                              | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 161 594      | BRL 848 907       | 1 140              | 0                     | 1 140                                   | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL 21 376      | \$ 4 170          | 41                 | (1)                   | 40                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 81 200       | BRL 411 911       | 0                  | (1 619)               | (1 619)                                 | 0,00                |
| BSH          | 08/2026           | 247             | 1 290             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 501 918     | \$ 96 411         | 0                  | (560)                 | (560)                                   | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 153 761      | BRL 776 932       | 0                  | (3 657)               | (3 657)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 96 411          | 505 799           | 549                | 0                     | 549                                     | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | BRL 1 258       | \$ 247            | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 524 069         | 101 713           | 462                | 0                     | 462                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 134 270      | BRL 681 777       | 17                 | (2 567)               | (2 550)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | 101 432         | 526 658           | 0                  | (472)                 | (472)                                   | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | BRL 558 407     | \$ 108 532        | 647                | 0                     | 647                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 109 845      | BRL 555 684       | 1                  | (2 488)               | (2 487)                                 | 0,00                |
| 08/2026      | 08/2026           | 107 290         | 556 377           | 1                  | (634)                 | (633)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 295             | 1 536             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 1 536       | \$ 293            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 864           | \$ (13 142)           | \$ (10 278)                             | (0,01)              |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CAD (couverte) de capitalisation et Institutions en CAD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD 35 980      | \$ 25 311         | \$ 0               | \$ (49)               | \$ (49)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 25 311       | CAD 35 929        | 49                 | 0                     | 49                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 44 476          | 61 496            | 0                  | (1 131)               | (1 131)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | 971             | 1 376             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 44              | 61                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 66              | 92                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CAD 63 095      | \$ 44 340         | 0                  | (133)                 | (133)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 44 340       | CAD 63 006        | 133                | 0                     | 133                                     | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 7               | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | CAD 291         | \$ 205            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 391             | 284               | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 46 652       | CAD 64 405        | 0                  | (1 257)               | (1 257)                                 | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 21 273      | \$ 15 007         | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 46 515       | CAD 64 141        | 0                  | (1 305)               | (1 305)                                 | 0,00                |
|              |                   | 15 007          | 21 243            | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 202             | \$ (3 889)            | \$ (3 687)                              | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | CHF 33          | \$ 41             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 1 266           | 1 609             | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 860             | 1 080             | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 3 302           | 4 198             | 105                | 0                     | 105                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 472 127      | CHF 368 584       | 0                  | (15 196)              | (15 196)                                | (0,01)              |
| JPM          | 07/2026           | 536 402         | 419 274           | 0                  | (16 630)              | (16 630)                                | (0,02)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF 7 103       | \$ 9 074          | 269                | 0                     | 269                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 56 266       | CHF 44 429        | 24                 | (1 211)               | (1 187)                                 | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | 9 751           | 7 854             | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF 426 262     | \$ 526 889        | 0                  | (1 546)               | (1 546)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 526 889      | CHF 424 732       | 1 551              | 0                     | 1 551                                   | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF 408         | \$ 504            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 535 889      | CHF 421 251       | 0                  | (13 667)              | (13 667)                                | (0,01)              |
| UAG          | 07/2026           | 1 018           | 809               | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 421 678     | \$ 522 275        | 0                  | (477)                 | (477)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 522 275      | CHF 420 169       | 487                | 0                     | 487                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 510           | \$ (48 745)           | \$ (46 235)                             | (0,04)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution A, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de distribution II, E en EUR (couverte) de distribution II Q, G Détail en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation, R en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 9 689        | € 8 325           | \$ 0               | \$ (172)              | \$ (172)                                | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 25 385        | \$ 28 875         | 0                  | (148)                 | (148)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 087 143    | € 6 941 766       | 32                 | (150 653)             | (150 621)                               | (0,12)              |
| BSH          | 07/2026           | € 15 872        | \$ 18 459         | 313                | 0                     | 313                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 7 638 582    | € 6 551 465       | 0                  | (148 292)             | (148 292)                               | (0,12)              |
| CBK          | 07/2026           | € 4 497         | \$ 5 241          | 100                | 0                     | 100                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 139 587      | € 119 679         | 0                  | (2 758)               | (2 758)                                 | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 6 452 657     | \$ 7 359 243      | 0                  | (18 081)              | (18 081)                                | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 7 369 167    | € 6 452 657       | 18 039             | 0                     | 18 039                                  | 0,01                |
| MBC          | 07/2026           | € 7 087 528     | \$ 8 052 975      | 2 007              | (52 204)              | (50 197)                                | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 20 010       | € 17 310          | 0                  | (220)                 | (220)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | 8 089 566       | 7 112 138         | 52 634             | 0                     | 52 634                                  | 0,04                |
| SOG          | 07/2026           | € 6 994 965     | \$ 7 956 773      | 0                  | (40 571)              | (40 571)                                | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 8 093 568    | € 6 938 097       | 0                  | (161 241)             | (161 241)                               | (0,13)              |
|              | 08/2026           | 7 967 566       | 6 994 965         | 40 492             | 0                     | 40 492                                  | 0,03                |
| SSB          | 07/2026           | 4 861           | 4 263             | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 4 263         | \$ 4 867          | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 113 631         | \$ (574 354)          | \$ (460 723)                            | (0,37)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de capitalisation, Administrations en GBP (couverte) de distribution, E en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 797 473      | £ 594 011         | \$ 0               | \$ (9 072)            | \$ (9 072)                              | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | \$ 2 490        | £ 1 860           | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 544 912       | \$ 718 657        | 14                 | (4 591)               | (4 577)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 896 563      | £ 669 260         | 141                | (8 429)               | (8 288)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | £ 1 998         | \$ 2 641          | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 716 973      | £ 543 668         | 4 593              | 0                     | 4 593                                   | 0,01                |
| BRC          | 07/2026           | \$ 4 894        | £ 3 703           | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 9 000         | \$ 12 074         | 128                | 0                     | 128                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 538          | £ 400             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 4 645         | \$ 6 144          | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 54 278       | £ 40 363          | 0                  | (706)                 | (706)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 6 144         | \$ 4 645          | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | £ 985           | \$ 1 322          | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 848 974      | £ 632 688         | 0                  | (9 239)               | (9 239)                                 | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 1 673         | \$ 2 245          | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23 015       | £ 17 408          | 93                 | (3)                   | 90                                      | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £ 897           | \$ 668            | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 123 802       | \$ 162 927        | 0                  | (1 389)               | (1 389)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 162 923      | £ 123 802         | 1 390              | 0                     | 1 390                                   | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 627 051       | \$ 829 964        | 0                  | (2 288)               | (2 288)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 11 400       | £ 8 474           | 0                  | (153)                 | (153)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 829 930       | \$ 627 051        | 2 303              | 0                     | 2 303                                   | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 628 255       | \$ 829 933        | 0                  | (3 918)               | (3 918)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 829 910      | £ 628 255         | 3 921              | 0                     | 3 921                                   | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 20 917        | \$ 27 649         | 0                  | (113)                 | (113)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 27 649       | £ 20 917          | 113                | 0                     | 113                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 12 776          | \$ (39 972)           | \$ (27 196)                             | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en HUF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 23 426       | HUF 7 140 320     | \$ 0               | \$ (490)              | \$ (490)                                | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | HUF 7 869 387   | \$ 25 342         | 64                 | 0                     | 64                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 25 342       | HUF 7 880 482     | 0                  | (67)                  | (67)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | HUF 45 123      | \$ 145            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CIB          | 07/2026           | \$ 46           | HUF 13 871        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | HUF 87 986      | \$ 288            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 8 838        | HUF 29            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23 048       | HUF 7 026 647     | 0                  | (477)                 | (477)                                   | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | HUF 178 596     | \$ 585            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 506        | HUF 1 680 811     | 0                  | (107)                 | (107)                                   | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | HUF 7 918 719   | \$ 25 457         | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 518          | HUF 157 995       | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 25 457        | \$ 7 929 220      | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | HUF 46 994      | \$ 152            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | \$ 179          | HUF 54 459        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | £ 23 954        | \$ 7 343 649      | 0                  | (365)                 | (365)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | HUF 7 649       | \$ 25             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 104             | \$ (1 548)            | \$ (1 444)                              | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en JPY (couverte) de capitalisation, Institutions en JPY (couverte) de distribution, Investisseurs en JPY (couverte) de capitalisation, E en JPY (couverte) de capitalisation et E en JPY (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 171 482      | ¥ 27 276 673      | \$ 0               | \$ (3 652)            | \$ (3 652)                              | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | ¥ 3 267 873     | \$ 20 299         | 192                | 0                     | 192                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 187 313      | ¥ 29 799 412      | 0                  | (3 961)               | (3 961)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 7 018         | \$ 1 133 086      | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ¥ 63 319 996    | \$ 391 710        | 2 109              | 0                     | 2 109                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 391 710      | ¥ 63 153 989      | 0                  | (2 120)               | (2 120)                                 | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | 292 365         | ¥ 46 484 930      | 0                  | (6 348)               | (6 348)                                 | (0,01)              |
| CBK          | 07/2026           | 518             | \$ 83 639         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | ¥ 68 199 932    | \$ 421 508        | 1 880              | 0                     | 1 880                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 68 546       | ¥ 10 892 229      | 0                  | (1 527)               | (1 527)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 421 508       | \$ 68 021 466     | 0                  | (1 890)               | (1 890)                                 | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | ¥ 179 959       | \$ 1 127          | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 350 623      | ¥ 55 753 173      | 0                  | (7 579)               | (7 579)                                 | (0,01)              |
| MYI          | 07/2026           | ¥ 1 355 334     | \$ 8 485          | 145                | 0                     | 145                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 69 907 362      | ¥ 432 642         | 2 509              | 0                     | 2 509                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 421 508      | ¥ 67 954 341      | 0                  | (2 304)               | (2 304)                                 | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | 235 574         | ¥ 37 449 725      | 0                  | (5 149)               | (5 149)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 1 346 766     | \$ 8 344          | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 1 557 957       | ¥ 9 653           | 68                 | 0                     | 68                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 6 959           | \$ (34 561)           | \$ (27 602)                             | (0,02)              |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |             |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|-------------|--------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 98 671            | NOK                | 913 498               | \$ 0                                    | \$ (6 356)          | \$ (6 356)  | (0,01) |
| BPS          | 07/2026           | NOK             | 125               | \$                 | 13                    | 0                                       | 0                   | 0           | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 61 368            | NOK                | 569 032               | 0                                       | (3 864)             | (3 864)     | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           |                 | 68 896            |                    | 640 148               | 0                                       | (4 206)             | (4 206)     | (0,01) |
| FAR          | 07/2026           |                 | 1 131             |                    | 11 032                | 0                                       | (16)                | (16)        | 0,00   |
| MBC          | 07/2026           | NOK             | 903 338           | \$                 | 90 897                | 0                                       | (390)               | (390)       | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 61 035            | NOK                | 565 947               | 0                                       | (3 843)             | (3 843)     | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 92 909            |                    | 923 718               | 396                                     | 0                   | 396         | 0,00   |
| MYI          | 07/2026           | NOK             | 2                 | \$                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0           | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 13                | NOK                | 125                   | 0                                       | (1)                 | (1)         | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           |                 | 2 429             |                    | 22 483                | 0                                       | (157)               | (157)       | 0,00   |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 396                                  | \$ (18 833)         | \$ (18 437) | (0,02) |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en RMB (couverte) de distribution, Investisseurs en RMB (couverte) de capitalisation et E en RMB (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |         | Devise à recevoir |         | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |         | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|---------|-------------------|---------|--------------------|-----|-----------------------|---------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 84 175  | CNH               | 568 479 | \$                 | 0   | \$                    | (428)   | \$                                      | (428)               | 0,00 |
| BOA          | 07/2026           |                 | 1 968   |                   | 13 349  |                    | 0   |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 594     |                   | 4 029   |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00 |
| BPS          | 07/2026           |                 | 40 389  |                   | 273 324 |                    | 1   |                       | (124)   |                                         | (123)               | 0,00 |
| BRC          | 07/2026           | CNH             | 1 545   | \$                | 229     |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00 |
| CIB          | 07/2026           |                 | 55 122  |                   | 8 140   |                    | 20  |                       | 0       |                                         | 20                  | 0,00 |
| DUB          | 07/2026           |                 | 715 732 |                   | 105 224 |                    | 7   |                       | (224)   |                                         | (217)               | 0,00 |
|              | 08/2026           | \$              | 103 844 | CNH               | 704 843 |                    | 214 |                       | 0       |                                         | 214                 | 0,00 |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 702 901 | \$                | 103 338 |                    | 0   |                       | (213)   |                                         | (213)               | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 28 798  | CNH               | 194 833 |                    | 0   |                       | (95)    |                                         | (95)                | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 103 338 |                   | 701 356 |                    | 205 |                       | 0       |                                         | 205                 | 0,00 |
| IND          | 07/2026           | CNH             | 852     | \$                | 126     |                    | 1   |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00 |
| JPM          | 07/2026           | \$              | 1 166   | CNH               | 7 940   |                    | 4   |                       | 0       |                                         | 4                   | 0,00 |
| MBC          | 07/2026           |                 | 923     |                   | 6 235   |                    | 0   |                       | (5)     |                                         | (5)                 | 0,00 |
| MYI          | 07/2026           | CNH             | 25 333  | \$                | 3 725   |                    | 0   |                       | (7)     |                                         | (7)                 | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 18      | CNH               | 119     |                    | 0   |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00 |
| RYL          | 07/2026           |                 | 52 649  |                   | 355 400 |                    | 0   |                       | (292)   |                                         | (292)               | 0,00 |
| SOG          | 07/2026           |                 | 105 208 |                   | 711 709 |                    | 0   |                       | (360)   |                                         | (360)               | 0,00 |
| SSB          | 07/2026           | CNH             | 3 216   | \$                | 476     |                    | 2   |                       | 0       |                                         | 2                   | 0,00 |
|              |                   |                 |         |                   |         | \$                 | 456 | \$                    | (1 749) | \$                                      | (1 293)             | 0,00 |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |        | Devise à recevoir |        | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |       | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |
|--------------|-------------------|-----------------|--------|-------------------|--------|--------------------|-----|-----------------------|-------|-----------------------------------------|---------------------|------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 4 566  | SEK               | 42 224 | \$                 | 0   | \$                    | (203) | \$                                      | (203)               | 0,00 |
| BPS          | 07/2026           |                 | 3 724  |                   | 34 929 |                    | 0   |                       | (115) |                                         | (115)               | 0,00 |
| BRC          | 08/2026           |                 | 3 784  |                   | 36 731 |                    | 18  |                       | 0     |                                         | 18                  | 0,00 |
| BSH          | 07/2026           |                 | 5 103  |                   | 49 841 |                    | 47  |                       | 0     |                                         | 47                  | 0,00 |
| CBK          | 07/2026           | SEK             | 10 025 | \$                | 1 068  |                    | 32  |                       | 0     |                                         | 32                  | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 4 952  | SEK               | 45 755 |                    | 0   |                       | (224) |                                         | (224)               | 0,00 |
| FAR          | 07/2026           | SEK             | 53 319 | \$                | 5 495  |                    | 0   |                       | (14)  |                                         | (14)                | 0,00 |
|              | 08/2026           | \$              | 5 495  | SEK               | 53 225 |                    | 15  |                       | 0     |                                         | 15                  | 0,00 |
| MBC          | 07/2026           | SEK             | 91 532 | \$                | 9 403  |                    | 0   |                       | (55)  |                                         | (55)                | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 10 397 | SEK               | 99 040 |                    | 47  |                       | (211) |                                         | (164)               | 0,00 |
|              | 08/2026           |                 | 9 376  |                   | 91 121 |                    | 56  |                       | 0     |                                         | 56                  | 0,00 |
| RYL          | 07/2026           | SEK             | 92     | \$                | 10     |                    | 0   |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00 |
|              |                   |                 |        |                   |        | \$                 | 215 | \$                    | (822) | \$                                      | (607)               | 0,00 |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de capitalisation, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution et E en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |    |          |    |          |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|----|----------|----|----------|--------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 2 507 771         | SGD                | 3 197 648             | \$                                      | 0                   | \$ | (35 585) | \$ | (35 585) | (0,02) |
| BOA          | 07/2026           | SGD             | 1 070 610         | \$                 | 827 295               |                                         | 114                 |    | (536)    |    | (422)    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 4 182 850         | SGD                | 5 341 634             |                                         | 0                   |    | (53 093) |    | (53 093) | (0,04) |
|              | 08/2026           |                 | 814 961           |                    | 1 052 376             |                                         | 534                 |    | 0        |    | 534      | 0,00   |
| BPS          | 07/2026           | SGD             | 7 269             | \$                 | 5 624                 |                                         | 5                   |    | 0        |    | 5        | 0,00   |
| BRC          | 07/2026           |                 | 91 490            |                    | 71 354                |                                         | 620                 |    | 0        |    | 620      | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           |                 | 901 175           |                    | 696 641               |                                         | 0                   |    | (81)     |    | (81)     | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 2 971 471         | SGD                | 3 790 344             |                                         | 0                   |    | (41 057) |    | (41 057) | (0,03) |
|              | 08/2026           |                 | 696 641           |                    | 899 106               |                                         | 84                  |    | 0        |    | 84       | 0,00   |
| FAR          | 07/2026           | SGD             | 2 651 340         | \$                 | 2 044 368             |                                         | 0                   |    | (5 453)  |    | (5 453)  | (0,01) |
|              | 07/2026           | \$              | 4 952 154         | SGD                | 6 317 815             |                                         | 0                   |    | (67 687) |    | (67 687) | (0,05) |
|              | 08/2026           |                 | 2 044 368         |                    | 2 645 258             |                                         | 5 465               |    | 0        |    | 5 465    | 0,00   |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | SGD 469         | \$ 368            | \$ 5               | \$ 0                  | \$ 5                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | 72 000          | 56 084            | 419                | 0                     | 419                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$ 7 373        | SGD 9 565         | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD 572 394     | \$ 442 071        | 0                  | (461)                 | (461)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 442 071      | SGD 571 067       | 454                | 0                     | 454                                     | 0,00                |
| RBC          | 07/2026           | 103 398         | 133 777           | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 13 028 693  | \$ 10 057 104     | 199                | (15 919)              | (15 720)                                | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 90 893       | SGD 115 908       | 0                  | (1 281)               | (1 281)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | 10 029 089      | 12 963 248        | 16 241             | 0                     | 16 241                                  | 0,01                |
| UAG          | 07/2026           | 5 452           | 7 071             | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 24 205          | \$ (221 153)          | \$ (196 948)                            | (0,15)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (318 118) (0,25)

| DESCRIPTION                                     | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                 |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                      | \$ 138 872                    | \$ 48 952                  | 0,04                |
| Obligation internationale du gouvernement russe |                               |                            |                     |
| 1,850 % éch. 20/11/2032                         | € 2 800                       | 0                          | 0,00                |
| 5,100 % éch. 28/03/2035                         | \$ 20 000                     | 0                          | 0,00                |
| 5,250 % éch. 23/06/2047                         | 345 400                       | 0                          | 0,00                |
| 5,625 % éch. 04/04/2042                         | 98 400                        | 68 880                     | 0,06                |
| 5,875 % éch. 16/09/2043                         | 26 600                        | 18 206                     | 0,01                |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.          |                               |                            |                     |
| 5,125 % éch. 29/10/2022 ^                       | 6 100                         | 366                        | 0,00                |
| Total des Autres actifs financiers              |                               | \$ 136 404                 | 0,11                |

**TITRES VENDUS À DÉCOUVERT****AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN**

|                                                                |           |                 |         |
|----------------------------------------------------------------|-----------|-----------------|---------|
| Ginnie Mae, TBA                                                |           |                 |         |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 1 251 490 | (1 123 656)     | (0,90)  |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |           |                 |         |
| 6,000 % éch. 01/07/2056 (j)                                    | 6 000     | (6 135)         | (0,01)  |
| 6,500 % éch. 01/08/2056 (j)                                    | 87 000    | (89 898)        | (0,07)  |
| Total des Titres vendus à découvert                            |           | \$ (1 219 689)  | (0,98)  |
| Total des Investissements                                      |           | \$ 179 864 878  | 144,17  |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |           | \$ (55 115 342) | (44,17) |
| Actif net                                                      |           | \$ 124 749 536  | 100,00  |

**NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :**

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à principal uniquement.

(c) Titre vendu avant l'émission.

(d) Titre à rémunération en nature.

(e) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(f) Titre à coupon zéro.

(g) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(h) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(i) Affilié au Fonds.

(j) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(k) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,63 %) :

| Description de l'émetteur                         | Date d'achat | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| Bank of America Corp. 3,615 % échéance 16/03/2028 | 09/04/2026   | \$ 27 494 | \$ 26 829    | 0,02                |
| Chester A PLC 0,000 % échéance 17/03/2046         | 18/04/2019   | 13 412    | 17 635       | 0,02                |
| Chester A PLC 1,000 % échéance 20/05/2046         | 18/04/2019   | 17 298    | 4 939        | 0,01                |
| Chester A PLC 5,147 % échéance 17/03/2046         | 18/04/2019   | 7 256     | 7 434        | 0,01                |
| Chester A PLC 5,997 % échéance 17/03/2046         | 18/04/2019   | 19 159    | 19 602       | 0,02                |
| Chester A PLC 6,897 % échéance 17/03/2046         | 18/04/2019   | 17 790    | 18 216       | 0,02                |
| Chester A PLC 7,747 % échéance 17/03/2046         | 18/04/2019   | 10 947    | 11 217       | 0,01                |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Description de l'émetteur                                                       | Date d'achat            | Coût       | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|------------|--------------|---------------------|
| Chester A PLC 8,247 % échéance 17/03/2046                                       | 18/04/2019              | \$ 5 473   | \$ 5 605     | 0,01                |
| Clover Holdings, Inc.                                                           | 09/12/2024              | 348        | 444          | 0,00                |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071                 | 10/06/2022              | 0          | 0            | 0,00                |
| Constellation Pharmaceuticals, Inc. 5,550 % échéance 01/07/2033                 | 16/01/2025              | 28 394     | 28 845       | 0,02                |
| Corestate Capital Holding S.A.                                                  | 22/08/2023              | 0          | 0            | 0,00                |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,520 % échéance 20/03/2028              | 20/02/2025              | 30 200     | 30 165       | 0,02                |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,740 % échéance 20/03/2030              | 20/02/2025              | 35 600     | 35 472       | 0,03                |
| Deloitte LLP 5,250 % échéance 30/01/2030                                        | 30/10/2024              | 12 400     | 12 397       | 0,01                |
| Deloitte LLP 5,410 % échéance 30/01/2032                                        | 30/10/2024              | 12 200     | 12 192       | 0,01                |
| DreamWell Ltd.                                                                  | 24/04/2024              | 701        | 3            | 0,00                |
| Ford Credit Canada Co. 4,398 % échéance 09/04/2029                              | 06/01/2026              | 14 218     | 13 903       | 0,01                |
| Goldman Sachs Group, Inc. 2,013 % échéance 28/02/2029                           | 06/04/2026              | 25 820     | 25 459       | 0,02                |
| Hardwood Funding LLC 4,840 % échéance 07/06/2028                                | 11/03/2025              | 9 600      | 9 577        | 0,01                |
| Hardwood Funding LLC 4,980 % échéance 07/06/2030                                | 11/03/2025              | 6 200      | 6 173        | 0,01                |
| Incora                                                                          | 31/01/2025              | 16 482     | 13 375       | 0,01                |
| Incora Top Holdco LLC 6,000 % échéance 30/01/2033                               | 01/05/2026              | 7 844      | 12 362       | 0,01                |
| JPMorgan Chase & Co. 1,896 % échéance 05/03/2028                                | 10/04/2026              | 14 103     | 13 790       | 0,01                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït 4,804 % échéance 20/04/2033 | 13/04/2026              | 294 300    | 293 802      | 0,24                |
| MNSN Holdings, Inc.                                                             | 20/03/2023 - 13/09/2024 | 3          | 22           | 0,00                |
| Morgan Stanley 0,000 % échéance 02/04/2032                                      | 11/02/2020              | 62 128     | 51 113       | 0,04                |
| National Football League 4,780 % échéance 05/10/2030                            | 27/06/2025              | 47 100     | 46 570       | 0,04                |
| Prime Property 5,250 % échéance 30/09/2029                                      | 17/09/2024              | 18 100     | 18 026       | 0,01                |
| Prime Property 5,440 % échéance 30/09/2031                                      | 17/09/2024              | 18 100     | 17 917       | 0,01                |
| Project Dorchester 4,610 % échéance 04/01/2027                                  | 10/12/2025              | 29 105     | 28 582       | 0,02                |
| Sierra Hamilton Holder LLC                                                      | 31/07/2017              | 560        | 0            | 0,00                |
| Spirits of St. Louis Basketball Club LP 5,490 % échéance 30/06/2036             | 22/04/2026              | 5 000      | 4 968        | 0,00                |
| SSB Manufacturing Co.                                                           | 29/06/2023              | 701        | 0            | 0,00                |
| Valerie Asset Ltd. 5,219 % échéance 15/09/2050                                  | 02/03/2026 - 05/03/2026 | 85 575     | 86 146       | 0,07                |
| Valerie Asset Ltd. 5,267 % échéance 15/09/2050                                  | 02/03/2026 - 05/03/2026 | 11 108     | 11 176       | 0,01                |
| VD DPR Finance Co. 6,833 % échéance 15/03/2035                                  | 31/01/2025              | 27 500     | 27 781       | 0,02                |
| Wells Fargo & Co. 5,083 % échéance 26/04/2028                                   | 09/04/2026              | 17 397     | 16 979       | 0,01                |
| Westmoreland Mining LLC « L »                                                   | 03/07/2023              | 338        | 134          | 0,00                |
| Westmoreland Mining LLC                                                         | 08/12/2014 - 19/12/2019 | 1 491      | 34           | 0,00                |
|                                                                                 |                         | \$ 951 445 | \$ 928 884   | 0,76                |

(I) Des titres d'une juste valeur globale de 314 085 \$ (31 décembre 2025 : 315 009 \$) et un montant en numéraire de 15 829 \$ (31 décembre 2025 : 20 988 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 2 179 \$ (31 décembre 2025 : 19 096 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 3 129 750 \$ (31 décembre 2025 : 2 956 719 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 544 259 \$ (31 décembre 2025 : 116 759 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur          |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 255 391                                                                        | \$ 168 594 228                                       | \$ 2 856 515                                      | \$ 171 706 134        |
| Fonds d'investissement                        | 2 520 685                                                                         | 0                                                    | 0                                                 | 2 520 685             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 5 145 186                                            | 0                                                 | 5 145 186             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 176 824                                                                           | 1 402 546                                            | (3 212)                                           | 1 576 158             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 136 404                                              | 0                                                 | 136 404               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (1 219 689)                                          | 0                                                 | (1 219 689)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 2 952 900</b>                                                               | <b>\$ 174 058 675</b>                                | <b>\$ 2 853 303</b>                               | <b>\$ 179 864 878</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur          |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 286 927                                                                        | \$ 153 246 627                                       | \$ 2 726 219                                      | \$ 156 259 773        |
| Fonds d'investissement                        | 1 873 742                                                                         | 0                                                    | 0                                                 | 1 873 742             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 26 417 245                                           | 0                                                 | 26 417 245            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 65 036                                                                            | 2 062 016                                            | 1 419                                             | 2 128 471             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 128 419                                              | 0                                                 | 128 419               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (29 247)                                             | 0                                                 | (29 247)              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 2 225 705</b>                                                               | <b>\$ 181 825 060</b>                                | <b>\$ 2 727 638</b>                               | <b>\$ 186 778 403</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

## Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BAR                                    | (2,490) %      | 15/06/2026        | 13/07/2026      | \$ (8 081)       | \$ (8 072)                               | (0,01)              |
|                                        | 0,000          | 15/06/2026        | 13/07/2026      | (182 394)        | (182 394)                                | (0,15)              |
|                                        | 0,000          | 30/06/2026        | 13/07/2026      | (107 093)        | (107 093)                                | (0,08)              |
| BRC                                    | 3,500          | 23/06/2026        | 22/06/2028      | (636)            | (636)                                    | 0,00                |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                 |                  | \$ (298 195)                             | (0,24)              |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (16 053)                                                | \$ 16 310               | \$ 257                            | \$ 34 810                                                  | \$ (41 480)             | \$ (6 670)                        |
| BOA          | (11 063)                                                   | 9 880                   | (1 183)                           | 31 970                                                     | (31 874)                | 96                                |
| BPS          | (77 894)                                                   | 82 930                  | 5 036                             | 14 348                                                     | (6 510)                 | 7 838                             |
| BRC          | 47 643                                                     | (50 580)                | (2 937)                           | 54 087                                                     | (54 650)                | (563)                             |
| BSH          | 26 191                                                     | (28 690)                | (2 499)                           | (3 367)                                                    | (2 980)                 | (6 347)                           |
| CBK          | (38 927)                                                   | (23 311)                | (62 238)                          | (12 031)                                                   | 21 189                  | 9 158                             |
| CIB          | 19                                                         | (2 470)                 | (2 451)                           | 232                                                        | (300)                   | (68)                              |
| DUB          | (52 358)                                                   | 52 570                  | 212                               | 2 014                                                      | (220)                   | 1 794                             |
| FAR          | (113 505)                                                  | 112 590                 | (915)                             | (18 043)                                                   | 27 500                  | 9 457                             |
| GLM          | 16 103                                                     | (124 650)               | (108 547)                         | 25 756                                                     | 4 040                   | 29 796                            |
| GST          | 5 666                                                      | (49 900)                | (44 234)                          | 13 851                                                     | (66 340)                | (52 489)                          |
| IND          | (94)                                                       | 0                       | (94)                              | (4 710)                                                    | 6 430                   | 1 720                             |
| JPM          | 48 477                                                     | (56 490)                | (8 013)                           | 15 146                                                     | (6 750)                 | 8 396                             |
| JPS          | 592                                                        | (660)                   | (68)                              | 1 519                                                      | (1 420)                 | 99                                |
| MBC          | (10 725)                                                   | 7 770                   | (2 955)                           | 99 579                                                     | (106 760)               | (7 181)                           |
| MEI          | 136                                                        | (260)                   | (124)                             | 282                                                        | (260)                   | 22                                |
| MYC          | 50 683                                                     | (8 400)                 | 42 283                            | 60 233                                                     | (17 590)                | 42 643                            |
| MYI          | 6 153                                                      | (87 980)                | (81 827)                          | 18 083                                                     | (20 000)                | (1 917)                           |
| NSL          | 901                                                        | (990)                   | (89)                              | 4 321                                                      | (4 020)                 | 301                               |
| RBC          | 28                                                         | 0                       | 28                                | (1 894)                                                    | 2 160                   | 266                               |
| RYL          | (274)                                                      | 320                     | 46                                | 24                                                         | (350)                   | (326)                             |
| SAL          | 7 502                                                      | (7 310)                 | 192                               | 16 370                                                     | (16 270)                | 100                               |
| SCX          | 24 853                                                     | (28 960)                | (4 107)                           | (43 899)                                                   | 45 750                  | 1 851                             |
| SOG          | (182 200)                                                  | 183 800                 | 1 600                             | 159 045                                                    | (170 230)               | (11 185)                          |
| SSB          | (36 565)                                                   | 26 300                  | (10 265)                          | (5 046)                                                    | 6 480                   | 1 434                             |
| UAG          | (13 408)                                                   | 12 970                  | (438)                             | (1 442)                                                    | 3 210                   | 1 768                             |
| WST          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 18 062                                                     | (20 010)                | (1 948)                           |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 20,71            | 15,99                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 41,63            | 35,04                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,57             | 0,30                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,92             | 0,62                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 1,89             | 8,68                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,21             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 1,36             | 1,16                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,41             | 0,34                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,05             | 0,04                 |
| Autres actifs                                                    | 32,25            | 37,80                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                       | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                         | 1,67             | 1,47                 |
| Obligations et billets privés                                                           | 26,86            | 21,15                |
| Obligations et billets convertibles                                                     | 0,05             | 0,04                 |
| Obligations et billets municipaux                                                       | 0,02             | 0,04                 |
| Agences du gouvernement américain                                                       | 60,31            | 61,62                |
| Obligations du Trésor américain                                                         | 18,63            | 18,95                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 6,50             | 6,80                 |
| Titres adossés à des actifs                                                             | 10,84            | 9,47                 |
| Émissions souveraines                                                                   | 12,04            | 7,82                 |
| Actions ordinaires                                                                      | 0,19             | 0,33                 |
| Bons de souscription                                                                    | 0,00             | 0,00                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,02             | 0,04                 |
| Sociétés d'investissement immobilier                                                                     | 0,12             | 0,13                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,38             | 0,49                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 2,02             | 1,54                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 4,12             | 21,70                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,00             | (0,11)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,01             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,11             | 0,05                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 1,40             | 1,40                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,06             | 0,07                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options à taux d'intérêt plafonnées                                                                      | 0,00             | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,07             | 0,10                 |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,01             | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,29             | (0,24)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,68)           | 0,46                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,11             | 0,10                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (0,98)           | (0,02)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (44,17)          | (53,41)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

[Voir les notes annexes](#)



# Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Centene Corp.                           |                                     |                                  |                           | Venture Global LNG, Inc.                                  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/04/2053 - 01/03/2055                                                   | \$ 39 722                           | \$ 40 666                        | 5,64                      |
| 2,450 % éch. 15/07/2028                 | \$ 140                              | \$ 133                           | 0,02                      | 9,500 % éch. 01/02/2029                                   | \$ 1 400                            | \$ 1 508                         | 0,21                      | 7,000 % éch. 01/03/2045                                                                | 19                                  | 20                               | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/03/2031                 | 100                                 | 87                               | 0,01                      | 9,875 % éch. 01/02/2032                                   | 800                                 | 854                              | 0,12                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA                         |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/02/2030                 | 1 000                               | 933                              | 0,13                      | Viper Energy Partners LLC                                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/08/2056                                                                | 6 100                               | 5 316                            | 0,74                      |
| 4,250 % éch. 15/12/2027                 | 293                                 | 292                              | 0,04                      | 4,900 % éch. 01/08/2030                                   | 100                                 | 100                              | 0,01                      | 3,500 % éch. 01/07/2056                                                                | 7 900                               | 7 169                            | 1,00                      |
| Charter Communications Operating LLC    |                                     |                                  |                           | Windstream Services LLC                                   |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/08/2056                                                                | 8 800                               | 8 220                            | 1,14                      |
| 3,500 % éch. 01/06/2041                 | 100                                 | 70                               | 0,01                      | 8,250 % éch. 01/10/2031                                   | 700                                 | 739                              | 0,10                      | 4,500 % éch. 01/08/2056                                                                | 15 500                              | 14 837                           | 2,06                      |
| Choice Hotels International, Inc.       |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     | 65 091                           | 9,03                      | 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                | 45 250                              | 44 469                           | 6,17                      |
| 5,850 % éch. 01/08/2034                 | 100                                 | 102                              | 0,01                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/07/2056                                                                | 19 825                              | 19 891                           | 2,76                      |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.    |                                     |                                  |                           | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 01/08/2056                                                                | 35 250                              | 35 923                           | 4,99                      |
| 7,750 % éch. 15/04/2028                 | 240                                 | 241                              | 0,03                      | AEP Texas, Inc.                                           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/08/2056                                                                | 43 200                              | 44 639                           | 6,20                      |
| Daimler Truck Finance North America LLC |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 15/04/2036                                   | 2 100                               | 2 072                            | 0,29                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,150 % éch. 12/01/2029                 | 3 200                               | 3 160                            | 0,44                      | Anglian Water Services Financing PLC                      | £ 1 000                             | 1 350                            | 0,19                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                        |                                     |                                  |                           |
| Directv Financing LLC                   |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 20/06/2031                                   |                                     |                                  |                           | Obligations du Trésor américain                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/08/2027                 | 22                                  | 22                               | 0,00                      | Edison International                                      |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/08/2054                                                                | 600                                 | 536                              | 0,07                      |
| DISH DBS Corp.                          |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 05/05/2028                                   | \$ 500                              | 501                              | 0,07                      | 4,500 % éch. 15/11/2054                                                                | 3 200                               | 2 980                            | 0,41                      |
| 5,250 % éch. 01/12/2026                 | 2 260                               | 2 237                            | 0,31                      | 6,250 % éch. 15/03/2030                                   | 3 000                               | 3 084                            | 0,43                      | 4,625 % éch. 15/11/2045                                                                | 2 447                               | 2 350                            | 0,33                      |
| 5,750 % éch. 01/12/2028                 | 230                                 | 223                              | 0,03                      | EPH Financing International A/S                           | € 800                               | 934                              | 0,13                      | 4,750 % éch. 15/02/2056 (h)                                                            | 12 539                              | 12 183                           | 1,69                      |
| Elevance Health, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 02/07/2032                                   |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/08/2045                                                                | 254                                 | 252                              | 0,04                      |
| 4,750 % éch. 15/02/2030                 | 100                                 | 100                              | 0,01                      | Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC                          |                                     |                                  |                           | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)                             |                                     |                                  |                           |
| Enbridge, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 17/02/2027                                   | 250                                 | 242                              | 0,03                      | 0,125 % éch. 15/02/2052                                                                | 718                                 | 372                              | 0,05                      |
| 5,700 % éch. 08/03/2033                 | 400                                 | 413                              | 0,06                      | ONEOK, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | 0,250 % éch. 15/07/2029                                                                | 521                                 | 497                              | 0,07                      |
| Energy Transfer LP                      |                                     |                                  |                           | 5,650 % éch. 01/09/2034                                   | \$ 900                              | 917                              | 0,13                      | 0,625 % éch. 15/07/2032                                                                | 4 469                               | 4 140                            | 0,57                      |
| 6,500 % éch. 01/02/2042                 | 1 500                               | 1 586                            | 0,22                      | 6,050 % éch. 01/09/2033                                   | 350                                 | 367                              | 0,05                      | 0,750 % éch. 15/02/2045                                                                | 3 026                               | 2 150                            | 0,30                      |
| Flora Food Management BV                |                                     |                                  |                           | Pacific Gas & Electric Co.                                |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/02/2049                                                                | 1 058                               | 744                              | 0,10                      |
| 7,500 % éch. 31/10/2030                 | € 600                               | 684                              | 0,09                      | 2,500 % éch. 01/02/2031                                   | 2 700                               | 2 423                            | 0,34                      | 1,375 % éch. 15/07/2033                                                                | 17 539                              | 16 829                           | 2,34                      |
| GSG Bidco Ltd.                          |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/06/2028                                   | 300                                 | 290                              | 0,04                      | 1,625 % éch. 15/10/2027                                                                | 337                                 | 336                              | 0,05                      |
| 5,375 % éch. 15/06/2036                 | 1 200                               | 1 362                            | 0,19                      | 4,450 % éch. 15/04/2042                                   | 250                                 | 208                              | 0,03                      | 1,625 % éch. 15/04/2030                                                                | 2 196                               | 2 170                            | 0,30                      |
| Harbour Energy PLC                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 04/06/2028                                   | 100                                 | 101                              | 0,01                      | 1,875 % éch. 15/07/2034 (h)(i)                                                         | 9 125                               | 8 996                            | 1,25                      |
| 6,327 % éch. 01/04/2035                 | \$ 100                              | 102                              | 0,01                      | 5,200 % éch. 01/05/2036                                   | 700                                 | 680                              | 0,09                      | 1,875 % éch. 15/07/2035                                                                | 4 624                               | 4 523                            | 0,63                      |
| iHeartCommunications, Inc.              |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 01/03/2052                                   | 200                                 | 174                              | 0,02                      | 2,125 % éch. 15/02/2054                                                                | 2 495                               | 2 181                            | 0,30                      |
| 7,000 % éch. 15/01/2031                 | 320                                 | 282                              | 0,04                      | 5,900 % éch. 15/06/2032                                   | 1 400                               | 1 448                            | 0,20                      | Billets du Trésor américain                                                            |                                     |                                  |                           |
| Imperial Brands Finance PLC             |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/08/2035                                   | 200                                 | 206                              | 0,03                      | 3,500 % éch. 31/01/2028 (i)                                                            | 1 100                               | 1 089                            | 0,15                      |
| 3,875 % éch. 02/08/2033                 | € 600                               | 680                              | 0,09                      | 6,100 % éch. 15/01/2029                                   | 500                                 | 515                              | 0,07                      | 3,875 % éch. 31/12/2027                                                                | 1 600                               | 1 593                            | 0,22                      |
| 3,875 % éch. 12/02/2034                 | 100                                 | 113                              | 0,02                      | 6,700 % éch. 01/04/2053                                   | 400                                 | 416                              | 0,06                      | 4,000 % éch. 31/07/2032 (h)                                                            | 7 000                               | 6 900                            | 0,96                      |
| 4,500 % éch. 30/06/2028                 | \$ 200                              | 200                              | 0,03                      | PacifiCorp                                                |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/11/2032                                                                | 1 200                               | 1 189                            | 0,16                      |
| Informa PLC                             |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 15/02/2034                                   | 300                                 | 304                              | 0,04                      | 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                | 130                                 | 127                              | 0,02                      |
| 3,000 % éch. 23/10/2027                 | € 350                               | 401                              | 0,06                      | Petrobras Global Finance BV                               |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 23/10/2030                 | 350                                 | 398                              | 0,05                      | 6,850 % éch. 05/06/2115                                   | 45                                  | 42                               | 0,01                      |                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| LG Energy Solution Ltd.                 |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 17/03/2044                                   | 42                                  | 43                               | 0,01                      | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 02/04/2028                 | \$ 200                              | 201                              | 0,03                      | Severn Trent Utilities Finance PLC                        | € 100                               | 114                              | 0,01                      | 1211 Avenue of the Americas Trust                                                      |                                     |                                  |                           |
| Nissan Motor Co. Ltd.                   |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 04/08/2035                                   |                                     |                                  |                           | 4,280 % éch. 10/08/2035                                                                | 400                                 | 382                              | 0,05                      |
| 4,345 % éch. 17/09/2027                 | 960                                 | 945                              | 0,13                      | SW Finance PLC                                            | £ 600                               | 777                              | 0,11                      | 280 Park Avenue Mortgage Trust                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 17/07/2033                 | € 850                               | 994                              | 0,14                      | 5,750 % éch. 19/11/2030                                   | 1 800                               | 2 293                            | 0,32                      | 5,448 % éch. 15/09/2034                                                                | 100                                 | 100                              | 0,01                      |
| 7,500 % éch. 17/07/2030                 | \$ 850                              | 877                              | 0,12                      | 6,125 % éch. 19/11/2033                                   |                                     |                                  |                           | Adjustable Rate Mortgage Trust                                                         |                                     |                                  |                           |
| Norsk Hydro ASA                         |                                     |                                  |                           | Uniti Group LP                                            | \$ 1 790                            | 1 869                            | 0,26                      | 4,003 % éch. 25/08/2036                                                                | 599                                 | 205                              | 0,03                      |
| 3,625 % éch. 23/01/2032                 | € 700                               | 806                              | 0,11                      | 8,625 % éch. 15/06/2032                                   |                                     |                                  |                           | AFG Trust                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Novartis Capital Corp.                  |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 15/10/2033                                   | 800                                 | 871                              | 0,12                      | 5,012 % éch. 10/10/2057                                                                | AUD 1 588                           | 1 100                            | 0,15                      |
| 4,100 % éch. 16/03/2029                 | \$ 200                              | 198                              | 0,03                      |                                                           |                                     | 22 241                           | 3,09                      | 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                | 2 600                               | 1 797                            | 0,25                      |
| 4,400 % éch. 18/03/2031                 | 200                                 | 199                              | 0,03                      | Total des Obligations et billets privés                   |                                     | 181 016                          | 25,12                     | Alba PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,600 % éch. 18/03/2033                 | 200                                 | 198                              | 0,03                      | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES                       |                                     |                                  |                           | 4,126 % éch. 15/12/2038                                                                | £ 385                               | 484                              | 0,07                      |
| NTT Finance Corp.                       |                                     |                                  |                           | Country Garden Holdings Co. Ltd.                          |                                     |                                  |                           | Aran Funding DAC                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 2,906 % éch. 16/03/2029                 | € 100                               | 114                              | 0,02                      | 0,000 % éch. 31/12/2031 (b)                               | 69                                  | 5                                | 0,00                      | 3,379 % éch. 24/12/2065                                                                | € 2 868                             | 3 284                            | 0,46                      |
| Oracle Corp.                            |                                     |                                  |                           | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                         |                                     |                                  |                           | Atlas Funding PLC                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 2,300 % éch. 25/03/2028                 | \$ 310                              | 297                              | 0,04                      | Ginnie Mae                                                |                                     |                                  |                           | 4,563 % éch. 20/01/2068                                                                | £ 2 800                             | 3 724                            | 0,52                      |
| 4,550 % éch. 04/02/2029                 | 1 700                               | 1 676                            | 0,23                      | 3,500 % éch. 20/01/2056 - 20/03/2056                      | 5 569                               | 5 006                            | 0,70                      | Bletchley Park Funding PLC                                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 03/08/2028                 | 490                                 | 489                              | 0,07                      | 5,500 % éch. 20/07/2053 - 20/08/2053                      | 460                                 | 466                              | 0,06                      | 5,034 % éch. 27/07/2070                                                                | 1 000                               | 1 334                            | 0,19                      |
| ORLEN S.A.                              |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae, TBA                                           |                                     |                                  |                           | Countrywide Alternative Loan Trust                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 30/01/2035                 | 1 900                               | 1 969                            | 0,27                      | 5,000 % éch. 01/07/2056                                   | 200                                 | 197                              | 0,03                      | 4,123 % éch. 25/06/2047                                                                | \$ 1 970                            | 1 807                            | 0,25                      |
| Petroleos Mexicanos                     |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/07/2056                                   | 1 300                               | 1 307                            | 0,18                      | 4,218 % éch. 20/07/2035                                                                | 1 436                               | 1 401                            | 0,19                      |
| 6,500 % éch. 02/06/2041                 | 1 200                               | 1 078                            | 0,15                      | 6,000 % éch. 01/09/2056                                   | 1 300                               | 1 324                            | 0,18                      | Dilosk RMBS DAC                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,700 % éch. 16/02/2032                 | 279                                 | 282                              | 0,04                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                                  |                           | 2,733 % éch. 25/10/2064                                                                | € 3 600                             | 4 111                            | 0,57                      |
| Prosus NV                               |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/06/2052 - 01/08/2052                      | 2 247                               | 1 964                            | 0,27                      | 2,845 % éch. 25/01/2063                                                                | 866                                 | 990                              | 0,14                      |
| 3,257 % éch. 19/01/2027                 | 200                                 | 198                              | 0,03                      | 4,000 % éch. 01/09/2048 - 01/01/2056                      | 16 332                              | 15 284                           | 2,12                      | 3,080 % éch. 24/09/2060                                                                | 1 796                               | 2 055                            | 0,29                      |
| RD Michigan Property Owner LLC          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/10/2052 - 01/01/2056                      | 14 446                              | 13 885                           | 1,93                      | Edenbrook Mortgage Funding PLC                                                         |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                 | 11 612                              | 11 580                           | 1,61                      | 5,000 % éch. 01/01/2053 - 01/01/2056                      | 57 013                              | 56 366                           | 7,82                      | 5,096 % éch. 22/03/2057                                                                | £ 992                               | 1 325                            | 0,18                      |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust      |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/03/2053 - 01/12/2055                      | 20 346                              | 20 461                           | 2,84                      | Eurosail PLC                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,100 % éch. 01/10/2029                 | 700                                 | 679                              | 0,09                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 2,841 % éch. 13/03/2045                                                                | € 500                               | 554                              | 0,08                      |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC    |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     |                                  |                           | 2,851 % éch. 13/03/2045                                                                | 1 500                               | 1 606                            | 0,22                      |
| 9,750 % éch. 10/10/2027                 | £ 222                               | 313                              | 0,04                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 4,866 % éch. 13/06/2045                                                                | £ 1 003                             | 1 293                            | 0,18                      |
| TransDigm, Inc.                         |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     |                                  |                           | Great Hall Mortgages PLC                                                               |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 31/07/2034                 | \$ 950                              | 950                              | 0,13                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 3,608 % éch. 18/06/2039                                                                | € 400                               | 441                              | 0,06                      |
| United Airlines, Inc.                   |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     |                                  |                           | 4,126 % éch. 18/06/2038                                                                | £ 1 068                             | 1 414                            | 0,20                      |
| 4,625 % éch. 15/04/2029 (h)             | 1 000                               | 987                              | 0,14                      |                                                           |                                     |                                  |                           | 4,166 % éch. 18/06/2039                                                                | 917                                 | 1 204                            | 0,17                      |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC       |                                     |                                  |                           |                                                           |                                     |                                  |                           | 4,326 % éch. 18/06/2038                                                                | 2 400                               | 3 122                            | 0,43                      |
| 3,875 % éch. 15/08/2029                 | 200                                 | 191                              | 0,03                      |                                                           |                                     |                                  |                           |                                                                                        |                                     |                                  |                           |

[Voir les notes annexes](#)

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

| DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|------|
| PRÊTS HYPOTHÉCAIRES EN GARANTIE                                   |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement hongrois     |                                     |                                  |                           | TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION        |         |                                  |                           |      |
| First Franklin Mortgage Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 16/06/2034                                | €                                   | 300                              | \$ 359                    | NVIDIA Corp.                         | 3 694   | \$ 739                           | 0,11                      |      |
| 4,303 % éch. 25/03/2036                                           | \$                                  | 638                              | \$ 621                    | 4,875 % éch. 22/03/2040                                |                                     | 100                              | 120                       | IMMOBILIER                           |         |                                  |                           |      |
| GSAMP Trust                                                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement israélien    |                                     |                                  |                           | Country Garden Holdings Co. Ltd. (a) | 48 138  | 1                                | 0,00                      |      |
| 3,485 % éch. 25/11/2034                                           |                                     | 1 262                            | 1 121                     | 5,000 % éch. 30/10/2026                                |                                     | 1 000                            | 1 151                     |                                      |         | 754                              | 0,11                      |      |
| Lehman XS Trust                                                   |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 19/02/2030                                | \$                                  | 400                              | 406                       | INSTRUMENTS A COURT TERME            |         |                                  |                           |      |
| 4,183 % éch. 25/05/2037                                           |                                     | 2 072                            | 1 839                     | 5,625 % éch. 19/02/2035                                |                                     | 300                              | 307                       | BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN              |         |                                  |                           |      |
|                                                                   |                                     |                                  | 3 581                     | Obligation internationale du gouvernement japonais     |                                     |                                  |                           | 23,650 % éch. 13/10/2026 (b)(c)      | EGP     | 39 600                           | 756                       | 0,11 |
|                                                                   |                                     |                                  | 147 483                   | 2,100 % éch. 20/09/2054                                | ¥                                   | 58 450                           | 248                       | 24,000 % éch. 13/10/2026 (b)(c)      |         | 54 200                           | 1 034                     | 0,14 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                             |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 20/12/2054                                |                                     | 25 050                           | 112                       | 24,060 % éch. 20/10/2026 (b)(c)      |         | 1 600                            | 30                        | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2055                                |                                     | 74 000                           | 337                       |                                      |         |                                  | 1 820                     | 0,25 |
| 0,750 % éch. 09/07/2030                                           |                                     | 3 067                            | 2 721                     | 2,700 % éch. 20/09/2045                                |                                     | 73 950                           | 400                       | BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN              |         |                                  |                           |      |
| 3,500 % éch. 09/07/2041                                           |                                     | 1 872                            | 1 404                     | 3,200 % éch. 20/09/2055                                |                                     | 98 000                           | 529                       | 20,422 % éch. 12/01/2027 (b)(c)      | NGN     | 228 400                          | 150                       | 0,02 |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                           |                                     | 979                              | 786                       | Magyar Export-Import Bank                              |                                     |                                  |                           | BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAÎN          |         |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 09/01/2038                                           |                                     | 63                               | 53                        | 4,500 % éch. 27/11/2031                                | €                                   | 300                              | 353                       | 7,046 % éch. 27/01/2027 (b)(c)       | ZAR     | 6 200                            | 364                       | 0,05 |
| Baiterek National Investment Holding JSC                          |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain     |                                     |                                  |                           | 7,066 % éch. 28/10/2026 (b)(c)       |         | 500                              | 30                        | 0,01 |
| 16,950 % éch. 02/04/2029                                          | KZT                                 | 407 000                          | 865                       | 4,625 % éch. 04/05/2033                                |                                     | 200                              | 233                       | 7,304 % éch. 19/08/2026 (b)(c)       |         | 2 600                            | 157                       | 0,02 |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                                          |                                     | 328 000                          | 706                       | 4,750 % éch. 22/03/2031                                | \$                                  | 600                              | 586                       | 7,305 % éch. 18/11/2026 (b)(c)       |         | 4 600                            | 274                       | 0,04 |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien               |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 09/02/2034                                |                                     | 1 550                            | 1 527                     | 7,393 % éch. 22/07/2026 (b)(c)       |         | 4 600                            | 280                       | 0,04 |
| 5,500 % éch. 23/04/2036                                           | €                                   | 1 200                            | 1 388                     | 5,625 % éch. 22/09/2035                                |                                     | 600                              | 584                       | 7,400 % éch. 05/08/2026 (b)(c)       |         | 600                              | 36                        | 0,01 |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare                 |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 13/05/2030                                |                                     | 200                              | 205                       | 7,400 % éch. 07/10/2026 (b)(c)       |         | 200                              | 12                        | 0,00 |
| 3,500 % éch. 07/05/2034                                           |                                     | 500                              | 569                       | 6,350 % éch. 09/02/2035                                |                                     | 200                              | 205                       | 7,401 % éch. 05/08/2026 (b)(c)       |         | 2 700                            | 164                       | 0,02 |
| 4,125 % éch. 07/05/2038                                           |                                     | 500                              | 574                       | 6,875 % éch. 13/05/2037                                |                                     | 200                              | 210                       | 7,420 % éch. 04/11/2026 (b)(c)       |         | 100                              | 6                         | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement chilien                 |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien     |                                     |                                  |                           |                                      |         |                                  | 1 323                     | 0,19 |
| 3,750 % éch. 14/01/2032                                           |                                     | 300                              | 347                       | 5,400 % éch. 12/08/2034                                | PEN                                 | 600                              | 172                       | Total des Instruments à court terme  |         |                                  | 3 293                     | 0,46 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien               |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 12/08/2032                                |                                     | 6 800                            | 2 160                     | ACTIONS                              |         |                                  |                           |      |
| 5,375 % éch. 21/01/2029                                           | \$                                  | 2 900                            | 2 895                     | 6,850 % éch. 12/08/2035                                |                                     | 13 000                           | 4 013                     | FONDS D'INVESTISSEMENT               |         |                                  |                           |      |
| 5,625 % éch. 19/02/2036                                           | €                                   | 400                              | 455                       | 7,300 % éch. 12/08/2033                                |                                     | 4 700                            | 1 544                     | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF    |         |                                  |                           |      |
| 5,750 % éch. 26/11/2034                                           |                                     | 400                              | 466                       | 7,600 % éch. 12/08/2039                                |                                     | 4 500                            | 1 418                     | PIMCO Select Funds plc -             |         |                                  |                           |      |
| 6,125 % éch. 21/01/2031                                           | \$                                  | 800                              | 809                       | Obligation internationale du gouvernement polonais     |                                     |                                  |                           | Fonds PIMCO US Dollar                |         |                                  |                           |      |
| 6,500 % éch. 21/01/2033                                           |                                     | 800                              | 814                       | 4,875 % éch. 12/02/2030                                | \$                                  | 600                              | 607                       | Short-Term Floating NAV              |         |                                  |                           |      |
| 6,500 % éch. 26/11/2038                                           | €                                   | 300                              | 361                       | Obligation internationale du gouvernement qatari       |                                     |                                  |                           | Fund (f)                             | 10 914  | 109                              | 0,02                      |      |
| TES colombien                                                     |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                                |                                     | 2 500                            | 2 513                     | Total des Valeurs mobilières         |         | \$ 912 609                       | 126,66                    |      |
| 9,250 % éch. 28/05/2042                                           | COP                                 | 950 000                          | 224                       | Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                     |                                  |                           | FONDS D'INVESTISSEMENT               |         |                                  |                           |      |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                          |                                     | 4 144 400                        | 1 167                     | 3,750 % éch. 07/02/2034                                | €                                   | 220                              | 228                       | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF    |         |                                  |                           |      |
| 11,500 % éch. 25/07/2046                                          |                                     | 1 036 000                        | 292                       | 5,250 % éch. 10/03/2030                                |                                     | 400                              | 475                       | PIMCO Select Funds plc -             |         |                                  |                           |      |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                          |                                     | 16 982 800                       | 4 838                     | 5,250 % éch. 30/05/2032                                |                                     | 1 100                            | 1 284                     | Fonds PIMCO US Dollar                |         |                                  |                           |      |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                          |                                     | 6 696 700                        | 2 026                     | 5,375 % éch. 07/06/2033                                |                                     | 1 700                            | 1 964                     | Short-Term Floating NAV              |         |                                  |                           |      |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                                          |                                     | 6 565 500                        | 2 009                     | 5,500 % éch. 18/09/2028                                |                                     | 150                              | 178                       | Fund (f)                             | 10 914  | 109                              | 0,02                      |      |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain             |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/05/2037                                |                                     | 1 100                            | 1 241                     | Total des Fonds d'investissement     |         | \$109                            | 0,02                      |      |
| 5,500 % éch. 21/11/2030                                           | €                                   | 2 500                            | 3 007                     | 6,375 % éch. 18/09/2033                                |                                     | 150                              | 183                       | FONDS D'INVESTISSEMENT               |         |                                  |                           |      |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF    |         |                                  |                           |      |
| 18,400 % éch. 16/10/2028                                          | KZT                                 | 882 000                          | 1 921                     | 7,000 % éch. 28/02/2031                                | ZAR                                 | 46 200                           | 2 723                     | PIMCO Select Funds plc -             |         |                                  |                           |      |
| Eagle Funding Luxco SARL                                          |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 31/01/2030                                |                                     | 4 200                            | 258                       | Fonds PIMCO US Dollar                |         |                                  |                           |      |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                                           | \$                                  | 2 580                            | 2 594                     | 8,500 % éch. 31/01/2037                                |                                     | 108 20                           |                           | Short-Term Floating NAV              |         |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien                |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     | 0                                | 6 577                     | Fund (f)                             | 10 914  | 109                              | 0,02                      |      |
| 19,698 % éch. 14/10/2030                                          | EGP                                 | 102 100                          | 1 978                     | 8,875 % éch. 28/02/2035                                |                                     | 45 700                           | 2 890                     | Total des Fonds d'investissement     |         | \$109                            | 0,02                      |      |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 31/01/2040                                |                                     | 2 200                            | 136                       | FONDS D'INVESTISSEMENT               |         |                                  |                           |      |
| 4,875 % éch. 30/04/2029                                           | \$                                  | 600                              | 604                       | Obligation internationale du gouvernement turc         |                                     |                                  |                           | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF    |         |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                           |                                     | 600                              | 610                       | 5,250 % éch. 13/03/2030                                | \$                                  | 2 400                            | 2 332                     | PIMCO Select Funds plc -             |         |                                  |                           |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           | 40,305 % éch. 06/09/2028                               | TRY                                 | 900                              | 19                        | Fonds PIMCO US Dollar                |         |                                  |                           |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 19/08/2026                               |                                     | 100                              | 2                         | Short-Term Floating NAV              |         |                                  |                           |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           | 40,760 % éch. 17/05/2028                               |                                     | 19 300                           | 418                       | Fund (f)                             | 10 914  | 109                              | 0,02                      |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  | 77 690                    | Total des Fonds d'investissement     |         | \$109                            | 0,02                      |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           | ACTIONS                                                |                                     |                                  |                           |                                      |         |                                  |                           |      |
| ACTIONS ORDINAIRES                                                |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |                                      |         |                                  |                           |      |
| SERVICES DE COMMUNICATION                                         |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |                                      |         |                                  |                           |      |
| SES S.A. (a)                                                      |                                     |                                  |                           | 937                                                    |                                     |                                  |                           | 14                                   | 0,00    |                                  |                           |      |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 81                    | \$ 91                                   | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre             | Long  | 09/2026              | 108                   | 141                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre        | Court | 09/2026              | 25                    | (68)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre         | Long  | 09/2026              | 294                   | 631                                     | 0,09                   |
|                                                                                            |       |                      |                       | \$ 795                                  | 0,11                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                 |       |                      |                       | \$ 795                                  | 0,11                   |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Boeing Co.          | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 1 300                         | \$ 3                              | 0,00                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 460                           | \$ 4                              | 0,00                |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2027      | 900                              | 21                                | 0,00                |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2028      | 600                              | 22                                | 0,01                |
| Indice CDX.EM-41 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2029      | 200                              | 9                                 | 0,00                |
| Indice CDX.EM-42 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2029      | 300                              | 11                                | 0,00                |
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2030      | 100                              | 2                                 | 0,00                |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 200                              | 5                                 | 0,00                |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 14 112                           | 361                               | 0,05                |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                | 20/06/2031      | 26 829                           | 299                               | 0,04                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 734                            | 0,10                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 35 200          | \$ 58                             | 0,01                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,750     | 18/03/2027      | 28 400            | (123)                             | (0,02)              |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 730               | (58)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 16/06/2028      | ¥ 130 000         | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 15/12/2028      | 490 000           | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,200     | 15/12/2041      | 30 000            | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 15/06/2032      | 27 400            | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 16/06/2051      | \$ 450            | 35                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 21/12/2052      | 800               | 89                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,750     | 21/06/2053      | 1 750             | 219                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2027      | 14 000            | 29                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      | 69 600            | (453)                             | (0,06)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030      | 29 700            | (174)                             | (0,02)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 21/06/2033      | 9 850             | 128                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2055      | 4 400             | 330                               | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 3 090             | 54                                | 0,01                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/12/2027      | 66 575            | (917)                             | (0,13)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/12/2028      | 6 700             | (135)                             | (0,02)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2030      | 1 900             | 25                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/12/2033      | 200               | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 4 300             | 197                               | 0,03                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/12/2054      | 700               | (94)                              | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055      | 200               | (12)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,610     | 12/12/2032      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2026      | 8 800             | 22                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2026      | 105 900           | 144                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      | 55 100            | (436)                             | (0,06)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2029      | 4 000             | 27                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 5 200             | 12                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2030      | 27 800            | (420)                             | (0,06)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030      | 7 100             | 174                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2031      | 1 800             | 55                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 2 830             | 32                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2032      | 8 600             | (324)                             | (0,04)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 11 400            | 148                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 9 700             | (298)                             | (0,04)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 15 100            | 164                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2055      | 1 200             | (51)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 15/11/2053      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 1 180             | (4)                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 45 990            | (469)                             | (0,06)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 12 300            | 294                               | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,085     | 15/11/2053      | 409               | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,250     | 20/03/2034      | 3 400             | 138                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,257     | 15/11/2053      | 9 380             | (79)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,259     | 15/11/2053      | 13 060            | (116)                             | (0,02)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,262     | 15/11/2053      | 9 390             | (87)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 12,841    | 02/01/2031      | BRL 41 400        | (200)                             | (0,03)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,172    | 02/01/2031      | 17 300            | (72)                              | (0,01)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,180    | 02/01/2031      | 33 500            | (126)                             | (0,02)              |
| À payer                           | CDI BRL à un an                   | 13,354    | 02/01/2029      | 22 900            | (114)                             | (0,02)              |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(3)</sup>                             | CDI BRL à un an         | 14,684 %  | 02/01/2031      | BRL 77 100        | \$ 64                             | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 3,500     | 19/03/2027      | AUD 5 000         | (13)                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,150     | 19/03/2055      | 300               | (17)                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,250     | 19/03/2030      | 5 300             | (86)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,250     | 18/03/2036      | 19 920            | (55)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 19/03/2035      | 2 900             | (66)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 18/06/2035      | 7 600             | (237)                             | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250     | 16/09/2028      | € 3 200           | 33                                | 0,01                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 5 900             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,547     | 09/03/2033      | 100               | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 1 800             | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 8 400             | 0                                 | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (2 742)                        | (0,38)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (2 005)                        | (0,28)              |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                            | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 3,000 % échéance 01/07/2056 | \$ 70,000       | 06/07/2026        | 6 300                            | \$ 0 | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 3,500 % échéance 01/07/2056 | 70,000          | 06/07/2026        | 7 900                            | 0    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % échéance 01/08/2056 | 70,000          | 06/08/2026        | 8 800                            | 0    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,500 % échéance 01/07/2056 | 70,000          | 06/07/2026        | 15 000                           | 1    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,000 % échéance 01/07/2056 | 70,000          | 06/07/2026        | 13 850                           | 1    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,000 % échéance 01/08/2056 | 70,000          | 06/08/2026        | 30 000                           | 1    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,500 % échéance 01/07/2056 | 70,000          | 06/07/2026        | 19 800                           | 1    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % échéance 01/08/2056 | 70,000          | 06/08/2026        | 35 250                           | 1    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,500 % échéance 01/07/2056 | 70,000          | 06/07/2026        | 43 200                           | 2    | 0            | 0,00                |
|              |                                                                                                                        |                 |                   |                                  | \$ 7 | \$ 0         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                    | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Obligation internationale du gouvernement israélien    | 1,000 %              | 20/12/2029      | \$ 100                           | \$ (3)                 | \$ 5                              | \$ 2         | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement israélien    | 1,000                | 20/12/2029      | 100                              | (2)                    | 4                                 | 2            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/12/2026      | 200                              | (9)                    | 10                                | 1            | 0,00                |
|              |                                                        |                      |                 |                                  | \$ (14)                | \$ 19                             | \$ 5         | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 200                            | \$ 44                  | \$ (2)                            | \$ 42        | 0,01                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

#### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À payer            | Nvidia Corp. | 3 694                        | 5,620 %       | \$ 711            | 29/07/2026      | \$ 0                   | \$ (28)                           | \$ (28)      | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 5 660       | \$ 4 048          | \$ 126             | \$ 0                  | \$ 126                                  | 0,02                |
| BOA          | 07/2026           | BRL 86 021      | \$ 16 555         | 0                  | (64)                  | (64)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | £ 222           | 296               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 215          | ¥ 34 122          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 16 555          | BRL 86 687        | 62                 | 0                     | 62                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | ZAR 3 084       | \$ 177            | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 8 297 622   | 2 210             | 0                  | (155)                 | (155)                                   | (0,02)              |
|              | 09/2026           | KZT 57 385      | 114               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR 484         | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | 103             | 6                 | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 01/2027           | 5 943           | 361               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$ 4 271        | £ 3 196           | 6                  | (35)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 418             | HKD 3 277         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 857             | ¥ 136 198         | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 20              | KWD 6             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 1 307       | \$ 80             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | \$ 15           | KWD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2029           | KWD 9           | \$ 30             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 05/2030           | 50              | 171               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 06/2031           | 21              | 72                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | PEN 10 426      | 3 050             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 390         | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 859          | £ 650             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 058           | PEN 10 426        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 742           | TRY 178 932       | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 8 972       | \$ 540            | 4                  | (11)                  | (7)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | PEN 1 795       | 525               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 220          | EGP 11 944        | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 142         | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 11 211 796  | 3 006             | 0                  | (190)                 | (190)                                   | (0,03)              |
|              | 09/2026           | KZT 119 829     | 237               | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 8 707       | 2 515             | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | 2 507           | 733               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 9 493           | 2 716             | 0                  | (50)                  | (50)                                    | (0,01)              |
| DUB          | 07/2026           | KZT 47 600      | 100               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 4 849       | 290               | 2                  | (8)                   | (6)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 32 349        | 43 500            | 566                | 0                     | 566                                     | 0,08                |
|              | 07/2026           | HKD 40 288      | 5 147             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 967 025       | 5 977             | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 204          | HKD 1 603         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 101             | ¥ 16 038          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 4 276       | \$ 259            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 1 847         | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 5 977        | ¥ 964 494         | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
| GLM          | 09/2026           | 1 967           | PEN 6 751         | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 16          | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 13 757       | BRL 74 475        | 632                | 0                     | 632                                     | 0,09                |
|              | 08/2026           | ZAR 2 755       | \$ 155            | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 24 463      | 17 439            | 492                | 0                     | 492                                     | 0,07                |
|              | 07/2026           | \$ 531          | € 457             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 502           | HKD 19 572        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 244 871     | \$ 485            | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 82 978      | 4 735             | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 9 651        | MXN 167 668       | 0                  | (116)                 | (116)                                   | (0,02)              |
|              | 11/2026           | ZAR 4 404       | \$ 251            | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 102         | 73                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12 423       | AUD 17 954        | 42                 | (27)                  | 15                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 998             | € 869             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 735           | ¥ 275 779         | 0                  | (38)                  | (38)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | AUD 15 129      | \$ 10 433         | 0                  | (43)                  | (43)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | MXN 644         | 37                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 9 556        | MXN 166 785       | 0                  | (71)                  | (71)                                    | (0,01)              |
|              | 10/2026           | ZAR 188         | \$ 11             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | AUD 6           | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1             | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 997         | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 483          | € 423             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 17              | ¥ 2 772           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 524             | PEN 1 795         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| SCX          | 09/2026           | PEN 1 795       | \$ 522            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 1 383 894   | 359               | 0                  | (40)                  | (40)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | € 1 885         | 2 193             | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$ 2 324        | HKD 18 176        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 18 787      | \$ 37             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN 161 750     | 100               | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 155 009       | 180 824           | 3 602              | 0                     | 3 602                                   | 0,50                |
|              | 07/2026           | ¥ 32 108        | 201               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 10 426      | 3 058             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 468        | AUD 12 273        | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 176 477         | € 155 145         | 900                | 0                     | 900                                     | 0,12                |
|              | 07/2026           | 3 393           | ¥ 538 973         | 0                  | (76)                  | (76)                                    | (0,01)              |

## Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ 3 079        | PEN 10 426        | \$ 0               | \$ (21)               | \$ (21)                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 12 273      | \$ 8 463          | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 155 145       | 176 717           | 0                  | (897)                 | (897)                                   | (0,13)              |
|              | 08/2026           | ¥ 6             | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 10 426      | 3 068             | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | \$ 2 279        | BRL 11 626        | 0                  | (33)                  | (33)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 37 970          | £ 28 725          | 155                | 0                     | 155                                     | 0,02                |
|              | 08/2026           | COP 10 002 975  | \$ 2 622          | 0                  | (248)                 | (248)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | £ 28 725        | 37 969            | 0                  | (155)                 | (155)                                   | (0,02)              |
| UAG          | 07/2026           | \$ 526          | HKD 4 124         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 68          | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 2 983 839   | 765               | 0                  | (68)                  | (68)                                    | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 6 828           | \$ (2 567)            | \$ 4 261                                | 0,58                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 14 212      | \$ 9 799          | \$ 0               | \$ (47)               | \$ (47)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 10 179       | AUD 14 293        | 0                  | (277)                 | (277)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | 9 793           | 14 212            | 47                 | 0                     | 47                                      | 0,01                |
| BOA          | 07/2026           | AUD 222         | \$ 159            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 1 473           | 1 026             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 885        | AUD 2 730         | 9                  | (2)                   | 7                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | AUD 2 151       | \$ 1 514          | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 3 105           | 2 184             | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 1 572        | AUD 2 198         | 0                  | (49)                  | (49)                                    | (0,01)              |
| DUB          | 07/2026           | 1 106           | 1 548             | 0                  | (33)                  | (33)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD 7 571       | \$ 5 258          | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 565       | AUD 14 811        | 0                  | (305)                 | (305)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | 5 254           | 7 571             | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 12 764      | \$ 8 928          | 86                 | 0                     | 86                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 64           | AUD 90            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 8 923           | 12 764            | 0                  | (85)                  | (85)                                    | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | AUD 8 946       | \$ 6 171          | 7                  | (33)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 380        | AUD 1 923         | 0                  | (48)                  | (48)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 5 380           | 7 818             | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | AUD 170         | \$ 119            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | \$ 37           | AUD 52            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | AUD 408         | \$ 281            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 517        | AUD 3 538         | 0                  | (66)                  | (66)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 281             | 408               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 8 206           | 11 526            | 0                  | (221)                 | (221)                                   | (0,03)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 264             | \$ (1 182)            | \$ (918)                                | (0,13)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 184           | \$ 209            | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 770        | € 4 094           | 0                  | (89)                  | (89)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 59            | \$ 68             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 276             | 321               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 79           | € 68              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 3 663         | \$ 4 178          | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 184        | € 3 663           | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | € 4 115         | \$ 4 679          | 4                  | (29)                  | (25)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1            | € 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 4 433           | 3 898             | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 4 496           | 3 864             | 0                  | (78)                  | (78)                                    | (0,01)              |
| SOG          | 07/2026           | € 3 898         | \$ 4 434          | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 770        | € 4 089           | 0                  | (95)                  | (95)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 4 440           | 3 898             | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | 22              | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 20            | \$ 22             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 72              | \$ (327)              | \$ (255)                                | (0,03)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 8 085        | £ 6 023           | \$ 0               | \$ (92)               | \$ (92)                                 | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | 204             | 152               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 5 539         | \$ 7 313          | 6                  | (44)                  | (38)                                    | (0,01)              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ 9 092        | £ 6 787           | \$ 1               | \$ (85)               | \$ (84)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 6 748           | 5 117             | 43                 | 0                     | 43                                      | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | £ 778           | \$ 1 043          | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 160          | £ 121             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 445             | 331               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 5             | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 8 613        | £ 6 419           | 0                  | (94)                  | (94)                                    | (0,02)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 18            | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 183          | £ 137             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 12              | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 1 231         | \$ 1 620          | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 620        | £ 1 231           | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 6 282         | \$ 8 319          | 3                  | (22)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 883        | £ 5 956           | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 5 921         | \$ 7 821          | 0                  | (37)                  | (37)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 7            | £ 5               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 5             | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 821        | £ 5 921           | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £ 104           | \$ 137            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 137          | £ 104             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 140             | \$ (399)              | \$ (259)                                | (0,04)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en JPY (couverte) de distribution :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA                                                | 07/2026           | \$ 18 150       | ¥ 2 886 981       | \$ 0               | \$ (386)              | \$ (386)                                | (0,05)              |
| BPS                                                | 07/2026           | ¥ 574 881       | \$ 3 589          | 51                 | 0                     | 51                                      | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 9 761        | ¥ 1 551 993       | 0                  | (211)                 | (211)                                   | (0,03)              |
|                                                    | 08/2026           | 12              | 1 977             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC                                                | 07/2026           | ¥ 3 220 180     | \$ 19 921         | 106                | 0                     | 106                                     | 0,02                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 19 921       | ¥ 3 211 738       | 0                  | (108)                 | (108)                                   | (0,01)              |
| FAR                                                | 07/2026           | ¥ 3 443 009     | \$ 21 279         | 95                 | 0                     | 95                                      | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 11 956       | ¥ 1 899 850       | 0                  | (266)                 | (266)                                   | (0,04)              |
|                                                    | 08/2026           | 21 279          | 3 433 999         | 0                  | (95)                  | (95)                                    | (0,01)              |
| MBC                                                | 07/2026           | ¥ 26 341        | \$ 165            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 19 102       | ¥ 3 037 382       | 0                  | (413)                 | (413)                                   | (0,06)              |
| MYI                                                | 07/2026           | ¥ 80 782        | \$ 506            | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | 3 989 900       | 24 715            | 165                | 0                     | 165                                     | 0,02                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 21 279       | ¥ 3 430 610       | 0                  | (116)                 | (116)                                   | (0,02)              |
| SOG                                                | 07/2026           | 12 485          | 1 983 484         | 0                  | (281)                 | (281)                                   | (0,04)              |
| SSB                                                | 07/2026           | ¥ 24 798        | \$ 155            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 432             | \$ (1 876)            | \$ (1 444)                              | (0,20)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 1 404                                | 0,19                |

| DESCRIPTION                                                                 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                             |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                                  | \$ 250                        | 88                         | 0,01                |
| Obligation internationale du gouvernement russe 5,250 % échéance 23/06/2047 | 200                           | \$ 0                       | 0,00                |
| Total des Autres actifs financiers                                          |                               | \$ 88                      | 0,01                |
| Total des Investissements                                                   |                               | \$ 913 000                 | 126,71              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                      |                               | \$ (192 457)               | (26,71)             |
| Actif net                                                                   |                               | \$ 720 543                 | 100,00              |

## NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 22 567 \$ (31 décembre 2025 : 2 477 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 4 959 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 11 557 \$ (31 décembre 2025 : 7 725 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 2 260 \$ (31 décembre 2025 : 3 751 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 740                                                                            | \$ 911 796                                           | \$ 73                                             | \$ 912 609        |
| Fonds d'investissement                        | 109                                                                               | 0                                                    | 0                                                 | 109               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 723                                                                               | (529)                                                | 0                                                 | 194               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 88                                                   | 0                                                 | 88                |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 572</b>                                                                   | <b>\$ 911 355</b>                                    | <b>\$ 73</b>                                      | <b>\$ 913 000</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 652 660                                           | \$ 4 344                                          | \$ 657 004        |
| Fonds d'investissement                        | 48 920                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 48 920            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 148                                                                               | (1 763)                                              | 11                                                | (1 604)           |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 74                                                   | 0                                                 | 74                |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 49 068</b>                                                                  | <b>\$ 650 971</b>                                    | <b>\$ 4 355</b>                                   | <b>\$ 704 394</b> |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,530 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026      | \$ (1 171)       | \$ (1 172)                               | (0,16)              |
|                                               | 3,760          | 29/06/2026        | 06/07/2026      | (13 386)         | (13 389)                                 | (1,86)              |
|                                               | 3,770          | 29/06/2026        | 06/07/2026      | (2 961)          | (2 962)                                  | (0,41)              |
|                                               | 3,780          | 30/06/2026        | 07/07/2026      | (4 492)          | (4 492)                                  | (0,62)              |
|                                               | 3,830          | 24/06/2026        | 08/09/2026      | (744)            | (745)                                    | (0,11)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (22 760)</b>                       | <b>(3,16)</b>       |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                                             | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                                                      | 3,730 %        | 16/06/2026        | 07/07/2026      | \$ (1 105)       | \$ (1 107)                                                                         | (0,15)              |
|                                                                          | 3,760          | 24/06/2026        | 01/07/2026      | (1 047)          | (1 048)                                                                            | (0,15)              |
| MSC                                                                      | 3,790          | 25/06/2026        | 01/07/2026      | (2 841)          | (2 843)                                                                            | (0,39)              |
| <b>Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (4 998)</b>                                                                  | <b>(0,69)</b>       |

(1) Le montant à payer sur opération de financement par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (243)                                                   | \$ 310                  | \$ 67                             | \$ 295                                                     | \$ (330)                | \$ (35)                           |
| BOA          | (553)                                                      | 300                     | (253)                             | 222                                                        | (270)                   | (48)                              |
| BPS          | (309)                                                      | 270                     | (39)                              | 26                                                         | 0                       | 26                                |
| BRC          | 41                                                         | (40)                    | 1                                 | 321                                                        | (340)                   | (19)                              |
| CBK          | (251)                                                      | 260                     | 9                                 | (183)                                                      | 0                       | (183)                             |
| DUB          | (38)                                                       | 0                       | (38)                              | (41)                                                       | 0                       | (41)                              |
| FAR          | (25)                                                       | (40)                    | (65)                              | (779)                                                      | 800                     | 21                                |
| GLM          | 619                                                        | (630)                   | (11)                              | (38)                                                       | 70                      | 32                                |
| GST          | 2                                                          | (10)                    | (8)                               | 13                                                         | (30)                    | (17)                              |
| JPM          | 258                                                        | (270)                   | (12)                              | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |

| Counterparty | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| MBC          | \$ (589)                                                   | \$ 590                  | \$ 1                              | \$ (130)                                                   | \$ 0                    | \$ (130)                          |
| MYC          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | 2                                                          | 31                      | 33                                |
| MYI          | 11                                                         | 0                       | 11                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| NSL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 17                                                         | 0                       | 17                                |
| RYL          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | (42)                                                       | 0                       | (42)                              | (14)                                                       | 0                       | (14)                              |
| SOG          | 3 088                                                      | (3 220)                 | (132)                             | (1 445)                                                    | 1 570                   | 125                               |
| SSB          | (278)                                                      | 270                     | (8)                               | 19                                                         | 0                       | 19                                |
| UAG          | (68)                                                       | 0                       | (68)                              | (24)                                                       | 0                       | (24)                              |
| WST          | (221)                                                      | 260                     | 39                                | 315                                                        | (260)                   | 55                                |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 24,40            | 18,66                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 59,81            | 54,59                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,91             | 1,12                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,01             | 5,54                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,08             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,30             | 0,27                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,73             | 0,23                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Other assets                                                     | 13,75            | 19,56                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 1,17             | 0,56                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 25,12            | 16,23                |
| Obligations et billets convertibles                                                                      | 0,00             | 0,00                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 46,83            | 47,90                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 10,01            | 7,38                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 11,71            | 10,96                |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 20,47            | 17,68                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 10,78            | 7,55                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 0,11             | 0,02                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,46             | 0,70                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 0,02             | 8,11                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,11             | (0,07)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,10             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,38)           | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options sur titres                                                                                       | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,58             | (0,46)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,40)           | 0,21                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,01             | 0,01                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (26,71)          | (16,83)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |



## Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund

| DESCRIPTION                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)      | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)             | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |        |        |      |      |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------|------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------|-------------------------------------|----------------------------------------------|---------------------------|--------|--------|------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                              |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                   |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
| BANQUE ET FINANCE                               |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC        |                                     |                                  |                           | John Deere Capital Corp. |                                          |                                  |                           | Beignet Investor LLC |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
| 5,375 % éch. 08/05/2029                         | \$                                  | 1 000                            | \$ 1 018                  | 0,19                     | 4,400 % éch. 15/06/2029                  | \$                               | 1 300                     | \$ 1 299             | 0,25                                | 6,581 % éch. 30/05/2049                      | \$                        | 910    | \$ 929 | 0,18 |      |
| American Express Co.                            |                                     |                                  |                           |                          | JPMorgan Chase & Co.                     |                                  |                           |                      |                                     | BMW U.S. Capital LLC                         |                           |        |        |      |      |
| 5,043 % éch. 26/07/2028                         |                                     | 300                              | 302                       | 0,06                     | 1,896 % éch. 05/03/2028 (h)              | CAD                              | 1 100                     | 770                  | 0,15                                | 4,650 % éch. 19/03/2027                      |                           | 900    | 902    | 0,17 |      |
| American Honda Finance Corp.                    |                                     |                                  |                           |                          | 2,947 % éch. 24/02/2028                  | \$                               | 500                       | 495                  | 0,09                                | 4,750 % éch. 21/03/2028                      |                           | 570    | 572    | 0,11 |      |
| 4,358 % éch. 13/08/2027                         |                                     |                                  |                           |                          | 4,408 % éch. 23/04/2030                  |                                  | 300                       | 297                  | 0,06                                | 5,050 % éch. 11/08/2028                      |                           | 730    | 736    | 0,14 |      |
| American Tower Trust                            |                                     |                                  |                           |                          | 4,915 % éch. 24/01/2029                  |                                  | 1 000                     | 1 005                | 0,19                                | Boeing Co.                                   |                           |        |        |      |      |
| 5,490 % éch. 15/03/2053                         |                                     | 500                              | 504                       | 0,10                     | 6,070 % éch. 22/10/2027                  |                                  | 1 900                     | 1 909                | 0,36                                | 6,259 % éch. 01/05/2027                      |                           | 600    | 608    | 0,11 |      |
| Athene Global Funding                           |                                     |                                  |                           |                          | Lloyds Banking Group PLC                 |                                  |                           |                      |                                     | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC         |                           |        |        |      |      |
| 3,204 % éch. 23/02/2027                         | €                                   | 1 200                            | 1 375                     | 0,26                     | 3,750 % éch. 18/03/2028                  |                                  | 250                       | 249                  | 0,05                                | 5,125 % éch. 30/06/2027                      |                           | 1 500  | 1 504  | 0,29 |      |
| 4,383 % éch. 16/07/2026                         | \$                                  | 1 800                            | 1 800                     | 0,34                     | 4,241 % éch. 10/02/2030                  |                                  | 700                       | 691                  | 0,13                                | Continental Resources, Inc.                  |                           |        |        |      |      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                    |                                     |                                  |                           |                          | Lseg U.S. Fin Corp.                      |                                  |                           |                      |                                     | 2,268 % éch. 15/11/2026                      |                           | 2 900  | 2 874  | 0,55 |      |
| 5,375 % éch. 30/05/2030                         |                                     | 600                              | 606                       | 0,12                     | 4,875 % éch. 28/03/2027                  |                                  | 500                       | 502                  | 0,10                                | Fedex Freight Holding Co., Inc.              |                           |        |        |      |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.            |                                     |                                  |                           |                          | Morgan Stanley                           |                                  |                           |                      |                                     | 4,300 % éch. 15/03/2029                      |                           | 400    | 395    | 0,07 |      |
| 4,150 % éch. 03/03/2029                         |                                     | 300                              | 296                       | 0,06                     | 4,210 % éch. 20/04/2028                  |                                  | 200                       | 200                  | 0,04                                | Fidelity National Information Services, Inc. |                           |        |        |      |      |
| 4,968 % éch. 08/05/2031                         |                                     | 400                              | 399                       | 0,08                     | 4,555 % éch. 10/04/2030                  |                                  | 200                       | 199                  | 0,04                                | 4,450 % éch. 10/03/2028                      |                           | 350    | 349    | 0,07 |      |
| Banco Santander S.A.                            |                                     |                                  |                           |                          | 4,654 % éch. 13/04/2028                  |                                  | 2 000                     | 2 006                | 0,38                                | FirstEnergy Pennsylvania Electric Co.        |                           |        |        |      |      |
| 4,600 % éch. 15/04/2029                         |                                     | 2 400                            | 2 390                     | 0,46                     | Morgan Stanley Bank N.A.                 |                                  |                           |                      |                                     | 4,150 % éch. 15/03/2028                      |                           | 100    | 99     | 0,02 |      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.                       |                                     |                                  |                           |                          | 4,788 % éch. 10/05/2030                  |                                  | 300                       | 300                  | 0,06                                | Fox Corp.                                    |                           |        |        |      |      |
| 5,343 % éch. 29/06/2029                         |                                     | 300                              | 301                       | 0,06                     | 5,016 % éch. 12/01/2029                  |                                  | 1 200                     | 1 208                | 0,23                                | 4,709 % éch. 25/01/2029                      |                           | 1 500  | 1 499  | 0,29 |      |
| Bank of America Corp.                           |                                     |                                  |                           |                          | National Bank of Canada                  |                                  |                           |                      |                                     | Gartner, Inc.                                |                           |        |        |      |      |
| 4,477 % éch. 23/04/2030                         |                                     | 400                              | 398                       | 0,08                     | 3,500 % éch. 25/04/2028                  | €                                | 2 000                     | 2 313                | 0,44                                | 4,500 % éch. 01/07/2028                      |                           | 800    | 786    | 0,15 |      |
| 4,623 % éch. 09/05/2029                         |                                     | 1 900                            | 1 900                     | 0,36                     | Nissan Motor Acceptance Co. LLC          |                                  |                           |                      |                                     | Global Payments, Inc.                        |                           |        |        |      |      |
| Banque de Montréal                              |                                     |                                  |                           |                          | 5,688 % éch. 13/09/2027                  | \$                               | 200                       | 199                  | 0,04                                | 4,450 % éch. 01/06/2028                      |                           | 400    | 397    | 0,07 |      |
| 4,309 % éch. 01/06/2027                         | CAD                                 | 200                              | 143                       | 0,03                     | Norinchukin Bank                         |                                  |                           |                      |                                     | 4,500 % éch. 15/11/2028                      |                           | 400    | 395    | 0,07 |      |
| 4,567 % éch. 10/09/2027                         | \$                                  | 1 600                            | 1 600                     | 0,30                     | 4,674 % éch. 09/09/2030                  |                                  | 800                       | 792                  | 0,15                                | Hyundai Capital America                      |                           |        |        |      |      |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.         |                                     |                                  |                           |                          | Protective Life Global Funding           |                                  |                           |                      |                                     | 4,900 % éch. 23/06/2028                      |                           | 800    | 802    | 0,15 |      |
| 5,194 % éch. 16/02/2028                         |                                     | 900                              | 909                       | 0,17                     | 4,130 % éch. 22/07/2026                  |                                  | 1 000                     | 1 000                | 0,19                                | 5,131 % éch. 08/01/2027                      |                           | 1 600  | 1 607  | 0,31 |      |
| Barclays PLC                                    |                                     |                                  |                           |                          | QNB Finance Ltd.                         |                                  |                           |                      |                                     | Icon Investments Six DAC                     |                           |        |        |      |      |
| 4,565 % éch. 24/05/2030                         |                                     | 400                              | 401                       | 0,08                     | 4,538 % éch. 19/09/2027                  |                                  | 1 600                     | 1 600                | 0,30                                | 5,849 % éch. 08/05/2029                      |                           | 600    | 613    | 0,12 |      |
| BGC Group, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |                          | RGA Global Funding                       |                                  |                           |                      |                                     | Illumina, Inc.                               |                           |        |        |      |      |
| 6,150 % éch. 02/04/2030                         |                                     | 400                              | 408                       | 0,08                     | 4,600 % éch. 25/11/2030                  |                                  | 400                       | 395                  | 0,07                                | 4,650 % éch. 09/09/2026                      |                           | 300    | 300    | 0,06 |      |
| BPCE S.A.                                       |                                     |                                  |                           |                          | Royal Bank of Canada                     |                                  |                           |                      |                                     | Las Vegas Sands Corp.                        |                           |        |        |      |      |
| 6,612 % éch. 19/10/2027                         |                                     | 4 100                            | 4 125                     | 0,79                     | 4,612 % éch. 26/07/2027                  | CAD                              | 700                       | 502                  | 0,10                                | 5,625 % éch. 15/06/2028                      |                           | 500    | 506    | 0,10 |      |
| Brighthouse Financial Global Funding            |                                     |                                  |                           |                          | 4,965 % éch. 24/01/2029                  | \$                               | 500                       | 503                  | 0,10                                | 5,900 % éch. 01/06/2027                      |                           | 1 800  | 1 817  | 0,35 |      |
| 5,550 % éch. 09/04/2027                         |                                     | 400                              | 402                       | 0,08                     | Santander UK Group Holdings PLC          |                                  |                           |                      |                                     | Mercedes-Benz Finance North America LLC      |                           |        |        |      |      |
| Canadian Imperial Bank of Commerce              |                                     |                                  |                           |                          | 4,707 % éch. 22/09/2029                  |                                  | 500                       | 502                  | 0,10                                | 4,750 % éch. 31/03/2028                      |                           | 1 500  | 1 504  | 0,29 |      |
| 3,250 % éch. 31/03/2027                         |                                     |                                  |                           |                          | SBA Tower Trust                          |                                  |                           |                      |                                     | 4,900 % éch. 15/11/2027                      |                           | 400    | 402    | 0,08 |      |
| Citadel Finance LLC                             |                                     |                                  |                           |                          | 1,840 % éch. 15/04/2027                  |                                  | 800                       | 783                  | 0,15                                | National Fuel Gas Co.                        |                           |        |        |      |      |
| 4,750 % éch. 14/02/2029                         |                                     |                                  |                           |                          | Société Générale S.A.                    |                                  |                           |                      |                                     | 4,750 % éch. 15/05/2029                      |                           | 300    | 299    | 0,06 |      |
| Citigroup, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |                          | 4,857 % éch. 07/07/2029 (b)              |                                  | 500                       | 500                  | 0,09                                | Novartis Capital Corp.                       |                           |        |        |      |      |
| 4,643 % éch. 07/05/2028                         |                                     | 2 100                            | 2 102                     | 0,40                     | SRC Sukuk Ltd.                           |                                  |                           |                      |                                     | 4,100 % éch. 16/03/2029                      |                           | 300    | 298    | 0,06 |      |
| CNO Global Funding                              |                                     |                                  |                           |                          | 5,000 % éch. 27/02/2028                  |                                  | 400                       | 401                  | 0,08                                | NTT Finance Corp.                            |                           |        |        |      |      |
| 5,875 % éch. 04/06/2027                         |                                     | 1 000                            | 1 011                     | 0,19                     | Stellantis Finance U.S., Inc.            |                                  | 200                       | 201                  | 0,04                                | 4,567 % éch. 16/07/2027                      |                           | 200    | 200    | 0,04 |      |
| Cooperative Rabobank UA                         |                                     |                                  |                           |                          | 5,350 % éch. 17/03/2028                  |                                  |                           |                      |                                     | Philip Morris International, Inc.            |                           |        |        |      |      |
| 4,259 % éch. 28/08/2026                         |                                     | 1 000                            | 1 001                     | 0,19                     | Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                  | 800                       | 804                  | 0,15                                | 4,125 % éch. 28/04/2028                      |                           | 1 900  | 1 890  | 0,36 |      |
| Corebridge Global Funding                       |                                     |                                  |                           |                          | 5,328 % éch. 15/09/2028                  |                                  |                           |                      |                                     | QatarEnergy                                  |                           |        |        |      |      |
| 4,550 % éch. 09/01/2031                         |                                     | 800                              | 787                       | 0,15                     | Sumisho Air Lease Corp.                  |                                  |                           |                      |                                     | 4,625 % éch. 23/06/2029                      |                           | 200    | 199    | 0,04 |      |
| Coventry Building Society Charitable Foundation |                                     |                                  |                           |                          | 4,500 % éch. 24/03/2029                  |                                  | 900                       | 893                  | 0,17                                | RD Michigan Property Owner LLC               |                           |        |        |      |      |
| 2,625 % éch. 07/12/2026                         | €                                   | 200                              | 229                       | 0,04                     | Toronto-Dominion Bank                    |                                  |                           |                      |                                     | 7,500 % éch. 30/03/2045                      |                           | 1 600  | 1 596  | 0,30 |      |
| Crédit Agricole S.A.                            |                                     |                                  |                           |                          | 5,376 % éch. 21/10/2027                  | CAD                              | 600                       | 435                  | 0,08                                | Renesas Electronics Corp.                    |                           |        |        |      |      |
| 4,848 % éch. 11/09/2028                         | \$                                  | 300                              | 302                       | 0,06                     | Toyota Motor Credit Corp.                |                                  |                           |                      |                                     | 2,170 % éch. 25/11/2026                      |                           | 2 800  | 2 774  | 0,53 |      |
| Danske Bank A/S                                 |                                     |                                  |                           |                          | 4,550 % éch. 07/08/2026                  | \$                               | 600                       | 600                  | 0,11                                | Rogers Communications, Inc.                  |                           | CAD    | 700    | 495  | 0,09 |
| 4,662 % éch. 27/03/2029                         |                                     | 1 500                            | 1 500                     | 0,29                     | UBS AG                                   |                                  |                           |                      |                                     | 3,650 % éch. 31/03/2027                      |                           |        |        |      |      |
| Deutsche Bank AG                                |                                     |                                  |                           |                          | 4,302 % éch. 16/03/2029                  |                                  | 600                       | 598                  | 0,11                                | Southwest Airlines Co.                       |                           |        |        |      |      |
| 4,847 % éch. 16/11/2027                         |                                     | 1 500                            | 1 502                     | 0,29                     | UBS Group AG                             |                                  |                           |                      |                                     | 5,125 % éch. 15/06/2027                      | \$                        | 1 800  | 1 808  | 0,34 |      |
| Fédération des Caisses Desjardins du Québec     |                                     |                                  |                           |                          | 4,214 % éch. 10/04/2030                  |                                  | 500                       | 492                  | 0,09                                | Stryker Corp.                                |                           |        |        |      |      |
| 4,387 % éch. 30/11/2026                         | £                                   | 1 300                            | 1 728                     | 0,33                     | 4,703 % éch. 05/08/2027                  |                                  | 1 600                     | 1 600                | 0,30                                | 4,250 % éch. 11/09/2029                      |                           | 1 500  | 1 487  | 0,28 |      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                       |                                     |                                  |                           |                          | VICI Properties LP                       |                                  |                           |                      |                                     | Synopsis, Inc.                               |                           |        |        |      |      |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                         | \$                                  | 400                              | 401                       | 0,08                     | 3,750 % éch. 15/02/2027                  |                                  | 1 800                     | 1 789                | 0,34                                | 4,550 % éch. 01/04/2027                      |                           | 1 050  | 1 052  | 0,20 |      |
| Ford Motor Credit Co. LLC                       |                                     |                                  |                           |                          | 4,750 % éch. 01/04/2028                  |                                  | 250                       | 250                  | 0,05                                | TransCanada PipeLines Ltd.                   |                           |        |        |      |      |
| 4,271 % éch. 09/01/2027                         |                                     | 200                              | 199                       | 0,04                     | 5,750 % éch. 01/02/2027                  |                                  | 300                       | 301                  | 0,06                                | 3,800 % éch. 05/04/2027                      | CAD                       | 900    | 637    | 0,12 |      |
| 5,125 % éch. 05/11/2026                         |                                     | 400                              | 400                       | 0,08                     | Wells Fargo & Co.                        |                                  |                           |                      |                                     | Volkswagen Group of America Finance LLC      |                           |        |        |      |      |
| 5,918 % éch. 20/03/2028                         |                                     | 200                              | 203                       | 0,04                     | 4,808 % éch. 25/07/2028                  |                                  | 4 000                     | 4 011                | 0,77                                | 4,950 % éch. 25/03/2027                      | \$                        | 1 500  | 1 505  | 0,29 |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           | 77 151               | 14,75                               | 5,050 % éch. 27/03/2028                      |                           | 1 300  | 1 306  | 0,25 |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           | 40 564 | 7,75   |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |
|                                                 |                                     |                                  |                           |                          |                                          |                                  |                           |                      |                                     |                                              |                           |        |        |      |      |

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Edison International                               |                                     |                                  |                           | 4,728 % éch. 25/07/2055                                                                 | \$ 1 282                            | \$ 1 293                         | 0,25                      | Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.                      |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 05/05/2028                            | \$ 300                              | \$ 301                           | 0,06                      | 4,778 % éch. 25/03/2055 - 25/08/2055                                                    | 1 851                               | 1 871                            | 0,36                      | 7,000 % éch. 25/12/2018                                                 | \$ 0                                | \$ 0                             | 0,00                      |
| Energys, Inc.                                      |                                     |                                  |                           | 4,828 % éch. 25/12/2054 - 25/08/2055                                                    | 16 047                              | 16 204                           | 3,10                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 15/03/2029                            | 700                                 | 692                              | 0,13                      | 4,944 % éch. 25/02/2045                                                                 | 42                                  | 41                               | 0,01                      | 6,480 % éch. 25/10/2035                                                 | 9                                   | 9                                | 0,00                      |
| FirstEnergy Corp.                                  |                                     |                                  |                           | 5,028 % éch. 25/03/2055                                                                 | 918                                 | 928                              | 0,18                      | Countrywide Alternative Loan Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,900 % éch. 15/07/2027                            | 200                                 | 199                              | 0,04                      | 6,000 % éch. 01/12/2034                                                                 | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/10/2033                                                 | 6                                   | 7                                | 0,00                      |
| FirstEnergy Pennsylvania Electric Co.              |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 01/01/2035 - 01/07/2035                                                    | 9                                   | 9                                | 0,00                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 15/03/2028                            | 200                                 | 196                              | 0,04                      | 6,231 % éch. 01/01/2035                                                                 | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,669 % éch. 25/11/2034                                                 | 18                                  | 17                               | 0,00                      |
| Jersey Central Power & Light Co.                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/07/2043                                                                 | 56                                  | 57                               | 0,01                      | 4,959 % éch. 20/02/2035                                                 | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,600 % éch. 15/01/2030                            | 100                                 | 99                               | 0,02                      | 6,522 % éch. 01/09/2035                                                                 | 21                                  | 22                               | 0,00                      | Eurosail PLC                                                            |                                     |                                  |                           |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae                                                                              |                                     |                                  |                           | 4,816 % éch. 13/06/2045                                                 | £ 826                               | 1 094                            | 0,21                      |
| 4,189 % éch. 03/12/2027                            | 900                                 | 902                              | 0,17                      | 4,150 % éch. 20/04/2069                                                                 | 28                                  | 28                               | 0,01                      | GSR Mortgage Loan Trust                                                 |                                     |                                  |                           |
| NBN Co. Ltd.                                       |                                     |                                  |                           | 4,235 % éch. 20/06/2065                                                                 | 111                                 | 111                              | 0,02                      | 4,837 % éch. 25/09/2035                                                 | \$ 44                               | 42                               | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 01/10/2027                            | 600                                 | 596                              | 0,11                      | 4,359 % éch. 20/10/2072                                                                 | 483                                 | 485                              | 0,09                      | 6,000 % éch. 25/03/2032                                                 | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.              |                                     |                                  |                           | 4,361 % éch. 20/04/2065                                                                 | 127                                 | 127                              | 0,02                      | Harvest Funding PLC                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,428 % éch. 04/02/2028                            | 700                                 | 703                              | 0,13                      | 4,391 % éch. 20/03/2065                                                                 | 184                                 | 184                              | 0,04                      | 4,643 % éch. 15/11/2069                                                 | £ 1 000                             | 1 327                            | 0,25                      |
| Pacific Gas & Electric Co.                         |                                     |                                  |                           | 4,409 % éch. 20/04/2072                                                                 | 1 465                               | 1 462                            | 0,28                      | IndyMac Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,550 % éch. 15/05/2029                            | 200                                 | 204                              | 0,04                      | 4,411 % éch. 20/10/2064                                                                 | 313                                 | 313                              | 0,06                      | 4,243 % éch. 25/04/2035                                                 | \$ 221                              | 181                              | 0,04                      |
| PacifiCorp                                         |                                     |                                  |                           | 4,461 % éch. 20/10/2065                                                                 | 1                                   | 1                                | 0,00                      | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,650 % éch. 15/04/2029                            | 300                                 | 299                              | 0,06                      | 4,509 % éch. 20/01/2073 - 20/07/2074                                                    | 1 930                               | 1 957                            | 0,37                      | 5,169 % éch. 25/10/2034                                                 | 172                                 | 168                              | 0,03                      |
| Pinnacle West Capital Corp.                        |                                     |                                  |                           | 4,559 % éch. 20/09/2073                                                                 | 1 605                               | 1 632                            | 0,31                      | MortgageIT Trust                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 15/05/2028                            | 300                                 | 301                              | 0,06                      | 4,561 % éch. 20/05/2066                                                                 | 264                                 | 265                              | 0,05                      | 4,403 % éch. 25/02/2035                                                 | 24                                  | 24                               | 0,01                      |
| Public Service Co. of Colorado                     |                                     |                                  |                           | 4,609 % éch. 20/05/2073                                                                 | 1 766                               | 1 797                            | 0,34                      | Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 4,150 % éch. 13/03/2029                            | 500                                 | 495                              | 0,09                      | 4,661 % éch. 20/04/2066                                                                 | 349                                 | 351                              | 0,07                      | 4,323 % éch. 25/12/2035                                                 | 159                                 | 159                              | 0,03                      |
| Sempra                                             |                                     |                                  |                           | 4,709 % éch. 20/08/2073                                                                 | 4 012                               | 4 105                            | 0,79                      | Prime Mortgage Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,313 % éch. 07/01/2028                            | 1 200                               | 1 206                            | 0,23                      | 4,759 % éch. 20/08/2055                                                                 | 1 612                               | 1 634                            | 0,31                      | 4,163 % éch. 25/02/2034                                                 | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
|                                                    |                                     | 7 494                            | 1,43                      | 4,769 % éch. 20/11/2072                                                                 | 7 975                               | 8 155                            | 1,56                      | Project Cashmere                                                        |                                     |                                  |                           |
| Total des Obligations et billets privés            |                                     | 125 209                          | 23,93                     | 4,779 % éch. 20/11/2072                                                                 | 9 240                               | 9 455                            | 1,81                      | 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                             | AUD 8 700                           | 6 008                            | 1,15                      |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                  |                                     |                                  |                           | 4,811 % éch. 20/02/2062                                                                 | 3                                   | 3                                | 0,00                      | Sequoia Mortgage Trust                                                  |                                     |                                  |                           |
| Fannie Mae                                         |                                     |                                  |                           | 5,011 % éch. 20/08/2070                                                                 | 2 398                               | 2 449                            | 0,47                      | 4,174 % éch. 20/06/2036                                                 | \$ 97                               | 91                               | 0,02                      |
| 0,000 % éch. 25/04/2040 (a)(c)                     | 72                                  | 51                               | 0,01                      | 5,109 % éch. 20/08/2071                                                                 | 963                                 | 992                              | 0,19                      | 4,554 % éch. 20/10/2027                                                 | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 1,000 % éch. 25/01/2043                            | 32                                  | 28                               | 0,01                      | 5,625 % éch. 20/06/2027                                                                 | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 25/11/2046                            | 1 089                               | 1 014                            | 0,19                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                               |                                     |                                  |                           | 3,851 % éch. 25/01/2035                                                 | 50                                  | 49                               | 0,01                      |
| 2,080 % éch. 01/10/2026                            | 500                                 | 496                              | 0,10                      | 2,500 % éch. 01/02/2035                                                                 | 851                                 | 819                              | 0,16                      | Structured Asset Mortgage Investments Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 2,634 % éch. 25/12/2026                            | 323                                 | 320                              | 0,06                      | 3,000 % éch. 01/12/2026 - 01/04/2052                                                    | 10 536                              | 9 366                            | 1,79                      | 4,254 % éch. 19/07/2035                                                 | 11                                  | 10                               | 0,00                      |
| 2,840 % éch. 01/09/2027                            | 1 438                               | 1 413                            | 0,27                      | 3,500 % éch. 01/07/2047 - 01/12/2047                                                    | 23 586                              | 21 622                           | 4,13                      | Towd Point Mortgage Funding PLC                                         |                                     |                                  |                           |
| 2,959 % éch. 25/02/2027                            | 517                                 | 512                              | 0,10                      | 4,000 % éch. 01/10/2047                                                                 | 15                                  | 14                               | 0,00                      | 4,584 % éch. 20/04/2051                                                 | £ 1 266                             | 1 681                            | 0,32                      |
| 3,060 % éch. 01/11/2027                            | 2 500                               | 2 460                            | 0,47                      | 5,000 % éch. 01/02/2027 - 01/07/2054                                                    | 27 633                              | 27 270                           | 5,21                      | 5,147 % éch. 20/02/2054                                                 | 554                                 | 737                              | 0,14                      |
| 3,167 % éch. 25/06/2027                            | 761                                 | 753                              | 0,14                      | 6,000 % éch. 01/04/2035 - 01/04/2055                                                    | 3 678                               | 3 837                            | 0,73                      | VNDO Trust                                                              |                                     |                                  |                           |
| 3,913 % éch. 25/07/2037                            | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 6,500 % éch. 01/12/2035 - 01/01/2036                                                    | 4                                   | 5                                | 0,00                      | 4,033 % éch. 10/01/2035                                                 | \$ 650                              | 649                              | 0,12                      |
| 4,092 % éch. 25/12/2036 - 25/03/2044               | 802                                 | 797                              | 0,15                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA                          |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                           |                                     |                                  |                           |
| 4,152 % éch. 25/09/2035                            | 66                                  | 66                               | 0,01                      | 4,000 % éch. 01/07/2056                                                                 | 10 000                              | 9 348                            | 1,79                      | 4,443 % éch. 25/01/2045                                                 | 292                                 | 285                              | 0,06                      |
| 4,449 % éch. 25/01/2051                            | 469                                 | 471                              | 0,09                      | 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                 | 34 000                              | 33 413                           | 6,39                      | 5,144 % éch. 25/06/2042                                                 | 3                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,528 % éch. 25/03/2055                            | 727                                 | 730                              | 0,14                      | 5,500 % éch. 01/08/2056                                                                 | 12 400                              | 12 423                           | 2,37                      | Warwick Finance Residential Mortgages PLC                               |                                     |                                  |                           |
| 4,728 % éch. 25/07/2055                            | 1 286                               | 1 298                            | 0,25                      | 6,000 % éch. 01/08/2056 - 01/09/2056                                                    | 47 000                              | 47 866                           | 9,15                      | 4,698 % éch. 21/12/2049                                                 | £ 314                               | 419                              | 0,08                      |
| 4,788 % éch. 25/03/2055                            | 1 085                               | 1 097                            | 0,21                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     | 13 477                           | 2,57                      |
| 4,808 % éch. 25/08/2055                            | 685                                 | 689                              | 0,13                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)                              |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSES À DES ACTIFS                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,828 % éch. 25/12/2054 - 25/08/2055               | 7 833                               | 7 935                            | 1,52                      | 0,625 % éch. 15/07/2032                                                                 | 2 177                               | 2 017                            | 0,39                      | TITRES ADOSSES À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES                          |                                     |                                  |                           |
| 4,966 % éch. 01/06/2043                            | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 1,125 % éch. 15/01/2033                                                                 | 6 818                               | 6 451                            | 1,23                      | Chesapeake Funding DAC                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,967 % éch. 01/07/2042                            | 7                                   | 7                                | 0,00                      | Billets du Trésor américain                                                             |                                     |                                  |                           | 4,260 % éch. 15/12/2028                                                 | \$ 500                              | 499                              | 0,09                      |
| 5,017 % éch. 01/09/2041                            | 21                                  | 21                               | 0,00                      | 2,875 % éch. 15/05/2032                                                                 | 1 800                               | 1 671                            | 0,32                      | Golden Bar Securitisation SRL                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,128 % éch. 25/12/2054                            | 1 026                               | 1 040                            | 0,20                      | 3,375 % éch. 30/11/2027                                                                 | 42 300                              | 41 849                           | 8,00                      | 3,436 % éch. 22/09/2043                                                 | € 539                               | 620                              | 0,12                      |
| 5,511 % éch. 01/01/2035                            | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                 | 15                                  | 15                               | 0,00                      | Pulse UK PLC                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,675 % éch. 01/03/2035                            | 1                                   | 1                                | 0,00                      | TITRES ADOSSES À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 4,397 % éch. 27/05/2036                                                 | £ 1 181                             | 1 568                            | 0,30                      |
| 5,743 % éch. 01/01/2035                            | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Banc of America Mortgage Trust                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     | 2 687                            | 0,51                      |
| 5,840 % éch. 01/01/2035                            | 12                                  | 13                               | 0,00                      | 5,391 % éch. 25/08/2034                                                                 | 68                                  | 68                               | 0,01                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,907 % éch. 01/12/2034                            | 4                                   | 5                                | 0,00                      | 5,508 % éch. 25/07/2034                                                                 | 5                                   | 5                                | 0,00                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 5,980 % éch. 01/12/2034                            | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                             |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/11/2034                                                 | \$ 5                                | 7                                | 0,00                      |
| 6,212 % éch. 01/07/2035                            | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,498 % éch. 25/07/2034                                                                 | 77                                  | 72                               | 0,01                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| 6,224 % éch. 01/05/2038                            | 296                                 | 307                              | 0,06                      | 5,125 % éch. 25/01/2035                                                                 | 6                                   | 5                                | 0,00                      | 4,049 % éch. 25/01/2032                                                 | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 6,432 % éch. 01/08/2035                            | 55                                  | 56                               | 0,01                      | 5,698 % éch. 25/01/2034                                                                 | 5                                   | 5                                | 0,00                      |                                                                         |                                     | 11                               | 0,00                      |
| Freddie Mac                                        |                                     |                                  |                           | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                |                                     |                                  |                           | AUTRES TITRES ADOSSES À DES ACTIFS                                      |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 15/05/2037 (a)(c)                     | 21                                  | 19                               | 0,00                      | 4,083 % éch. 25/02/2034                                                                 | 23                                  | 22                               | 0,01                      | AlbaCore Euro CLO DAC                                                   |                                     |                                  |                           |
| 0,800 % éch. 28/10/2026                            | 7 000                               | 6 930                            | 1,32                      | 5,646 % éch. 25/12/2033                                                                 | 15                                  | 14                               | 0,00                      | 3,194 % éch. 15/07/2035                                                 | € 1 862                             | 2 134                            | 0,41                      |
| 1,250 % éch. 15/10/2027                            | 570                                 | 561                              | 0,11                      | Benchmark Mortgage Trust                                                                |                                     |                                  |                           | Ares European CLO DAC                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/01/2027                            | 4                                   | 3                                | 0,00                      | 3,965 % éch. 10/04/2051                                                                 | 326                                 | 324                              | 0,06                      | 3,088 % éch. 20/04/2032                                                 | 1 802                               | 2 061                            | 0,39                      |
| 4,027 % éch. 15/02/2037                            | 9                                   | 9                                | 0,00                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           | 3,234 % éch. 21/10/2034                                                 | 138                                 | 158                              | 0,03                      |
| 4,157 % éch. 15/09/2041                            | 3                                   | 3                                | 0,00                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           | Bain Capital Credit CLO Ltd.                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,549 % éch. 15/12/2050                            | 672                                 | 670                              | 0,13                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,814 % éch. 22/04/2035                                                 | \$ 1 800                            | 1 802                            | 0,34                      |
| 4,568 % éch. 25/11/2054                            | 1 769                               | 1 784                            | 0,34                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           | Benefit Street Partners CLO Ltd.                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,578 % éch. 25/03/2055                            | 854                                 | 863                              | 0,17                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/04/2035                                                 | 1 200                               | 1 201                            | 0,23                      |
| 4,598 % éch. 25/08/2054                            | 905                                 | 913                              | 0,18                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,608 % éch. 25/08/2055                            | 4 169                               | 4 187                            | 0,80                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,628 % éch. 25/02/2055                            | 1 498                               | 1 512                            | 0,29                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,642 % éch. 25/07/2056                            | 250                                 | 250                              | 0,05                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,650 % éch. 25/07/2056                            | 750                                 | 751                              | 0,14                      |                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Black Diamond CLO DAC<br>3,263 % éch. 15/05/2032                    | € 208                               | \$ 238                           | 0,04                      | Obligation internationale du gouvernement israélien<br>5,375 % éch. 19/02/2030 | \$ 900                              | \$ 913                           | 0,17                      | 4,300 % éch. 18/08/2026<br>4,330 % éch. 27/07/2026                                    | \$ 1 750                            | \$ 1 739                         | 0,33                      |
| BNPP AM Euro CLO DAC<br>3,014 % éch. 22/07/2032                     | 2 670                               | 3 052                            | 0,58                      | Korea Housing Finance Corp.<br>4,875 % éch. 27/08/2027                         | 400                                 | 403                              | 0,08                      | Jabil, Inc.<br>4,150 % éch. 06/07/2026                                                | 400                                 | 400                              | 0,07                      |
| Bridgepoint CLO DAC<br>3,414 % éch. 15/01/2034                      | 1 993                               | 2 281                            | 0,44                      | Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,136 % éch. 09/10/2030 | 1 500                               | 1 473                            | 0,28                      | 4,150 % éch. 18/08/2026                                                               | 750                                 | 746                              | 0,14                      |
| Carlyle Euro CLO DAC<br>3,493 % éch. 15/08/2038                     | 1 500                               | 1 718                            | 0,33                      | Obligation internationale du gouvernement polonais<br>4,625 % éch. 18/03/2029  | 2 400                               | 2 418                            | 0,46                      | Keurig Dr Pepper, Inc.<br>4,400 % éch. 15/07/2026                                     | 500                                 | 499                              | 0,09                      |
| Castlake Aircraft Structured Trust<br>5,465 % éch. 15/08/2050       | \$ 468                              | 465                              | 0,09                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>5,125 % éch. 13/01/2028  | 2 300                               | 2 316                            | 0,44                      | McCormick & Co. Inc.<br>4,000 % éch. 02/07/2026                                       | 250                                 | 250                              | 0,05                      |
| Contego CLO BV<br>3,454 % éch. 15/04/2038                           | € 1 800                             | 2 060                            | 0,39                      |                                                                                |                                     | 10 294                           | 1,97                      | Rogers Communications<br>4,260 % éch. 30/07/2026                                      | 250                                 | 249                              | 0,05                      |
| Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.<br>4,825 % éch. 20/10/2034 | \$ 500                              | 501                              | 0,10                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                               |                                     |                                  |                           |                                                                                       | 10 860                              | 2,07                             |                           |
| Hayfin Emerald CLO DAC<br>3,404 % éch. 22/01/2039                   | € 2 000                             | 2 290                            | 0,44                      | <b>BILLETS DE TRÉSORERIE</b>                                                   |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
| Indigo Credit Management DAC<br>3,404 % éch. 15/07/2038             | 2 000                               | 2 290                            | 0,44                      | Clorox Co.<br>4,090 % éch. 07/07/2026                                          | 250                                 | 250                              | 0,05                      | 3,671 % éch. 27/08/2026 (c)(d)(i)                                                     | 23 300                              | 23 165                           | 4,43                      |
| Jubilee CLO DAC<br>3,034 % éch. 15/07/2034                          | 1 879                               | 2 150                            | 0,41                      | 4,100 % éch. 13/07/2026                                                        | 250                                 | 250                              | 0,05                      | Total des Instruments à court terme                                                   |                                     | 34 025                           | 6,50                      |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,054 % éch. 15/10/2034  | 1 225                               | 1 400                            | 0,27                      | Constellation Energy Corp.<br>4,100 % éch. 01/07/2026                          | 250                                 | 250                              | 0,05                      | Total des Valeurs mobilières                                                          | \$540 653                           | 103,32                           |                           |
| 3,283 % éch. 15/05/2034                                             | 631                                 | 722                              | 0,14                      | 4,100 % éch. 03/08/2026                                                        | 250                                 | 249                              | 0,05                      | <b>ACTIONS</b>                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 3,433 % éch. 15/02/2035                                             | 1 173                               | 1 342                            | 0,26                      | 4,110 % éch. 04/08/2026                                                        | 250                                 | 249                              | 0,05                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                         |                                     |                                  |                           |
| Providus CLO DAC<br>3,513 % éch. 15/11/2039                         | 1 900                               | 2 175                            | 0,42                      | 4,150 % éch. 02/07/2026                                                        | 250                                 | 250                              | 0,05                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                              |                                     |                                  |                           |
| Takehau CLO DAC<br>3,404 % éch. 15/10/2038                          | 2 300                               | 2 634                            | 0,50                      | eBay, Inc.<br>4,060 % éch. 24/08/2026                                          | 250                                 | 248                              | 0,04                      | PIMCO Funds: Global Investors<br>Series plc - Fonds US Short-Term Fund (f)            | 2 916 830                           | 29 956                           | 5,73                      |
| 3,458 % éch. 20/01/2037                                             | 2 100                               | 2 405                            | 0,46                      | Entergy Corp.<br>4,070 % éch. 19/08/2026                                       | 250                                 | 249                              | 0,05                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds<br>PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (f) | 1 678                               | 17                               | 0,00                      |
| Toro European CLO DAC<br>3,070 % éch. 12/01/2032                    | 1 292                               | 1 479                            | 0,28                      | 4,070 % éch. 20/08/2026                                                        | 250                                 | 248                              | 0,04                      |                                                                                       | 29 973                              | 5,73                             |                           |
| 3,093 % éch. 15/02/2034                                             | 2 328                               | 2 663                            | 0,51                      | 4,100 % éch. 08/07/2026                                                        | 250                                 | 250                              | 0,05                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     | 39 221                           | 7,50                      | Equifax Inc.<br>4,140 % éch. 30/07/2026                                        | 250                                 | 249                              | 0,05                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO<br>US Dollar Short Maturity UCITS<br>ETF (f)             | 275 860                             | 27 718                           | 5,30                      |
|                                                                     |                                     | 41 919                           | 8,01                      | Glencore Funding LLC<br>4,040 % éch. 04/08/2026                                | 250                                 | 249                              | 0,05                      | Total des Fonds d'investissement                                                      | \$ 57 691                           | 11,03                            |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,050 % éch. 10/08/2026                                                        | 700                                 | 697                              | 0,13                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,050 % éch. 11/08/2026                                                        | 500                                 | 498                              | 0,09                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | Haleon UK Capital PLC<br>4,100 % éch. 10/07/2026                               | 250                                 | 250                              | 0,05                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | HCA, Inc.<br>4,220 % éch. 17/07/2026                                           | 1 300                               | 1 297                            | 0,25                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,270 % éch. 07/08/2026                                                        | 250                                 | 249                              | 0,05                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,270 % éch. 11/08/2026                                                        | 250                                 | 249                              | 0,05                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,270 % éch. 20/08/2026                                                        | 250                                 | 248                              | 0,05                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |

### ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                                                              |          |       |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-------|------|
| Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>5,875 % éch. 30/04/2029                                     | \$ 2 000 | 2 066 | 0,40 |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi<br>4,875 % éch. 30/04/2029 | 700      | 705   | 0,14 |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                 | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-------------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                   | 3,690 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 21 800            | Obligations du Trésor américain 3,000 % échéance 15/08/2048 | \$ (22 073)      | \$ 21 800                                | \$ 21 802                                                          | 4,17                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                             | \$ (22 073)      | \$ 21 800                                | \$ 21 802                                                          | 4,17                |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                     | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                     | Long  | 12/2026           | 103                | \$ (23)                           | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                           | Court | 09/2026           | 25                 | (15)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre       | Long  | 09/2026           | 3                  | 4                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre  | Long  | 09/2026           | 471                | (150)                             | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre  | Long  | 09/2026           | 998                | 171                               | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 669                | (719)                             | (0,14)              |
|                                                                                 |       |                   |                    | \$ (732)                          | (0,14)              |

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime   | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|---------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | \$ 108,000         | 24/07/2026           | 2                     | \$ (1)  | \$ 0            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,500            | 24/07/2026           | 8                     | (2)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 109,500            | 24/07/2026           | 4                     | (1)     | (2)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026     | 111,000            | 24/07/2026           | 14                    | (3)     | (2)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,000            | 26/06/2026           | 0                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,500            | 26/06/2026           | 0                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000            | 26/06/2026           | 0                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750            | 26/06/2026           | 0                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 26/06/2026           | 0                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,500            | 26/06/2026           | 0                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,250            | 02/07/2026           | 3                     | (1)     | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 02/07/2026           | 9                     | (2)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 02/07/2026           | 3                     | (1)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500            | 02/07/2026           | 9                     | (2)     | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000            | 10/07/2026           | 3                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750            | 10/07/2026           | 3                     | 0       | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 17/07/2026           | 5                     | (1)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250            | 17/07/2026           | 5                     | (1)     | (1)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 17/07/2026           | 5                     | (1)     | (1)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 17/07/2026           | 5                     | (1)     | 0               | 0,00                   |
|                                                                                                           |                    |                      |                       | \$ (17) | \$ (8)          | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                                |                    |                      |                       |         | \$ (740)        | (0,14)                 |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/06/2031      | \$ 200                           | \$ 1                              | 0,00                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 6 590           | \$ (100)                          | (0,02)              |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,930     | 06/01/2035      | 100               | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/03/2028      | ¥ 4 180 000       | (2)                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 17/06/2028      | \$ 120 600        | (979)                             | (0,19)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,231     | 18/09/2034      | 100               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,232     | 10/09/2034      | 100               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,240     | 16/09/2034      | 200               | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2035      | 7 100             | 250                               | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,278     | 16/09/2034      | 300               | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,280     | 16/09/2034      | 300               | 17                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,408     | 05/09/2034      | 100               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,410     | 05/09/2034      | 300               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,514     | 04/09/2034      | 300               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,558     | 21/08/2034      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,605     | 28/08/2034      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,623     | 31/10/2030      | 1 800             | 22                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,664     | 31/10/2030      | 1 200             | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,677     | 31/10/2030      | 1 000             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,679     | 13/08/2034      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,689     | 31/10/2030      | 2 840             | 27                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/10/2030      | 2 000             | 18                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,722     | 31/10/2030      | 3 900             | 31                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,735     | 31/10/2030      | 2 600             | 19                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,739     | 31/10/2030      | 1 400             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 03/03/2036      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 8 400             | 28                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      | 400               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,807     | 31/05/2028      | 1 300             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,842     | 04/03/2030      | 1 100             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,870     | 05/03/2035      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,874     | 05/03/2035      | 600               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,884     | 25/03/2035      | 400               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,899     | 11/03/2035      | 400               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 12/03/2035      | 400               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,908     | 04/03/2035      | 600               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 24/03/2035      | 600               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 22/05/2036      | 500               | (1)                               | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,975 %   | 21/03/2035      | \$ 600            | \$ 2                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 26/02/2035      | 250               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,002     | 28/05/2036      | 600               | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,300     | 17/05/2028      | 342 400           | (401)                             | (0,08)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 18/06/2035      | AUD 9 600         | (134)                             | (0,02)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,300     | 25/09/2029      | € 100             | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,350     | 29/04/2030      | 300               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,400     | 09/04/2030      | 300               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,400     | 12/02/2035      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,450     | 05/05/2035      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,550     | 16/04/2035      | 80                | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,590     | 19/08/2034      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,650     | 14/08/2029      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,700     | 13/08/2029      | 400               | (7)                               | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ (1 032)                        | (0,20)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ (1 031)                        | (0,20)              |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                               | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| DUB          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757 %         | 18/09/2026        | 27 100                           | \$ 22 | \$ 102       | 0,02                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757           | 18/09/2026        | 42 600                           | 33    | 159          | 0,03                |
|              |                                                           |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 55 | \$ 261       | 0,05                |

#### OPTIONS VENDUES

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004 %         | 08/07/2026        | 800                              | \$ (2) | \$ (2)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 800                              | (2)    | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (4) | \$ (2)       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie |                                                        | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                     | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 2 000                         | \$ (94)                | \$ 102                           | \$ 8         | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                     | 1,000                | 20/12/2026      | 5 600                            | (270)                  | 293                              | 23           | 0,01                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement colombien    |                     | 1,000                | 20/06/2027      | 1 900                            | (108)                  | 117                              | 9            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    |                     | 1,000                | 20/12/2027      | 2 300                            | (205)                  | 218                              | 13           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                     | 1,000                | 20/12/2026      | 4 200                            | (195)                  | 212                              | 17           | 0,00                |
|              |                                                        |                     |                      |                 |                                  | \$ (872)               | \$ 942                           | \$ 70        | 0,01                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.



## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 305         | \$ 218            | \$ 7               | \$ 0                  | \$ 7                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 203         | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 1 817       | 1 073             | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 52           | CAD 74            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 921             | NZD 1 631         | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 74          | \$ 52             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | NZD 1 631       | 922               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 19 626      | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 192          | CNH 1 298         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 180             | ¥ 28 570          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 85              | NOK 783           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 233         | \$ 78             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 09/2026           | \$ 24           | INR 2 242         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 478         | \$ 92             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 157         | 200               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 1 361       | 201               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 20 961 404  | 1 170             | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 600         | 204               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 40 339      | 420               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 96 170      | 63                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 5 116       | 156               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 553          | AUD 775           | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16              | BRL 80            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 587             | £ 438             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 133           | INR 107 479       | 3                  | (2)                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 607             | ¥ 96 570          | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 272             | KRW 416 536       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 62              | ZAR 1 019         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 73          | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 151          | BRL 769           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 1 924 574   | \$ 106            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 003       | 154               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 659          | IDR 11 655 189    | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 98              | INR 9 281         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 30              | THB 980           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 57              | IDR 1 042 249     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ILS 738         | \$ 249            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 2 639       | 1 561             | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 310          | ZAR 5 031         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 2 054       | \$ 407            | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 669         | 230               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 27 211      | 288               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 62          | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 236          | IDR 4 229 904     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 281             | INR 27 211        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 30              | KRW 44 805        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 324             | SEK 2 993         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 869         | \$ 301            | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 6 757 832   | 374               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 2 897       | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 959       | 180               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 134          | IDR 2 384 406     | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | 139             | 2 520 307         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | IDR 539 734     | \$ 30             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 11 167      | 118               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 63          | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 79           | INR 7 612         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 209             | NOK 1 944         | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 145             | ZAR 2 339         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 5 473 600   | \$ 304            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 82              | IDR 1 490 221     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 118             | INR 11 243        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CNH 1 354       | \$ 200            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 6 079         | 8 175             | 106                | 0                     | 106                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | INR 11 116      | 118               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 703 878       | 4 350             | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 178         | 48                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 1 782       | 184               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 4 981       | 3 904             | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 573          | CNH 3 895         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 116             | INR 11 116        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 75              | ¥ 11 879          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 358             | PLN 1 305         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 202             | ZAR 3 333         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 3 886       | \$ 573            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 441         | 154               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4 350        | ¥ 702 036         | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 184             | SEK 1 778         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 57              | INR 5 454         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | BRL 6           | \$ 1              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 97 302      | \$ 63             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 423          | BRL 2 135         | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 038           | CAD 7 169         | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 222             | IDR 3 977 161     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 63              | KRW 97 289        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 7 159       | \$ 5 038          | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2 777        | BRL 14 175        | 0                  | (60)                  | (60)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 77              | INR 7 431         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 4 000 452   | \$ 222            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 16 010      | 496               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 327          | BRL 1 683         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 383             | IDR 6 872 411     | 1                  | (3)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 315             | INR 30 278        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 1 319       | \$ 940            | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS 1 888       | 632               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 2 488       | 26                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 30 068      | 19                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 2 044       | 207               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 35           | IDR 621 774       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 26              | INR 2 488         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19              | KRW 30 064        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 932             | PLN 3 397         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 113             | THB 3 782         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 500       | \$ 516            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 207          | NOK 2 045         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 625 229     | \$ 35             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 348         | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 12 084      | 371               | 6                  | (1)                   | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | TWD 797         | 25                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 177          | INR 16 840        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 3 353           | MXN 58 257        | 0                  | (41)                  | (41)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | MXN 229         | \$ 13             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 5           | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 1 245       | 1 580             | 38                 | (1)                   | 37                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 20            | 23                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 54 507      | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 11 211      | 119               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 24 600        | 154               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 337 804     | 223               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 659         | 66                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 1 088       | 112               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 325          | AUD 471           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 625             | £ 472             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 183             | INR 17 644        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 317           | ¥ 209 395         | 0                  | (29)                  | (29)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | AUD 471         | \$ 325            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 66           | NOK 660           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 112             | SEK 1 086         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 3 290       | \$ 99             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 496          | INR 47 468        | 3                  | (1)                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 10            | \$ 12             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$ 283          | € 248             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 119             | £ 89              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 265             | ILS 758           | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 206             | IDR 3 681 335     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 185             | INR 17 807        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 3 701 980   | \$ 206            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 82           | IDR 1 455 732     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 80              | 1 442 168         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 244             | INR 23 350        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 193             | 18 457            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 4 304 441   | \$ 238            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 707       | 177               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| SOG          | 09/2026           | \$ 209          | IDR 3 744 150     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 2 275       | \$ 336            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 38 599        | 45 028            | 898                | 0                     | 898                                     | 0,17                |
|              | 07/2026           | \$ 264          | AUD 383           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 733           | CHF 1 402         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 43 625          | € 38 351          | 223                | 0                     | 223                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | 2 405           | ¥ 382 151         | 0                  | (55)                  | (55)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 3 852           | SGD 4 988         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 383         | \$ 264            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 1 397       | 1 733             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | € 38 351        | 43 684            | 0                  | (223)                 | (223)                                   | (0,04)              |
|              | 08/2026           | SGD 4 977       | 3 852             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 7 369       | \$ 5 344          | 151                | 0                     | 151                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$ 46           | CAD 66            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 833           | £ 5 169           | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 65          | \$ 46             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | £ 5 169         | 6 833             | 0                  | (28)                  | (28)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | PLN 63          | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 697         | 21                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 817           | \$ (681)              | \$ 1 136                                | 0,22                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 6            | € 5               | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 28            | \$ 32             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 7 328        | € 6 290           | 0                  | (137)                 | (137)                                   | (0,03)              |
| CBK          | 07/2026           | € 16            | \$ 19             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23           | € 20              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 5 982         | \$ 6 822          | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 6 831        | € 5 982           | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | € 6 336         | \$ 7 197          | 0                  | (47)                  | (47)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 93           | € 81              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 7 144           | 6 282             | 47                 | 0                     | 47                                      | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | 6 922           | 5 949             | 0                  | (120)                 | (120)                                   | (0,02)              |
| SOG          | 07/2026           | € 6 282         | \$ 7 145          | 0                  | (36)                  | (36)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 7 338        | € 6 290           | 0                  | (146)                 | (146)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | 7 155           | 6 282             | 36                 | 0                     | 36                                      | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | 9               | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 8             | \$ 9              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 100             | \$ (504)              | \$ (404)                                | (0,08)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$ 7 095        | £ 5 285           | \$ 0               | \$ (81)               | \$ (81)                                 | (0,02)              |
| BPS                                                | 07/2026           | £ 4 132         | \$ 5 450          | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 7 805        | £ 5 825           | 0                  | (74)                  | (74)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | £ 131           | \$ 173            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 4 975        | £ 3 773           | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,01                |
| CBK                                                | 07/2026           | £ 39            | \$ 52             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | 40              | 53                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 1            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           | \$ 7 683        | £ 5 726           | 0                  | (84)                  | (84)                                    | (0,02)              |
| MBC                                                | 07/2026           | £ 3 008         | \$ 4 030          | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 26           | £ 19              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI                                                | 07/2026           | 121             | 90                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £ 1 057         | \$ 1 391          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 1 391        | £ 1 057           | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | £ 4 496         | \$ 5 951          | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 5 951        | £ 4 496           | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | £ 4 470         | \$ 5 904          | 0                  | (28)                  | (28)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 1            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 5 904        | £ 4 470           | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,01                |
| SSB                                                | 07/2026           | 390             | 295               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 295           | \$ 390            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 129             | \$ (334)              | \$ (205)                                | (0,04)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 856                                  | 0,16                |

## TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 3,000 % échéance 01/08/2056                                    | \$ 17 700                     | \$ (15 427)                | (2,95)              |
| 3,500 % échéance 01/08/2056                                    | 31 000                        | (28 107)                   | (5,37)              |
| 6,000 % échéance 01/08/2056 (g)                                | 47 000                        | (47 897)                   | (9,15)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | \$ (91 431)                | (17,47)             |
| Total des Investissements                                      |                               | \$ 527 798                 | 100,87              |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | \$ (4 543)                 | (0,87)              |
| Actif net                                                      |                               | \$ 523 255                 | 100,00              |

## Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre à principal uniquement.

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| JPMorgan Chase & Co.      | 1,896 % | 05/03/2028      | 07/04/2026   | \$ 782 | \$ 770       | 0,15                |

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 151 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 330 \$ (31 décembre 2025 : 720 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 66 160 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2025 : 5 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de transactions à terme au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 6 531 \$ (31 décembre 2025 : 7 107 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 534 645                                           | \$ 6 008                                          | \$ 540 653        |
| Fonds d'investissement                        | 57 691                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 57 691            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 21 800                                               | 0                                                 | 21 800            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (33)                                                                              | (882)                                                | 0                                                 | (915)             |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (91 431)                                             | 0                                                 | (91 431)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 57 658</b>                                                                  | <b>\$ 464 132</b>                                    | <b>\$ 6 008</b>                                   | <b>\$ 527 798</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 663 184                                           | \$ 5 802                                          | \$ 668 986        |
| Fonds d'investissement                        | 57 001                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 57 001            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 19                                                                                | (389)                                                | 0                                                 | (370)             |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (49 161)                                             | 0                                                 | (49 161)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 57 020</b>                                                                  | <b>\$ 613 634</b>                                    | <b>\$ 5 802</b>                                   | <b>\$ 676 456</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (34)                                                    | \$ 0                    | \$ (34)                           | \$ 186                                                     | \$ 0                    | \$ 186                            |
| BOA          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | 14                                                         | 0                       | 14                                |
| BPS          | (262)                                                      | 330                     | 68                                | (8)                                                        | 0                       | (8)                               |
| BRC          | 58                                                         | 0                       | 58                                | 299                                                        | (280)                   | 19                                |
| CBK          | 39                                                         | 0                       | 39                                | 43                                                         | (40)                    | 3                                 |
| DUB          | 89                                                         | 0                       | 89                                | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| FAR          | 158                                                        | 0                       | 158                               | (173)                                                      | 0                       | (173)                             |
| GLM          | (66)                                                       | 0                       | (66)                              | 5                                                          | 0                       | 5                                 |
| GST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| JPM          | \$ (109)                                                   | \$ 0                    | \$ (109)                          | \$ 3                                                       | \$ 0                    | \$ 3                              |
| MBC          | 58                                                         | 0                       | 58                                | 77                                                         | 0                       | 77                                |
| MYC          | 198                                                        | 0                       | 198                               | 45                                                         | 0                       | 45                                |
| MYI          | (10)                                                       | 0                       | (10)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| NSL          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| SCX          | (112)                                                      | 151                     | 39                                | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |
| SOG          | 698                                                        | (880)                   | (182)                             | (642)                                                      | 720                     | 78                                |
| SSB          | 151                                                        | 0                       | 151                               | 34                                                         | 0                       | 34                                |
| UAG          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 13                                                         | 0                       | 13                                |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 18,82            | 27,13                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 41,45            | 33,95                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,77             | 0,46                 |
| Fonds d'investissement                                           | 6,51             | 5,24                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 2,46             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,02             | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,07             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,27             | 0,11                 |
| Autres actifs                                                    | 29,63            | 33,02                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                                            | 23,93            | 21,68                |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 50,40            | 47,34                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 9,94             | 32,47                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 2,57             | 2,06                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 8,01             | 9,37                 |
| Émissions souveraines                                                                                    | 1,97             | 1,69                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 6,50             | 1,49                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 11,03            | 9,89                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 4,17             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | (0,14)           | 0,07                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,20)           | (0,12)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,05             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01             | 0,01                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,22             | (0,20)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,12)           | 0,16                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (17,47)          | (8,53)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (0,87)           | (17,39)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |



# Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

| DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |          |      |
|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                 |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 03/04/2028                              | CAD                                 | 1 500                            | \$ 1 071                  | 0,16        | Lendlease Finance Ltd.              | AUD                              | 1 600                     | \$ 1 077 | 0,16 |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS    |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 20/09/2027                              |                                     | 500                              | 362                       | 0,05        | 3,400 % éch. 27/10/2027             |                                  |                           |          |      |
| Belden, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Cie de Financement Foncier S.A.                      | €                                   | 200                              | 232                       | 0,03        | Lloyds Banking Group PLC            | \$                               | 595                       | 596      | 0,09 |
| TBD % éch. 10/06/2033              | \$                                  | 200                              | \$ 200                    | 3,375 % éch. 16/09/2031                              |                                     |                                  |                           |             | 5,985 % éch. 07/08/2027             |                                  |                           |          |      |
| Discovery Global Holdings, Inc.    |                                     |                                  |                           | Commerzbank AG                                       |                                     |                                  |                           |             | Lseg Netherlands BV                 |                                  |                           |          |      |
| TBD % éch. 03/06/2033              | €                                   | 400                              | 459                       | 6,500 % éch. 06/12/2032                              |                                     | 3 200                            | 3 793                     | 0,55        | 4,125 % éch. 29/09/2026             | €                                | 2 400                     | 2 751    | 0,40 |
| TBD % éch. 03/06/2033              | \$                                  | 1 471                            | 1 473                     | Consumers Securitization Funding LLC                 |                                     |                                  |                           |             | Mercury General Corp.               |                                  |                           |          |      |
| Jane Street Group LLC              |                                     |                                  |                           | 5,550 % éch. 01/03/2028                              | \$                                  | 203                              | 204                       | 0,03        | 4,400 % éch. 15/03/2027             | \$                               | 223                       | 223      | 0,03 |
| 5,666 % éch. 15/12/2031            |                                     | 3 278                            | 3 252                     | Corebridge Financial, Inc.                           |                                     |                                  |                           |             | Metropolitan Life Global Funding    |                                  |                           |          |      |
| Project Dorchester                 |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 05/04/2027                              |                                     | 1 500                            | 1 491                     | 0,22        | 4,000 % éch. 27/05/2033             | €                                | 500                       | 585      | 0,09 |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (f)        | €                                   | 500                              | 572                       | CoStar Group, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |             | Mitsubishi HC Capital UK PLC        |                                  | 1 800                     | 2 067    | 0,30 |
| QXO, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 2,800 % éch. 15/07/2030                              |                                     | 600                              | 540                       | 0,08        | 3,733 % éch. 02/02/2027             |                                  |                           |          |      |
| TBD % éch. 03/06/2033              | \$                                  | 100                              | 100                       | CPI Property Group S.A.                              |                                     |                                  |                           |             | Moere Boligkredit A/S               |                                  |                           |          |      |
| République du Panama               |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 14/01/2030                              | €                                   | 1 656                            | 1 661                     | 0,24        | 2,625 % éch. 25/09/2029             |                                  | 500                       | 567      | 0,08 |
| 3,886 % éch. 05/03/2027            | €                                   | 1 300                            | 1 489                     | 4,750 % éch. 22/07/2030                              |                                     | 1 100                            | 1 201                     | 0,17        | Morgan Stanley                      |                                  |                           |          |      |
| TransDigm, Inc.                    |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole S.A.                                 |                                     |                                  |                           |             | 3,485 % éch. 11/06/2030             |                                  | 4 100                     | 4 714    | 0,68 |
| 6,144 % éch. 28/02/2031            | \$                                  | 199                              | 200                       | 5,186 % éch. 01/08/2032                              | \$                                  | 4 400                            | 4 422                     | 0,64        | 3,622 % éch. 01/04/2031             | \$                               | 2 100                     | 2 011    | 0,29 |
| 6,144 % éch. 19/01/2032            |                                     | 1 890                            | 1 893                     | Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.                     |                                     |                                  |                           |             | Morgan Stanley Bank N.A.            |                                  |                           |          |      |
| Virgin Media Bristol LLC           |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 06/06/2030                              | €                                   | 5 600                            | 6 327                     | 0,92        | 4,788 % éch. 10/05/2030             |                                  | 600                       | 601      | 0,09 |
| 6,967 % éch. 31/03/2031            |                                     | 200                              | 178                       | Deutsche Bank AG                                     |                                     |                                  |                           |             | Morgan Stanley Finance LLC          |                                  |                           |          |      |
| 6,990 % éch. 31/01/2029            |                                     | 300                              | 288                       | 7,146 % éch. 13/07/2027                              | \$                                  | 1 800                            | 1 801                     | 0,26        | 6,550 % éch. 05/01/2029             | £                                | 1 100                     | 1 452    | 0,21 |
|                                    |                                     |                                  | 10 104                    | Deutsche Boerse AG                                   |                                     |                                  |                           |             | Morgan Stanley Private Bank N.A.    |                                  |                           |          |      |
|                                    |                                     |                                  | 1,47                      | 3,875 % éch. 28/09/2026                              | €                                   | 1 800                            | 2 063                     | 0,30        | 4,466 % éch. 06/07/2028             | \$                               | 3 000                     | 2 997    | 0,44 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS      |                                     |                                  |                           | DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH |                                     | 800                              | 910                       | 0,13        | Muthoot Finance Ltd.                |                                  |                           |          |      |
| BANQUE ET FINANCE                  |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 25/01/2027                              |                                     |                                  |                           |             | 5,750 % éch. 04/08/2030             |                                  | 2 400                     | 2 352    | 0,34 |
| AerCap Ireland Capital DAC         |                                     |                                  |                           | EPR Properties                                       |                                     |                                  |                           |             | Nationale-Nederlanden Bank NV       |                                  |                           |          |      |
| 2,450 % éch. 29/10/2026            |                                     | 3 300                            | 3 280                     | 4,500 % éch. 01/06/2027                              | \$                                  | 1 600                            | 1 597                     | 0,23        | 0,010 % éch. 08/07/2030             | €                                | 6 400                     | 6 517    | 0,95 |
| Aircastle Ltd.                     |                                     |                                  |                           | Equitable America Global Funding                     |                                     |                                  |                           |             | Nationwide Building Society         |                                  |                           |          |      |
| 5,000 % éch. 15/05/2031            |                                     | 1 600                            | 1 586                     | 4,950 % éch. 25/06/2029                              |                                     | 400                              | 400                       | 0,06        | 4,000 % éch. 03/09/2027             | £                                | 900                       | 1 194    | 0,17 |
| AMCO - Asset Management Co. SpA    |                                     |                                  |                           | F&G Global Funding                                   |                                     |                                  |                           |             | 4,346 % éch. 22/09/2028             |                                  | 1 100                     | 1 467    | 0,21 |
| 4,625 % éch. 06/02/2027            | €                                   | 1 400                            | 1 617                     | 4,963 % éch. 08/09/2028                              |                                     | 1 300                            | 1 306                     | 0,19        | NatWest Group PLC                   |                                  |                           |          |      |
| American Tower Corp.               |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 16/01/2030                              |                                     | 1 000                            | 1 012                     | 0,15        | 4,983 % éch. 18/06/2032             | \$                               | 2 350                     | 2 349    | 0,34 |
| 1,450 % éch. 15/09/2026            | \$                                  | 2 800                            | 2 784                     | Fab Sukuk Co. Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |             | New Immo Holding S.A.               |                                  |                           |          |      |
| Antares Holdings LP                |                                     |                                  |                           | 4,859 % éch. 13/05/2031                              |                                     | 4 300                            | 4 290                     | 0,62        | 4,950 % éch. 14/11/2030             | €                                | 1 200                     | 1 370    | 0,20 |
| 6,500 % éch. 08/02/2029            |                                     | 1 800                            | 1 804                     | Fastighets AB Balder                                 |                                     |                                  |                           |             | 5,500 % éch. 23/04/2031             |                                  | 200                       | 230      | 0,03 |
| 7,950 % éch. 11/08/2028            |                                     | 250                              | 258                       | 1,125 % éch. 29/01/2027                              | €                                   | 1 500                            | 1 697                     | 0,25        | Newmark Group, Inc.                 |                                  |                           |          |      |
| Ares Strategic Income Fund         |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                            |                                     |                                  |                           |             | 7,500 % éch. 12/01/2029             | \$                               | 300                       | 314      | 0,05 |
| 4,850 % éch. 15/01/2029            |                                     | 1 300                            | 1 274                     | 3,530 % éch. 24/12/2029                              |                                     | 3 300                            | 3 790                     | 0,55        | NIBC Bank NV                        |                                  |                           |          |      |
| Athene Global Funding              |                                     |                                  |                           | Ford Credit Canada Co.                               |                                     |                                  |                           |             | 0,125 % éch. 21/04/2031             | €                                | 1 600                     | 1 592    | 0,23 |
| 2,500 % éch. 24/03/2028            |                                     | 2 053                            | 1 968                     | 4,398 % éch. 09/04/2029 (f)                          | CAD                                 | 100                              | 71                        | 0,01        | Nomura Holdings, Inc.               |                                  |                           |          |      |
| 4,860 % éch. 27/08/2026            |                                     | 1 400                            | 1 401                     | Ford Motor Credit Co. LLC                            |                                     |                                  |                           |             | 4,217 % éch. 08/04/2033             |                                  | 1 000                     | 1 167    | 0,17 |
| 5,516 % éch. 25/03/2027            |                                     | 2 000                            | 2 012                     | 2,700 % éch. 10/08/2026                              | \$                                  | 600                              | 599                       | 0,09        | 4,886 % éch. 02/07/2027             | \$                               | 400                       | 403      | 0,06 |
| Banco Santander S.A.               |                                     |                                  |                           | 4,271 % éch. 09/01/2027                              |                                     | 500                              | 499                       | 0,07        | Norinchukin Bank                    |                                  |                           |          |      |
| 5,796 % éch. 23/01/2029            | AUD                                 | 1 100                            | 772                       | 5,850 % éch. 17/05/2027                              |                                     | 1 600                            | 1 612                     | 0,23        | 5,094 % éch. 16/10/2029             |                                  | 700                       | 705      | 0,10 |
| 7,250 % éch. 03/12/2035 (c)(e)     | \$                                  | 1 600                            | 1 627                     | FS KKR Capital Corp.                                 |                                     |                                  |                           |             | Nykredit Realkredit A/S             |                                  |                           |          |      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.          |                                     |                                  |                           | 2,625 % éch. 15/01/2027                              |                                     | 400                              | 393                       | 0,06        | 1,375 % éch. 12/07/2027             | €                                | 0                         | 0        | 0,00 |
| 5,343 % éch. 29/06/2029            |                                     | 200                              | 201                       | 6,125 % éch. 15/01/2030                              |                                     | 900                              | 877                       | 0,13        | Pacific Life Global Funding         |                                  |                           |          |      |
| Bank of America Corp.              |                                     |                                  |                           | GA Global Funding Trust                              |                                     |                                  |                           |             | 5,692 % éch. 22/04/2031             | AUD                              | 4 300                     | 3 024    | 0,44 |
| 3,824 % éch. 20/01/2028            |                                     | 500                              | 498                       | 4,500 % éch. 18/09/2030                              |                                     | 1 400                            | 1 357                     | 0,20        | PKO Bank Hipoteczny S.A.            |                                  |                           |          |      |
| Bank of Queensland Ltd.            |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 13/01/2030                              |                                     | 3 600                            | 3 614                     | 0,52        | 2,500 % éch. 12/06/2029             | €                                | 5 600                     | 6 321    | 0,92 |
| 3,300 % éch. 30/07/2029            | €                                   | 2 500                            | 2 881                     | Gaci First Investment Co.                            |                                     |                                  |                           |             | QNB Finance Ltd.                    |                                  |                           |          |      |
| Barclays Bank PLC                  |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 14/02/2030                              |                                     | 1 200                            | 1 192                     | 0,17        | 4,538 % éch. 19/09/2027             | \$                               | 7 400                     | 7 398    | 1,06 |
| 2,787 % éch. 17/06/2028            |                                     | 1 800                            | 2 059                     | 4,875 % éch. 14/05/2029                              |                                     | 600                              | 598                       | 0,09        | 4,679 % éch. 27/04/2029             |                                  | 700                       | 704      | 0,10 |
| 3,320 % éch. 17/06/2029            |                                     | 1 800                            | 2 068                     | General Motors Financial Co., Inc.                   |                                     |                                  |                           |             | RBC International                   |                                  |                           |          |      |
| Barclays PLC                       |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 15/08/2026                              | £                                   | 800                              | 1 063                     | 0,15        | 4,660 % éch. 16/12/2028 (f)         |                                  | 5 000                     | 4 918    | 0,71 |
| 5,518 % éch. 13/09/2027            | \$                                  | 6 500                            | 6 519                     | Goldman Sachs Bank USA                               |                                     |                                  |                           |             | Rocket Cos., Inc.                   |                                  |                           |          |      |
| BNP Paribas S.A.                   |                                     |                                  |                           | 4,656 % éch. 03/06/2029                              | \$                                  | 2 200                            | 2 202                     | 0,32        | 6,125 % éch. 01/08/2031             |                                  | 100                       | 102      | 0,02 |
| 4,892 % éch. 30/06/2030            |                                     | 500                              | 500                       | Goldman Sachs Group, Inc.                            |                                     |                                  |                           |             | 6,500 % éch. 15/06/2034             |                                  | 100                       | 103      | 0,02 |
| BPCE S.A.                          |                                     |                                  |                           | 1,948 % éch. 21/10/2027                              |                                     | 2 300                            | 2 282                     | 0,33        | Sagax AB                            |                                  |                           |          |      |
| 5,184 % éch. 02/06/2032            |                                     | 500                              | 499                       | 4,972 % éch. 03/06/2032                              |                                     | 2 500                            | 2 499                     | 0,36        | 3,375 % éch. 26/01/2031             | €                                | 100                       | 113      | 0,02 |
| BPER Banca SpA                     |                                     |                                  |                           | Golub Capital BDC, Inc.                              |                                     |                                  |                           |             | Sammons Financial Group, Inc.       |                                  |                           |          |      |
| 3,250 % éch. 22/01/2031            | €                                   | 2 160                            | 2 490                     | 2,500 % éch. 24/08/2026                              |                                     | 100                              | 100                       | 0,01        | 5,950 % éch. 15/06/2036             | \$                               | 100                       | 100      | 0,01 |
| Burford Capital Global Finance LLC |                                     |                                  |                           | GSG Bidco Ltd.                                       |                                     |                                  |                           |             | SBA Tower Trust                     |                                  |                           |          |      |
| 8,500 % éch. 15/01/2034            | \$                                  | 500                              | 439                       | 4,700 % éch. 15/06/2031                              | €                                   | 600                              | 680                       | 0,10        | 1,631 % éch. 15/05/2051             |                                  | 1 900                     | 1 880    | 0,27 |
| CaixaBank S.A.                     |                                     |                                  |                           | GTA Finance Co. Pty. Ltd.                            |                                     |                                  |                           |             | 1,840 % éch. 15/04/2027             |                                  | 800                       | 783      | 0,11 |
| 5,801 % éch. 26/05/2031            | AUD                                 | 1 000                            | 705                       | 2,200 % éch. 26/08/2027                              |                                     | 800                              | 535                       | 0,08        | Scentre Group Trust                 |                                  |                           |          |      |
| Canadian Imperial Bank of Commerce |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 04/12/2029                              | AUD                                 | 1 700                            | 1 172                     | 0,17        | 5,200 % éch. 27/11/2029             | AUD                              | 1 700                     | 1 177    | 0,17 |
| 2,625 % éch. 01/10/2029            | €                                   | 3 100                            | 3 518                     | JPMorgan Chase & Co.                                 |                                     |                                  |                           |             | SELP Finance SARL                   |                                  |                           |          |      |
| Capital One Financial Corp.        |                                     |                                  |                           | 3,782 % éch. 01/02/2028                              | \$                                  | 1 975                            | 1 967                     | 0,29        | 4,000 % éch. 29/06/2033             | €                                | 1 300                     | 1 494    | 0,22 |
| 4,927 % éch. 10/05/2028            | \$                                  | 4 900                            | 4 912                     | Kodit Global Co. Ltd.                                |                                     |                                  |                           |             | Simon Global Development BV         |                                  |                           |          |      |
| CCF SFH SACA                       |                                     |                                  |                           | 5,357 % éch. 29/05/2027                              |                                     | 2 100                            | 2 117                     | 0,31        | 3,650 % éch. 15/06/2031             |                                  | 2 500                     | 2 882    | 0,42 |
| 2,500 % éch. 28/06/2028            | €                                   | 300                              | 340                       | Kookmin Bank                                         |                                     |                                  |                           |             | Sixth Street Lending Partners       |                                  |                           |          |      |
| 2,500 % éch. 09/04/2029            |                                     | 5 600                            | 6 329                     | 2,625 % éch. 29/09/2029                              | €                                   | 3 500                            | 3 962                     | 0,58        | 5,750 % éch. 15/01/2030             | \$                               | 1 000                     | 994      | 0,14 |
| CI Financial Corp.                 |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 21/01/2028                              |                                     | 1 000                            | 1 142                     | 0,17        | 6,500 % éch. 11/03/2029             |                                  | 300                       | 306      | 0,04 |
| 4,625 % éch. 12/12/2031            |                                     | 4 400                            | 5 099                     |                                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                  |                           |          |      |

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Stellantis Financial Services U.S. Corp.<br>5,400 % éch. 15/06/2029<br>5,800 % éch. 15/06/2031 | \$ 800<br>1 000                     | \$ 797<br>989                    | 0,12<br>0,14              | EC Finance PLC<br>3,250 % éch. 15/10/2026<br>Eni SpA<br>3,500 % éch. 26/05/2031                                                   | € 1 300<br>600                      | \$ 1 484<br>691                  | 0,22<br>0,10              | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,125 % éch. 01/06/2031<br>Thames Water Super Senior Issuer PLC<br>9,750 % éch. 10/10/2027 | € 3 200<br>£ 160                    | \$ 3 688<br>225                  | 0,54<br>0,03              |
| Stoneweg Ereit Lux Finco SARL<br>4,250 % éch. 30/01/2031                                       | € 1 000                             | 1 155                            | 0,17                      | Eramet S.A.<br>6,500 % éch. 30/11/2029<br>Flora Food Management BV<br>6,875 % éch. 02/07/2029                                     | 300<br>1 100                        | 340<br>1 230                     | 0,05<br>0,18              | Toyota Motor Finance Netherlands BV<br>2,664 % éch. 27/05/2027<br>Ubisoft Entertainment S.A.<br>0,878 % éch. 24/11/2027                  | € 2 400<br>400                      | 2 747<br>405                     | 0,40<br>0,06              |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.<br>4,238 % éch. 15/06/2029 (f)                                   | \$ 3 400                            | 3 397                            | 0,49                      | Flutter Treasury DAC<br>6,125 % éch. 04/06/2031<br>FMC Corp.<br>8,000 % éch. 01/06/2031                                           | 900<br>£ 4 600<br>\$ 100            | 1 027<br>6 102<br>104            | 0,15<br>0,89<br>0,02      | United Airlines Pass-Through Trust<br>3,750 % éch. 03/03/2028<br>5,875 % éch. 15/04/2029<br>Var Energi ASA<br>3,875 % éch. 12/03/2031    | \$ 124<br>311<br>€ 2 400            | 124<br>315<br>2 766              | 0,02<br>0,05<br>0,40      |
| UBS AG<br>3,422 % éch. 01/08/2032<br>4,678 % éch. 29/11/2030                                   | 500<br>\$ 2 100                     | 575<br>2 097                     | 0,08<br>0,30              | Gartner, Inc.<br>3,625 % éch. 15/06/2029<br>Glencore Funding LLC<br>4,000 % éch. 27/03/2027                                       | 3 200<br>1 500                      | 3 027<br>1 495                   | 0,44<br>0,22              | Venture Global LNG, Inc.<br>6,375 % éch. 15/12/2034<br>Vmed 02 UK Financing PLC<br>4,500 % éch. 15/07/2031                               | \$ 1 900<br>£ 1 000                 | 1 868<br>1 095                   | 0,27<br>0,16              |
| UBS Group AG<br>1,494 % éch. 10/08/2027                                                        | 1 800                               | 1 794                            | 0,26                      | Green Palm Bidco SARL<br>5,957 % éch. 30/06/2041<br>Grifols S.A.<br>7,500 % éch. 01/05/2030 (f)                                   | 2 000<br>200<br>€ 615               | 2 009<br>202<br>733              | 0,29<br>0,03<br>0,11      | 5,625 % éch. 15/04/2032<br>7,750 % éch. 15/04/2032<br>Weir Group Australian Holdings Pty. Ltd.<br>5,200 % éch. 23/01/2031                | € 2 200<br>\$ 1 600<br>AUD 2 600    | 2 217<br>1 447<br>1 736          | 0,32<br>0,21<br>0,25      |
| Volkswagen Bank GmbH<br>3,625 % éch. 26/11/2028                                                | € 400                               | 460                              | 0,07                      | Grupo Nutresa S.A.<br>8,000 % éch. 12/05/2030<br>9,000 % éch. 12/05/2035<br>GSG Bidco Ltd.<br>5,375 % éch. 15/06/2036             | 1 100<br>£ 2 000<br>€ 700           | 1 260<br>2 666<br>794            | 0,18<br>0,39<br>0,12      | Westinghouse Air Brake Technologies Corp.<br>3,450 % éch. 15/11/2026<br>Whitbread Group PLC<br>2,375 % éch. 31/05/2027                   | \$ 450<br>£ 500                     | 448<br>648                       | 0,06<br>0,09              |
| Volkswagen Financial Services AG<br>3,750 % éch. 10/09/2026                                    | 1 100                               | 1 260                            | 0,18                      | Heidelberg Materials AG<br>3,500 % éch. 10/10/2029<br>Hyundai Capital America<br>2,750 % éch. 27/09/2026                          | 300<br>\$ 1 900                     | 346<br>1 894                     | 0,05<br>0,27              | WMG Acquisition Corp.<br>3,750 % éch. 01/12/2029<br>Worley Financial Services Pty. Ltd.<br>5,950 % éch. 13/10/2028                       | \$ 2 130<br>AUD 2 600               | 2 040<br>1 816                   | 0,30<br>0,26              |
| Volkswagen Financial Services NV<br>5,500 % éch. 07/12/2026                                    | £ 2 000                             | 2 666                            | 0,39                      | Imperial Brands Finance PLC<br>3,875 % éch. 02/08/2033<br>Informa PLC<br>3,750 % éch. 29/04/2032                                  | 800<br>€ 3 200<br>1 900             | 849<br>3 629<br>2 177            | 0,12<br>0,53<br>0,32      | Yorke Water Finance PLC<br>1,750 % éch. 26/11/2026<br>5,250 % éch. 28/04/2030                                                            | \$ 450<br>£ 3 900                   | 448<br>5 154                     | 0,06<br>0,75              |
| Wells Fargo & Co.<br>3,000 % éch. 23/10/2026<br>4,577 % éch. 20/05/2029                        | \$ 1 300<br>4 300                   | 1 295<br>4 290                   | 0,19<br>0,62              | InterContinental Hotels Group PLC<br>2,125 % éch. 24/08/2026<br>2,125 % éch. 15/05/2027<br>Kering S.A.<br>5,125 % éch. 23/11/2026 | € 615<br>£ 500<br>£ 900             | 733<br>661<br>1 197              | 0,11<br>0,10<br>0,17      | 2,375 % éch. 31/05/2027<br>Wynn Las Vegas LLC<br>5,250 % éch. 01/05/2027                                                                 | £ 500<br>\$ 1 100                   | 648<br>1 100                     | 0,09<br>0,16              |
| <b>INDUSTRIE</b>                                                                               |                                     |                                  |                           | 226 689                                                                                                                           | 32,90                               |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Air Canada Pass-Through Trust<br>3,600 % éch. 15/09/2028<br>3,750 % éch. 15/06/2029            | 113<br>518                          | 112<br>510                       | 0,02<br>0,07              | Latvenergo A/S<br>3,612 % éch. 13/11/2030<br>Lottomatica Group SpA<br>4,625 % éch. 30/04/2032                                     | € 1 300<br>200                      | 1 479<br>230                     | 0,21<br>0,03              | 2,450 % éch. 15/01/2031<br>5,200 % éch. 15/07/2029<br>5,450 % éch. 06/06/2028                                                            | \$ 500<br>100<br>1 200              | 446<br>101<br>1 214              | 0,06<br>0,01<br>0,18      |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust<br>4,800 % éch. 15/02/2029                                  | 683                                 | 683                              | 0,10                      | Maple Parent Holdings Corp.<br>4,728 % éch. 26/03/2035<br>Mobility Global, Inc.<br>5,050 % éch. 15/06/2029                        | € 500<br>€ 2 400<br>\$ 1 400        | 661<br>2 726<br>1 438            | 0,10<br>0,40<br>0,21      | Anglian Water Osprey Financing PLC<br>2,000 % éch. 31/07/2028<br>6,750 % éch. 27/08/2031                                                 | \$ 1 100<br>£ 400<br>600            | 1 100<br>492<br>803              | 0,16<br>0,07<br>0,12      |
| Altred Investment Authority S.A.S.<br>4,429 % éch. 23/06/2032                                  | € 800                               | 920                              | 0,13                      | NTT Finance Corp.<br>2,743 % éch. 16/07/2027<br>3,325 % éch. 01/11/2029 (a)<br>3,559 % éch. 01/11/2031 (a)                        | £ 500<br>€ 2 400<br>800             | 661<br>2 726<br>916              | 0,10<br>0,40<br>0,13      | Anglian Water Services Financing PLC<br>5,875 % éch. 20/06/2031<br>Chile Electricity PEC SpA<br>0,000 % éch. 25/01/2028 (b)              | £ 400<br>2 000<br>\$ 1 332          | 524<br>2 700<br>1 231            | 0,08<br>0,39<br>0,18      |
| American Airlines Pass-Through Trust<br>3,375 % éch. 01/11/2028<br>3,575 % éch. 15/07/2029     | \$ 224<br>384                       | 222<br>379                       | 0,03<br>0,05              | Origin Energy Finance Ltd.<br>1,000 % éch. 17/09/2029<br>PRA Health Sciences, Inc.<br>2,875 % éch. 15/07/2026                     | € 900<br>€ 2 400<br>\$ 650          | 1 197<br>2 749<br>650            | 0,17<br>0,40<br>0,09      | Columbia Pipelines Holding Co. LLC<br>6,055 % éch. 15/08/2026<br>Edison International<br>4,125 % éch. 15/03/2028                         | \$ 1 332<br>800<br>1 000            | 1 231<br>800<br>986              | 0,18<br>0,12<br>0,14      |
| Altrid Investment Authority S.A.S.<br>4,429 % éch. 23/06/2032                                  | € 800                               | 920                              | 0,13                      | Repsol E&P Capital Markets U.S. LLC<br>5,204 % éch. 16/09/2030<br>Sage Group PLC<br>1,625 % éch. 25/02/2031                       | € 500<br>\$ 1 600<br>600            | 120<br>1 596<br>597              | 0,02<br>0,23<br>0,09      | ElectraNet Pty. Ltd.<br>2,474 % éch. 15/12/2028<br>EnBW International Finance BV<br>3,625 % éch. 22/11/2026                              | AUD 700<br>€ 1 600<br>€ 1 400       | 454<br>1 837<br>1 399            | 0,07<br>0,27<br>0,20      |
| Arcadis NV<br>4,000 % éch. 20/05/2031                                                          | 900                                 | 1 034                            | 0,15                      | SEB S.A.<br>3,625 % éch. 24/06/2030<br>Sika Capital BV<br>3,750 % éch. 03/11/2026                                                 | 300<br>\$ 2 000<br>1 000            | 353<br>2 004<br>1 006            | 0,05<br>0,29<br>0,15      | ENEL Finance International NV<br>1,625 % éch. 12/07/2026<br>EPH Financing International A/S<br>6,651 % éch. 13/11/2028                   | \$ 1 400<br>€ 400<br>€ 1 400        | 1 399<br>486<br>1 399            | 0,20<br>0,07<br>0,20      |
| Ashtead Capital, Inc.<br>1,500 % éch. 12/08/2026                                               | \$ 400                              | 399                              | 0,06                      | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045<br>Repsol E&P Capital Markets U.S. LLC<br>5,204 % éch. 16/09/2030       | € 400<br>€ 2 400<br>\$ 650          | 918<br>2 749<br>650              | 0,13<br>0,40<br>0,09      | Evergy Missouri West, Inc.<br>4,700 % éch. 21/05/2029<br>Fells Point Funding Trust<br>3,046 % éch. 31/01/2027                            | \$ 100<br>500<br>500                | 100<br>495<br>495                | 0,01<br>0,07<br>0,07      |
| Assa Abloy AB<br>3,750 % éch. 13/09/2026                                                       | € 1 000                             | 1 145                            | 0,17                      | Sage Group PLC<br>1,625 % éch. 25/02/2031<br>SEB S.A.<br>3,625 % éch. 24/06/2030                                                  | € 1 000<br>€ 2 400<br>€ 4 000       | 1 006<br>2 637<br>4 499          | 0,15<br>0,38<br>0,65      | KeySpan Gas East Corp.<br>2,742 % éch. 15/08/2026<br>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>2,200 % éch. 02/12/2026                    | \$ 1 332<br>1 300<br>AUD 2 500      | 1 231<br>1 297<br>1 713          | 0,18<br>0,19<br>0,25      |
| Bayer U.S. Finance LLC<br>6,125 % éch. 21/11/2026                                              | \$ 5 277                            | 5 305                            | 0,77                      | Sika Capital BV<br>3,750 % éch. 03/11/2026                                                                                        | 2 300                               | 2 637                            | 0,38                      | Northumbrian Water Finance PLC<br>1,625 % éch. 11/10/2026                                                                                | £ 1 880                             | 2 476                            | 0,36                      |
| Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                                | 6 457                               | 6 590                            | 0,96                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Block, Inc.<br>3,500 % éch. 01/06/2031                                                         | 1 500                               | 1 382                            | 0,20                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Booking Holdings, Inc.<br>4,000 % éch. 15/11/2026                                              | € 800                               | 918                              | 0,13                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Burberry Group PLC<br>5,750 % éch. 20/06/2030                                                  | £ 400                               | 536                              | 0,08                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| CDW LLC<br>2,670 % éch. 01/12/2026                                                             | \$ 1 800                            | 1 786                            | 0,26                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| CGI, Inc.<br>1,450 % éch. 14/09/2026                                                           | 2 700                               | 2 685                            | 0,39                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Chanel Ceres PLC<br>0,500 % éch. 31/07/2026                                                    | € 1 700                             | 1 940                            | 0,28                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| China Modern Dairy Holdings Ltd.<br>2,125 % éch. 14/07/2026                                    | \$ 1 400                            | 1 399                            | 0,20                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Chpe LLC<br>4,875 % éch. 30/06/2031                                                            | 100                                 | 100                              | 0,01                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| Coty, Inc.<br>4,500 % éch. 15/05/2027                                                          | € 2 300                             | 2 642                            | 0,38                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |
| DSV Finance BV<br>2,875 % éch. 06/11/2026                                                      | 2 000                               | 2 288                            | 0,33                      |                                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                                                                          |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Nova Securitisation SARL<br>5,750 % éch. 03/02/2031                                                    | \$ 2 100                            | \$ 2 027                         | 0,29                      | Triton Bond Trust<br>5,000 % éch. 15/02/2058                             | AUD 1 525                           | \$ 1 057                         | 0,15                      | Rockford Tower Europe CLO DAC<br>3,121 % éch. 24/01/2035                                     | € 1 000                             | \$ 1 144                         | 0,17                      |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara<br>4,125 % éch. 15/05/2027                   | 1 200                               | 1 193                            | 0,17                      | 5,250 % éch. 15/02/2058                                                  | 6 000                               | 4 145                            | 0,60                      | SC Germany S.A.<br>2,863 % éch. 14/05/2036                                                   | 200                                 | 229                              | 0,03                      |
| Semptra<br>4,313 % éch. 07/01/2028                                                                     | 2 900                               | 2 914                            | 0,42                      | Twin Bridges PLC<br>4,589 % éch. 17/10/2071 (a)                          | £ 2 500                             | 3 318                            | 0,48                      | Tikehau CLO DAC<br>3,458 % éch. 20/01/2037                                                   | 3 000                               | 3 436                            | 0,50                      |
| SW Finance PLC<br>5,750 % éch. 19/11/2030                                                              | £ 2 600                             | 3 367                            | 0,49                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>4,994 % éch. 25/01/2047 | \$ 137                              | 125                              | 0,02                      | Toro European CLO DAC<br>3,474 % éch. 15/04/2037                                             | 1 000                               | 1 145                            | 0,17                      |
| TDC Net A/S<br>6,500 % éch. 01/06/2031                                                                 | € 2 000                             | 2 520                            | 0,37                      | 5,764 % éch. 25/01/2033                                                  | 3                                   | 3                                | 0,00                      |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Veon Midco BV<br>6,950 % éch. 01/06/2031                                                               |                                     |                                  |                           |                                                                          |                                     | 59 273                           | 8,61                      |                                                                                              |                                     | 34 235                           | 4,97                      |
| 7,450 % éch. 01/06/2033                                                                                | \$ 1 900                            | 1 898                            | 0,28                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                        | 1 100                               | 1 098                            | 0,16                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                        |                                     | 34 047                           | 4,94                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Total des Obligations et billets privés                                                                |                                     | 401 519                          | 58,28                     |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                               |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES</b>                    |                                     |                                  |                           | <b>PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE</b>                                               |                                     |                                  |                           |
| Fannie Mae<br>4,678 % éch. 25/04/2056                                                                  | 1 535                               | 1 534                            | 0,22                      | Auto ABS Italian Stella Loans SRL<br>2,953 % éch. 26/12/2041             | € 1 000                             | 1 145                            | 0,17                      | Curzon Mortgages PLC<br>4,592 % éch. 28/07/2049                                              | £ 1 500                             | 1 992                            | 0,29                      |
| 4,828 % éch. 25/11/2055                                                                                | 874                                 | 885                              | 0,13                      | BBVA Consumer Auto<br>2,819 % éch. 25/02/2042                            | 1 000                               | 1 144                            | 0,16                      |                                                                                              |                                     | 53 757                           | 7,80                      |
| Ginnie Mae<br>4,459 % éch. 20/04/2054                                                                  | 1 133                               | 1 136                            | 0,16                      | Bumper NL BV<br>2,955 % éch. 22/03/2035                                  | 1 554                               | 1 778                            | 0,26                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,709 % éch. 20/10/2055                                                                                | 1 504                               | 1 510                            | 0,22                      | Cars Alliance SARL<br>2,856 % éch. 19/05/2036                            | 1 500                               | 1 717                            | 0,25                      | Obligation internationale du gouvernement belge<br>0,800 % éch. 22/06/2028                   | € 2 500                             | 2 761                            | 0,40                      |
| 6,000 % éch. 20/08/2055                                                                                | 1 104                               | 1 128                            | 0,16                      | Fulvia SPV SRL<br>3,030 % éch. 23/12/2041                                | 1 633                               | 1 872                            | 0,27                      | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>6,000 % éch. 01/04/2033                    | CLP 3 155 000                       | 3 544                            | 0,51                      |
| Ginnie Mae, TBA<br>3,000 % éch. 01/08/2056                                                             | 7 400                               | 6 564                            | 0,95                      | Panorama Auto Trust<br>5,367 % éch. 20/05/2034                           | AUD 1 700                           | 1 178                            | 0,17                      | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>4,500 % éch. 26/11/2030               | € 900                               | 1 033                            | 0,15                      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056                                                                                | 5 000                               | 4 803                            | 0,70                      | RevoCar S.A., Compartement<br>2,835 % éch. 21/10/2039                    | € 2 000                             | 2 288                            | 0,33                      | TES colombien<br>11,000 % éch. 22/08/2029                                                    | COP 10 052 500                      | 2 830                            | 0,41                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>4,000 % éch. 01/12/2054 - 01/05/2056      | 22 626                              | 21 161                           | 3,07                      | SC Sweden SARL<br>2,825 % éch. 25/12/2039                                | 4 200                               | 4 808                            | 0,70                      | 11,750 % éch. 24/01/2035                                                                     | 9 565 000                           | 2 725                            | 0,40                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA<br>4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056 | 31 700                              | 29 618                           | 4,30                      |                                                                          |                                     | 15 930                           | 2,31                      | 12,750 % éch. 28/11/2040                                                                     | 14 678 200                          | 4 442                            | 0,65                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                                                                | 12 700                              | 12 724                           | 1,85                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES COMMERCIALES AUTRES</b>   |                                     |                                  |                           | 13,250 % éch. 09/02/2033                                                                     | 8 775 200                           | 2 686                            | 0,39                      |
| 6,000 % éch. 01/08/2056                                                                                | 4 500                               | 4 586                            | 0,67                      | ACREC LLC<br>5,087 % éch. 18/08/2044                                     | \$ 500                              | 501                              | 0,07                      | Obligation internationale du gouvernement costaricain<br>5,950 % éch. 27/04/2033             | € 700                               | 854                              | 0,12                      |
| 6,500 % éch. 01/08/2056                                                                                | 23 800                              | 24 593                           | 3,57                      |                                                                          |                                     |                                  |                           | CPPIB Capital, Inc.<br>4,250 % éch. 20/07/2028                                               | \$ 1 050                            | 1 051                            | 0,15                      |
|                                                                                                        |                                     | 110 242                          | 16,00                     | <b>PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES</b>                               |                                     |                                  |                           | Eagle Funding Luxco SARL<br>5,500 % éch. 17/08/2030                                          | 8 300                               | 8 344                            | 1,21                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b>         |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>4,383 % éch. 25/12/2035        | 99                                  | 98                               | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033 | 1 400                               | 1 395                            | 0,20                      |
| AFG Trust<br>5,012 % éch. 10/10/2057                                                                   | AUD 379                             | 262                              | 0,04                      | RCKT Mortgage Trust<br>5,321 % éch. 25/06/2056                           | 1 000                               | 1 001                            | 0,15                      | 4,875 % éch. 30/04/2029                                                                      | 1 200                               | 1 209                            | 0,18                      |
| 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                                | 3 400                               | 2 349                            | 0,34                      |                                                                          |                                     | 1 099                            | 0,16                      | Obligation internationale du gouvernement hongrois<br>4,000 % éch. 25/07/2029                | € 1 100                             | 1 289                            | 0,19                      |
| Atlas Funding PLC<br>4,563 % éch. 20/01/2068                                                           | £ 1 100                             | 1 463                            | 0,21                      | <b>AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement israélien<br>5,000 % éch. 30/10/2026               | 800                                 | 921                              | 0,13                      |
| Avon Finance PLC<br>4,646 % éch. 28/12/2049                                                            | 1 574                               | 2 089                            | 0,30                      | AGL CLO Ltd.<br>5,040 % éch. 20/04/2037                                  | 800                                 | 801                              | 0,12                      | 5,375 % éch. 19/02/2030                                                                      | \$ 1 000                            | 1 014                            | 0,15                      |
| Bletchley Park Funding PLC<br>4,604 % éch. 27/07/2070                                                  | 915                                 | 1 217                            | 0,18                      | Ares European CLO DAC<br>3,512 % éch. 15/07/2037                         | € 1 000                             | 1 144                            | 0,16                      | Japan Bank for International Cooperation<br>3,125 % éch. 22/04/2031                          | € 400                               | 459                              | 0,07                      |
| Braccan Mortgage Funding PLC<br>4,587 % éch. 15/02/2067                                                | 4 327                               | 5 747                            | 0,84                      | Bain Capital Euro CLO DAC<br>3,449 % éch. 15/01/2037                     | 1 000                               | 1 145                            | 0,17                      | Obligation internationale du gouvernement japonais<br>0,700 % éch. 20/12/2050                | ¥ 8 100                             | 25                               | 0,00                      |
| Dilosk RMBS DAC<br>2,733 % éch. 25/10/2064                                                             | € 1 000                             | 1 142                            | 0,17                      | Grosvenor Place CLO DAC<br>4,029 % éch. 15/01/2037                       | 3 600                               | 4 123                            | 0,60                      | 2,400 % éch. 20/03/2055                                                                      | 1 067 400                           | 4 867                            | 0,71                      |
| Domi BV<br>2,892 % éch. 15/02/2057                                                                     | 3 125                               | 3 571                            | 0,52                      | Barings Euro CLO DAC<br>3,426 % éch. 15/08/2039                          | 1 500                               | 1 716                            | 0,25                      | Korea Housing Finance Corp.<br>2,733 % éch. 02/07/2028                                       | € 1 500                             | 1 708                            | 0,25                      |
| Dutch Property Finance BV<br>2,913 % éch. 28/10/2059                                                   | 868                                 | 992                              | 0,14                      | Barings Private Credit Corp. CLO<br>5,126 % éch. 22/05/2034              | \$ 1 000                            | 1 001                            | 0,14                      | 2,742 % éch. 05/03/2030                                                                      | 1 100                               | 1 246                            | 0,18                      |
| Frontier Mortgage Funding PLC<br>4,532 % éch. 20/12/2066                                               | £ 2 900                             | 3 852                            | 0,56                      | BBVA Consumer FTA<br>2,849 % éch. 20/05/2039                             | € 1 407                             | 1 607                            | 0,23                      | 3,124 % éch. 18/03/2029                                                                      | 1 300                               | 1 493                            | 0,22                      |
| GS Mortgage-Backed Securities Trust<br>3,133 % éch. 24/11/2067                                         | € 500                               | 573                              | 0,08                      | Boursobank Consumer Loans France<br>2,939 % éch. 24/05/2044              | 1 500                               | 1 716                            | 0,25                      | Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,950 % éch. 12/08/2031                | PEN 801                             | 267                              | 0,04                      |
| GSR Mortgage Loan Trust<br>4,837 % éch. 25/09/2035                                                     | \$ 1                                | 1                                | 0,00                      | CVC Cordatus Loan Fund DAC<br>3,066 % éch. 25/04/2036                    | 2 000                               | 2 288                            | 0,33                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                                                                      | 20 500                              | 6 735                            | 0,98                      |
| Harvest Funding PLC<br>4,643 % éch. 15/11/2069                                                         | £ 2 000                             | 2 655                            | 0,39                      | Grosvenor Place CLO DAC<br>3,383 % éch. 15/08/2039                       | 1 000                               | 1 144                            | 0,16                      | Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033                  | \$ 750                              | 754                              | 0,11                      |
| Jubilee Place BV<br>2,900 % éch. 17/10/2061                                                            | € 4 946                             | 5 651                            | 0,82                      | Harvest CLO DAC<br>3,523 % éch. 25/07/2037 (a)                           | 1 000                               | 1 143                            | 0,16                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>4,125 % éch. 12/01/2029                | 4 000                               | 3 943                            | 0,57                      |
| 3,207 % éch. 17/09/2060                                                                                | 2 399                               | 2 749                            | 0,40                      | Invesco Euro CLO DAC<br>3,277 % éch. 15/07/2037                          | 1 000                               | 1 145                            | 0,17                      | Obligation internationale du gouvernement serbe<br>4,250 % éch. 06/05/2031                   | € 4 700                             | 5 387                            | 0,78                      |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC<br>4,546 % éch. 15/03/2061                                          | £ 1 783                             | 2 369                            | 0,34                      | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC<br>3,414 % éch. 15/07/2039   | 1 000                               | 1 145                            | 0,17                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,250 % éch. 31/03/2032            | ZAR 72 900                          | 4 497                            | 0,65                      |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust<br>5,049 % éch. 25/11/2034                                          | \$ 1                                | 1                                | 0,00                      | Providus CLO DAC<br>3,415 % éch. 20/11/2038                              | 1 000                               | 1 144                            | 0,17                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                                                      | 114 800                             | 7 259                            | 1,05                      |
| 6,151 % éch. 25/09/2034                                                                                | 135                                 | 131                              | 0,02                      | Rockfield Park CLO DAC<br>3,143 % éch. 16/07/2034                        | 3 632                               | 4 156                            | 0,60                      | Gouvernement de la métropole de Tokyo<br>4,125 % éch. 30/04/2031                             | \$ 800                              | 791                              | 0,11                      |
| Project Cashmere<br>4,543 % éch. 30/12/2057 (a)                                                        | AUD 20 000                          | 13 811                           | 2,01                      |                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     | 75 529                           | 10,96                     |

| DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                                            |           |                                  |                           |
| <b>BILLETS À COURT TERME</b>                                                              |                                     |                                  |                           | <b>PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)</b> |           |                                  |                           |
| Kona Spc Ltd.<br>5,718 % éch. 15/09/2026                                                  | € 1 500                             | \$ 1 716                         | 0,25                      | 176 200                                                                    | \$ 17 704 | 2,57                             |                           |
| Yango Justice International Ltd.<br>5,300 % éch. 11/01/2022 ^                             | \$ 200                              | 1                                | 0,00                      |                                                                            |           |                                  |                           |
|                                                                                           |                                     | 1 717                            | 0,25                      |                                                                            |           |                                  |                           |
| Total des Instruments à court terme                                                       |                                     | 1 717                            | 0,25                      |                                                                            |           |                                  |                           |
| Total des Valeurs mobilières                                                              |                                     | \$ 712 141                       | 103,37                    |                                                                            |           |                                  |                           |
| <b>ACTIONS</b>                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                            |           |                                  |                           |
| <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                             |                                     |                                  |                           |                                                                            |           |                                  |                           |
| <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                            |           |                                  |                           |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (d) | 2 083 333                           | 22 750                           | 3,30                      |                                                                            |           |                                  |                           |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (d)                    | 5 163                               | 81                               | 0,01                      |                                                                            |           |                                  |                           |
|                                                                                           |                                     | 22 831                           | 3,31                      |                                                                            |           |                                  |                           |

**CONTRATS DE MISE EN PENSION**

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du<br>principal | Garanti par                                             | Garantie<br>(reçue) | Contrats de<br>mise en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|----------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| FICC                                  | 3,640 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 4 800                   | Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/07/2031 | \$ (4 896)          | \$ 4 800                                       | \$ 4 800                                                                       | 0,70                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                            |                                                         | \$ (4 896)          | \$ 4 800                                       | \$ 4 800                                                                       | 0,70                   |

(1) Comprend les intérêts courus.

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)**

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

**CONTRATS À TERME STANDARDISÉS**

| Description                                                                                       | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre             | Long  | 09/2026              | 64                    | \$ 24                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026              | 105                   | 108                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 2 ans septembre           | Long  | 09/2026              | 48                    | 13                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre           | Long  | 09/2026              | 101                   | 76                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                             | Court | 09/2026              | 65                    | (68)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026              | 135                   | 161                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Court | 09/2026              | 163                   | (225)                                   | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Long  | 09/2026              | 33                    | 85                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026              | 138                   | (73)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026              | 833                   | 71                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 698                   | (163)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 804                   | 155                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026              | 42                    | 5                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026              | 464                   | 567                                     | 0,08                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026              | 185                   | 249                                     | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026              | 257                   | 605                                     | 0,09                   |
|                                                                                                   |       |                      |                       | \$ 1 590                                | 0,23                   |

**OPTIONS VENDUES****OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE**

| Description                                                                                               | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime   | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|---------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | \$ 108,000         | 24/07/2026           | 9                     | (2)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,500            | 24/07/2026           | 12                    | (3)     | (2)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026     | 111,000            | 24/07/2026           | 21                    | (5)     | (2)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,250            | 02/07/2026           | 4                     | (1)     | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 02/07/2026           | 9                     | (1)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 02/07/2026           | 4                     | (1)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500            | 02/07/2026           | 9                     | (2)     | 0               | 0,00                   |
|                                                                                                           |                    |                      |                       | \$ (15) | \$ (5)          | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                                |                    |                      |                       |         | \$ 1 585        | 0,23                   |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence          | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Ally Financial, Inc.         | 5,000 %              | 20/06/2031      | \$ 2 100                         | \$ 5                              | 0,00                |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                | 20/06/2028      | 1 200                            | 27                                | 0,01                |
| Banco Santander S.A.         | 1,000                | 20/12/2030      | € 3 600                          | 5                                 | 0,00                |
| Bank of America Corp.        | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 2 100                         | (19)                              | 0,00                |
| Bank of America Corp.        | 1,000                | 20/12/2030      | 6 400                            | (4)                               | 0,00                |
| Bank of America Corp.        | 1,000                | 20/12/2031      | 1 800                            | 15                                | 0,00                |
| Carnival Corp.               | 1,000                | 20/12/2030      | 1 100                            | 7                                 | 0,00                |
| Danske Bank A/S              | 1,000                | 20/12/2030      | € 4 700                          | 16                                | 0,00                |
| Deutsche Bank AG             | 1,000                | 20/12/2030      | 6 600                            | 24                                | 0,00                |
| General Motors Co.           | 5,000                | 20/12/2026      | \$ 80                            | (13)                              | 0,00                |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000                | 20/06/2028      | € 500                            | (26)                              | 0,00                |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000                | 20/12/2028      | 400                              | (8)                               | 0,00                |
| Goldman Sachs Group, Inc.    | 1,000                | 20/12/2030      | \$ 4 200                         | (2)                               | 0,00                |
| Goldman Sachs Group, Inc.    | 1,000                | 20/12/2031      | 1 800                            | 14                                | 0,00                |
| NatWest Group PLC            | 1,000                | 20/12/2032      | € 2 500                          | (3)                               | 0,00                |
| Stellantis NV                | 5,000                | 20/12/2030      | 3 700                            | (131)                             | (0,02)              |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2027      | \$ 200                           | 4                                 | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/06/2028      | 1 800                            | 25                                | 0,00                |
|                              |                      |                 |                                  | \$ (64)                           | (0,01)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                 | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans  | (5,000) %           | 20/06/2031      | \$ 36 234                        | \$ (35)                           | (0,01)              |
| Indice CDX.IG-46 Index à 10 ans | (1,000)             | 20/06/2036      | 123 200                          | (403)                             | (0,05)              |
|                                 |                     |                 |                                  | \$ (438)                          | (0,06)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 1 400                         | \$ 0                              | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                | 20/06/2031      | 279 510                          | 206                               | 0,03                |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans   | 5,000                | 20/06/2031      | € 10 400                         | 216                               | 0,03                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 27 705                           | 23                                | 0,00                |
|                                            |                      |                 |                                  | \$ 445                            | 0,06                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 49 660          | \$ (478)                          | (0,07)              |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      | 27 500            | 427                               | 0,06                |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 10 370            | (8)                               | 0,00                |
| À payer                                            | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750     | 19/03/2030      | ¥ 1 170 000       | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031      | \$ 9 600          | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,281     | 15/02/2040      | 11 400            | 964                               | 0,14                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 34 700            | 1 314                             | 0,19                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 103 100           | 2 920                             | 0,42                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 47 400            | 226                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2045      | 5 500             | 166                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 7 300             | 77                                | 0,01                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 16/09/2056      | 9 900             | (44)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,002     | 28/05/2036      | 500               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 12,030    | 04/01/2027      | BRL 61 900        | (394)                             | (0,06)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,359    | 02/01/2029      | 45 400            | (173)                             | (0,02)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,402    | 02/01/2029      | 65 400            | (247)                             | (0,03)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,926    | 04/01/2027      | 101 800           | (161)                             | (0,02)              |
| À recevoir                                         | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,160     | 31/03/2032      | ZAR 71 100        | 82                                | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 3,500     | 17/12/2030      | AUD 20 800        | (476)                             | (0,07)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 19/03/2030      | 9 800             | (149)                             | (0,02)              |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,660     | 01/04/2033      | CLP 3 121 600     | (39)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,650     | 11/05/2027      | € 3 800           | (57)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,520     | 27/03/2035      | 500               | (14)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 35 850            | 333                               | 0,05                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 15 640            | (368)                             | (0,05)              |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois                | 5,155     | 25/10/2034      | PLN 10 900        | (88)                              | (0,01)              |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 3 808                          | 0,55                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 3 751                          | 0,54                |



- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 2 155                            | \$ 22  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 3 814                            | 26     | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 09/07/2026        | 5 551                            | 51     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 10/07/2026        | 5 529                            | 44     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 143 | \$ 0         | 0,00                |

##### OPTIONS VENDUES

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 2 155                            | \$ (8)  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 3 814                            | (8)     | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 09/07/2026        | 5 551                            | (18)    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 5 529                            | (14)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (48) | \$ 0         | 0,00                |

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                               | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,500 %         | 31/01/2028        | 122 800                          | \$ (363) | \$ (493)     | (0,07)              |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK          | Petroleos Mexicanos | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 100                           | \$ (1)                 | \$ 1                             | \$ 0         | 0,00                |
| GST          | AT&T, Inc.          | 1,000                | 20/06/2028      | 800                              | (9)                    | 18                               | 9            | 0,00                |
|              |                     |                      |                 |                                  | \$ (10)                | \$ 19                            | \$ 9         | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 2 400                          | \$ 544                 | \$ (33)                          | \$ 511       | 0,07                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 400                            | 494                    | 17                               | 511          | 0,07                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 300                              | 68                     | (4)                              | 64           | 0,01                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 3 720                            | 766                    | 25                               | 791          | 0,12                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 1 872               | \$ 5                             | \$ 1 877     | 0,27                |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 6 768             | \$ 4 840           | \$ 151                | \$ 0                                    | \$ 151              | 0,02   |
|              | 07/2026           | CNH             | 6 124             | 907                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 4 287             | 2 532              | 93                    | 0                                       | 93                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | \$              | 649               | CAD 923            | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 653             | NZD 6 250          | 10                    | (108)                                   | (98)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 1 573             | SGD 2 007          | 0                     | (22)                                    | (22)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 921               | \$ 649             | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 2 673             | 1 512              | 0                     | (11)                                    | (11)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 8 350             | 1 607              | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 160               | 214                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| BOA          | 07/2026           | NOK             | 14 555            | 1 566              | 95                    | 0                                       | 95                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | \$              | 545               | CHF 440            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 400               | CNH 2 704          | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 14                | € 12               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 577             | ¥ 409 958          | 0                     | (55)                                    | (55)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 708               | KRW 1 078 222      | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 668               | NOK 6 188          | 0                     | (43)                                    | (43)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 850               | PLN 3 208          | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 665               | SGD 861            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 3 845             | \$ 1 292           | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| BPS          | 08/2026           | SGD             | 859               | 665                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 607             | BRL 8 414          | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | INR             | 23 298            | \$ 245             | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 2 016             | MXN 35 633         | 13                    | (3)                                     | 10                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 726               | \$ 500             | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 095             | 212                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 173               | 220                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 4 107             | 607                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNY             | 1 635             | 240                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 9 061             | 10 339             | 0                     | (20)                                    | (20)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 3 166             | 4 236              | 35                    | (2)                                     | 33                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | HUF             | 137 903           | 448                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 50 396 361        | 2 815              | 2                     | (1)                                     | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 486             | 504                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 125 821           | 1 310              | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 512 000           | 3 174              | 24                    | 0                                       | 24                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 300 549           | 197                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 20 680            | 626                | 5                     | (2)                                     | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 677             | BRL 8 746          | 13                    | (1)                                     | 12                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 909             | £ 2 203            | 15                    | 0                                       | 15                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 204             | INR 398 343        | 6                     | (9)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 871               | ¥ 140 615          | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 537               | KRW 823 888        | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 211               | PLN 792            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 73                | TWD 2 301          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 15 628            | \$ 953             | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 132               | 44                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 783               | BRL 3 989          | 0                     | (19)                                    | (19)                | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 492               | ILS 1 453          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 6 275 778         | \$ 345             | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 15 819            | 488                | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 2 125             | IDR 37 554 955     | 2                     | (46)                                    | (44)                | (0,01) |
|              | 09/2026           |                 | 400               | INR 38 024         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 99                | THB 3 255          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 190               | IDR 3 453 136      | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 845             | \$ 624             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 120 742           | 747                | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 6 228             | 3 683              | 140                   | 0                                       | 140                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | TRY             | 2 202             | 46                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 2 239             | CAD 3 090          | 0                     | (61)                                    | (61)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 1 437             | SGD 1 855          | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 504             | TRY 214 281        | 44                    | 0                                       | 44                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 77 183            | \$ 4 752           | 50                    | 0                                       | 50                  | 0,01   |
|              | 08/2026           | \$              | 747               | ¥ 120 425          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 3 452             | \$ 665             | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 4 543             | 5 297              | 103                   | 0                                       | 103                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | \$              | 660               | ¥ 105 004          | 0                     | (14)                                    | (14)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 865             | NZD 5 071          | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 5 071             | \$ 2 869           | 0                     | (20)                                    | (20)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 13 128            | BRL 66 980         | 0                     | (288)                                   | (288)               | (0,04) |
| CBK          | 07/2026           | CAD             | 399               | \$ 281             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 2 174             | 2 535              | 49                    | 0                                       | 49                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 657             | 570                | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 84 062            | 891                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 395             | 150                | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | PLN             | 601               | 165                | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 2 520             | 273                | 12                    | 0                                       | 12                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 370               | BRL 1 930          | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 446               | COP 1 545 267      | 2                     | (2)                                     | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 25 013            | € 21 785           | 0                     | (106)                                   | (106)               | (0,02) |
|              | 07/2026           |                 | 7 604             | £ 5 668            | 0                     | (81)                                    | (81)                | (0,01) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | \$ 671          | HUF 205 246       | \$ 0               | \$ (12)               | \$ (12)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 535             | IDR 9 600 724     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 868             | INR 84 062        | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 99              | KRW 149 351       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 274             | SEK 2 530         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 26              | TWD 824           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 3 254       | \$ 1 134          | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$ 129          | ILS 382           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP 3 310 721   | \$ 3 699          | 106                | 0                     | 106                                     | 0,02                |
|              | 09/2026           | IDR 20 045 271  | 1 110             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 8 697       | 90                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 20 770      | 1 189             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 713         | 210               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 14 718      | 445               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 473          | IDR 8 433 627     | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 394             | MXN 6 821         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP 1 150 583   | \$ 326            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | 433 164         | 120               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 575          | IDR 10 458 644    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 1 169 446   | \$ 65             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 10 931      | 116               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 610         | 164               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 77           | INR 7 451         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 654           | NOK 15 371        | 0                  | (101)                 | (101)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 2 660           | SGD 3 409         | 1                  | (25)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 35 891      | \$ 2 217          | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 1 009       | 782               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 17 005 590  | 944               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 230          | IDR 4 178 688     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 116             | INR 11 005        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 20 116          | MXN 351 103       | 0                  | (150)                 | (150)                                   | (0,02)              |
| FAR          | 09/2026           | 610             | PEN 2 075         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 6 547       | \$ 1 291          | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 3 612       | 534               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 61 832        | 83 147            | 1 081              | 0                     | 1 081                                   | 0,16                |
|              | 07/2026           | INR 7 902       | 84                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 161 263       | 1 015             | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 1 722       | 467               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 14 935      | 11 703            | 157                | (1)                   | 156                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 1 094        | CNH 7 440         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 351             | £ 265             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 83              | INR 7 902         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 272           | ¥ 529 424         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 195           | PLN 4 362         | 0                  | (34)                  | (34)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR 51 130      | \$ 3 098          | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 7 423       | 1 094             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 265           | 351               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | ILS 2 059       | 719               | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 528 039       | 3 272             | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 227          | SGD 293           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 902         | \$ 263            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 40           | INR 3 877         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 1 948       | \$ 377            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 192 278     | 125               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 1 481       | 397               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 557          | BRL 2 809         | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 478           | CAD 7 795         | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 176             | COP 621 340       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 705             | IDR 12 634 141    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 125             | KRW 192 250       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 307           | ZAR 21 580        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 7 784       | \$ 5 478          | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 274        | BRL 6 509         | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 317             | INR 30 444        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 2 675 728   | \$ 728            | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR 12 708 128  | 705               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 113 901     | 6 488             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
| IND JPM      | 09/2026           | THB 52 642      | 1 631             | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$ 2 070        | BRL 10 688        | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 1 193           | IDR 21 410 883    | 2                  | (9)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 150           | INR 110 561       | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 728             | MXN 12 652        | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 639 297     | \$ 176            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 37 229      | 392               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 29 295      | 20 885            | 589                | 0                     | 589                                     | 0,09                |
|              | 07/2026           | CHF 174         | 223               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CN 1 744        | 256               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 4 707       | 1 576             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 19 985      | 212               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 59 416      | 38                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 2 349       | 237               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 1 294       | 738               | 7                  | (5)                   | 2                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| MBC          | 07/2026           | \$              | 5 871             | BRL 30 213         | \$ 0                  | \$ (34)                                 | \$ (34)             | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 806               | CNH 5 444          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 8 353             | £ 6 224            | 0                     | (91)                                    | (91)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 2 026             | HUF 619 587        | 0                     | (36)                                    | (36)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 73                | IDR 1 310 441      | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 907             | ILS 8 231          | 0                     | (144)                                   | (144)               | (0,02) |
|              | 07/2026           |                 | 212               | INR 19 985         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 67                | KRW 102 572        | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 085             | PLN 11 243         | 0                     | (94)                                    | (94)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 259               | THB 8 673          | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 753               | ZAR 12 233         | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 6 018             | \$ 2 076           | 54                    | 0                                       | 54                  | 0,01   |
|              | 08/2026           | \$              | 237               | NOK 2 350          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 317 723         | \$ 73              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | INR             | 165 766           | 1 738              | 1                     | (2)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 92 565            | 5 284              | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 36 000            | 1 106              | 19                    | (3)                                     | 16                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 616               | INR 58 731         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 553               | MXN 9 649          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 10/2026           | BRL             | 30 878            | \$ 5 871           | 34                    | 0                                       | 34                  | 0,01   |
|              | 12/2026           | MXN             | 3 015             | 172                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 122               | 87                 | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 670             | 1 173              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 5 155             | 6 515              | 136                   | (11)                                    | 125                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | COP             | 2 267 298         | 599                | 0                     | (56)                                    | (56)                | (0,01) |
|              | 07/2026           | €               | 21 632            | 25 051             | 319                   | 0                                       | 319                 | 0,05   |
|              | 07/2026           | £               | 685               | 905                | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 173 877           | 10                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 10 974            | 116                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 2 056 690         | 1 357              | 28                    | 0                                       | 28                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 758               | 76                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 25 519            | AUD 36 911         | 98                    | (45)                                    | 53                  | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 600               | BRL 3 114          | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 008             | CHF 799            | 0                     | (17)                                    | (17)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 99 815            | € 86 451           | 67                    | (1 043)                                 | (976)               | (0,14) |
|              | 07/2026           |                 | 2 767             | £ 2 090            | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 179               | INR 17 271         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 616               | ¥ 97 843           | 0                     | (14)                                    | (14)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 940             | NOK 36 530         | 0                     | (248)                                   | (248)               | (0,04) |
|              | 07/2026           |                 | 529               | NZD 930            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 35 056            | \$ 24 174          | 0                     | (99)                                    | (99)                | (0,01) |
|              | 08/2026           | €               | 7 366             | 8 378              | 0                     | (55)                                    | (55)                | (0,01) |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 220             | 408                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 76                | NOK 758            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 27 965            | \$ 838             | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 1 663             | INR 159 283        | 9                     | (1)                                     | 8                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 379               | MXN 6 684          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 101             | THB 35 800         | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00   |
| MYI          | 07/2026           | £               | 169               | \$ 224             | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 39 005            | 4 097              | 155                   | 0                                       | 155                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | PLN             | 164               | 45                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 76                | € 66               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| NSL          | 07/2026           |                 | 18                | £ 13               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 656               | IDR 11 694 444     | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 181               | INR 17 431         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 959               | TRY 45 092         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
| RBC          | 09/2026           | IDR             | 11 760 028        | \$ 656             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 289               | IDR 5 148 910      | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           | SGD             | 544               | \$ 420             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNY             | 3 830             | 561                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 1 651             | 2 206              | 15                    | 0                                       | 15                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 743 628           | 4 651              | 76                    | 0                                       | 76                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | NZD             | 442               | 250                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 6 500             | € 5 696            | 12                    | 0                                       | 12                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 223             | £ 4 639            | 0                     | (66)                                    | (66)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 169               | IDR 3 039 506      | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 238               | INR 22 856         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 789               | 75 618             | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 11 924 014        | \$ 661             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 18 779            | 582                | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
| SOG          | 09/2026           | \$              | 661               | IDR 11 852 786     | 1                     | (5)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 284 645           | \$ 332 050         | 6 616                 | 0                                       | 6 616               | 0,96   |
|              | 07/2026           | \$              | 88                | CAD 125            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 231 729           | € 203 718          | 1 182                 | 0                                       | 1 182               | 0,17   |
|              | 07/2026           |                 | 1 604             | ¥ 254 781          | 0                     | (36)                                    | (36)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 6 899             | SGD 8 935          | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 203 718           | \$ 232 044         | 0                     | (1 180)                                 | (1 180)             | (0,17) |
|              | 08/2026           | SGD             | 8 376             | 6 482              | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
| SSB          | 07/2026           | BRL             | 28 477            | 5 584              | 82                    | 0                                       | 82                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | CAD             | 12 028            | 8 723              | 245                   | 0                                       | 245                 | 0,04   |
|              | 07/2026           | \$              | 603               | BRL 3 065          | 0                     | (11)                                    | (11)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 001             | CAD 1 418          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 60 785            | £ 45 984           | 248                   | 0                                       | 248                 | 0,04   |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| UAG          | 08/2026           | CAD 617         | \$ 436            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 13 896 662  | 3 643             | 0                  | (344)                 | (344)                                   | (0,05)              |
|              | 08/2026           | € 1 117         | 1 275             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 45 984        | 60 784            | 0                  | (247)                 | (247)                                   | (0,04)              |
|              | 09/2026           | PEN 25 292      | 7 374             | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 612         | 167               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 2 169       | 1 672             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 867        | € 3 328           | 0                  | (62)                  | (62)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | COP 30 359 354  | \$ 7 919          | 0                  | (734)                 | (734)                                   | (0,11)              |
|              | 09/2026           | MXN 1 390       | 79                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 2 090       | 64                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 700          | THB 22 922        | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | 4 812           | CHF 3 885         | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 3 871       | \$ 4 812          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 12 728          | \$ (6 327)            | \$ 6 401                                | 0,93                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | € 2 110         | \$ 2 404          | \$ 0               | \$ (9)                | \$ (9)                                  | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$ 225 682      | € 193 716         | 0                  | (4 205)               | (4 205)                                 | (0,61)              |
|              | 07/2026           | € 38 169        | \$ 43 763         | 124                | 0                     | 124                                     | 0,02                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 210 779      | € 180 781         | 0                  | (4 092)               | (4 092)                                 | (0,59)              |
|              | 07/2026           | € 519           | \$ 605            | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 938          | € 804             | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 37 824        | \$ 43 139         | 0                  | (106)                 | (106)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | € 43 197        | € 37 824          | 106                | 0                     | 106                                     | 0,01                |
| JPM          | 07/2026           | € 108 048       | \$ 125 595        | 2 064              | 0                     | 2 064                                   | 0,30                |
| MBC          | 07/2026           | 155 967         | 180 204           | 2 188              | (302)                 | 1 886                                   | 0,27                |
|              | 07/2026           | \$ 87           | € 75              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 4 125         | \$ 4 710          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | \$ 45 793       | € 40 263          | 302                | 0                     | 302                                     | 0,04                |
|              | 07/2026           | € 19 986        | \$ 22 908         | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | € 19 986        | 22 908            | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,01                |
| RYL          | 07/2026           | 146 218         | 169 507           | 2 336              | 0                     | 2 336                                   | 0,34                |
| SCX          | 07/2026           | 40 263          | 45 800            | 0                  | (234)                 | (234)                                   | (0,03)              |
| SOG          | 07/2026           | \$ 225 977      | € 193 716         | 0                  | (4 501)               | (4 501)                                 | (0,65)              |
|              | 08/2026           | 45 862          | 40 263            | 233                | 0                     | 233                                     | 0,03                |
|              |                   |                 |                   | \$ 7 479           | \$ (13 481)           | \$ (6 002)                              | (0,87)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 33 964       | £ 25 299          | \$ 0               | \$ (386)              | \$ (386)                                | (0,06)              |
| BOA          | 07/2026           | £ 69            | \$ 92             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 24 333          | 32 091            | 0                  | (205)                 | (205)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           | \$ 42 362       | £ 31 656          | 25                 | (372)                 | (347)                                   | (0,05)              |
|              | 08/2026           | 32 131          | 24 364            | 206                | 0                     | 206                                     | 0,03                |
| BRC          | 07/2026           | 809             | 612               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 358             | 267               | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £ 53            | \$ 70             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 226        | £ 1 655           | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 70              | 53                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 37 084          | 27 637            | 0                  | (404)                 | (404)                                   | (0,06)              |
| MBC          | 07/2026           | 598             | 448               | 1                  | (4)                   | (3)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 80              | 60                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 5 618         | \$ 7 393          | 0                  | (63)                  | (63)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 7 393        | £ 5 618           | 63                 | 0                     | 63                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 27 570        | \$ 36 491         | 0                  | (101)                 | (101)                                   | (0,01)              |
| SCX          | 07/2026           | \$ 484          | £ 362             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 36 490          | 27 570            | 101                | 0                     | 101                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | £ 27 550        | \$ 36 393         | 0                  | (172)                 | (172)                                   | (0,02)              |
| SSB          | 08/2026           | \$ 36 392       | £ 27 550          | 172                | 0                     | 172                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | £ 2 717         | \$ 3 591          | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 3 591        | £ 2 717           | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 588             | \$ (1 761)            | \$ (1 173)                              | (0,17)              |



## Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 792          | NOK 7 331         | \$ 0               | \$ (51)               | \$ (51)                                 | (0,01)              |
| CBK          | 07/2026           | 792             | 7 332             | 0                  | (51)                  | (51)                                    | (0,01)              |
| JPM          | 07/2026           | NOK 5 564       | \$ 562            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 562          | NOK 5 567         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | NOK 7 149       | \$ 719            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 734          | NOK 6 802         | 0                  | (47)                  | (47)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 719             | 7 152             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | 14              | 128               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3               | \$ (153)              | \$ (150)                                | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 10 618       | SEK 98 200        | \$ 0               | \$ (472)              | \$ (472)                                | (0,07)              |
| CBK          | 07/2026           | 11 601          | 107 196           | 0                  | (525)                 | (525)                                   | (0,07)              |
| FAR          | 07/2026           | SEK 63 215      | \$ 6 515          | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 6 515        | SEK 63 103        | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SEK 95 496      | \$ 9 809          | 0                  | (58)                  | (58)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 11 362       | SEK 105 528       | 0                  | (458)                 | (458)                                   | (0,07)              |
|              | 08/2026           | 9 809           | 95 326            | 58                 | 0                     | 58                                      | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 75              | \$ (1 530)            | \$ (1 455)                              | (0,21)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 3 397        | SGD 4 331         | \$ 0               | \$ (48)               | \$ (48)                                 | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | SGD 1 387       | \$ 1 072          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 551        | SGD 7 089         | 0                  | (71)                  | (71)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 1 072           | 1 384             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SGD 1 073       | \$ 830            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 866        | SGD 4 932         | 0                  | (54)                  | (54)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 830             | 1 071             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 3 501       | \$ 2 700          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 539        | SGD 8 342         | 0                  | (89)                  | (89)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 2 700           | 3 493             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD 757         | \$ 585            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 585          | SGD 755           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 128             | 165               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 17 358      | \$ 13 398         | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 13 398       | SGD 17 318        | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 31              | \$ (292)              | \$ (261)                                | (0,04)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (1 247) (0,18)

| DESCRIPTION                            | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>        |                               |                            |                     |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. |                               |                            |                     |
| 5,125 % échéance 29/10/2022 ^          | \$ 1 400                      | \$ 84                      | 0,01                |
| 5,250 % échéance 23/05/2023 ^ (e)      | 500                           | 30                         | 0,01                |
| Total des Autres actifs financiers     |                               | \$ 114                     | 0,02                |
| Total des Investissements              |                               | \$ 761 679                 | 110,56              |
| Autres actifs et passifs à court terme |                               | \$ (72 781)                | (10,56)             |
| Actif net                              |                               | \$ 688 898                 | 100,00              |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

## (f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,62 %) :

| Description de l'émetteur     | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| Flora Food Management BV      | 7,500 % | 31/10/2030      | 20/01/2026   | \$ 1 056  | \$ 1 027     | 0,15                |
| Ford Credit Canada Co.        | 4,398   | 09/04/2029      | 06/01/2026   | 73        | 71           | 0,01                |
| Grifols S.A.                  | 7,500   | 01/05/2030      | 20/08/2025   | 744       | 733          | 0,11                |
| Project Dorchester            | 4,610   | 04/01/2027      | 10/12/2025   | 582       | 572          | 0,08                |
| RBC International             | 4,660   | 16/12/2028      | 18/11/2025   | 5 000     | 4 918        | 0,71                |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | 4,238   | 15/06/2029      | 05/06/2026   | 3 400     | 3 397        | 0,49                |
|                               |         |                 |              | \$ 10 855 | \$ 10 718    | 1,55                |

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 349 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 25 047 \$ (31 décembre 2025 : 31 362 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 11 620 \$ (31 décembre 2025 : 3 550 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 688 450                                           | \$ 23 691                                         | \$ 712 141        |
| Fonds d'investissement                        | 40 535                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 40 535            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 4 800                                                | 0                                                 | 4 800             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 777                                                                               | 3 312                                                | 0                                                 | 4 089             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 114                                                  | 0                                                 | 114               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 41 312</b>                                                                  | <b>\$ 696 676</b>                                    | <b>\$ 23 691</b>                                  | <b>\$ 761 679</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 1 278 875                                         | \$ 23 392                                         | \$ 1 302 267        |
| Fonds d'investissement                        | 22 744                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 22 744              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 31 700                                               | 0                                                 | 31 700              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (693)                                                                             | 7 043                                                | 9                                                 | 6 359               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 0                                                    | 114                                               | 114                 |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 22 051</b>                                                                  | <b>\$ 1 317 618</b>                                  | <b>\$ 23 515</b>                                  | <b>\$ 1 363 184</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (316)                                                   | \$ 430                  | \$ 114                            | \$ 691                                                     | \$ (560)                | \$ 131                            |
| BOA          | (576)                                                      | 570                     | (6)                               | 635                                                        | (630)                   | 5                                 |
| BPS          | (4 059)                                                    | 4 380                   | 321                               | (160)                                                      | 280                     | 120                               |
| BRC          | 178                                                        | (260)                   | (82)                              | 3 306                                                      | (3 650)                 | (344)                             |
| BSH          | (4 169)                                                    | 4 350                   | 181                               | (345)                                                      | 270                     | (75)                              |
| CBK          | (477)                                                      | 680                     | 203                               | (31)                                                       | 0                       | (31)                              |
| CIB          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| DUB          | (296)                                                      | 410                     | 114                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| FAR          | 1 158                                                      | (1 250)                 | (92)                              | (2 058)                                                    | 2 420                   | 362                               |
| GLM          | (52)                                                       | 70                      | 18                                | 166                                                        | 0                       | 166                               |
| GST          | 9                                                          | 0                       | 9                                 | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| IND          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 6                                                          | 0                       | 6                                 |
| JPM          | 2 755                                                      | (3 090)                 | (335)                             | 312                                                        | (270)                   | 42                                |
| MBC          | 715                                                        | (750)                   | (35)                              | 2 503                                                      | (2 720)                 | (217)                             |
| MYI          | 211                                                        | (250)                   | (39)                              | (71)                                                       | (70)                    | (141)                             |
| NSL          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 405                                                        | (310)                   | 95                                |
| RYL          | 57                                                         | 0                       | 57                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 2 383                                                      | (2 570)                 | (187)                             | 37                                                         | 0                       | 37                                |
| SOG          | 2 081                                                      | (2 140)                 | (59)                              | (564)                                                      | 580                     | 16                                |
| SSB          | (53)                                                       | 0                       | (53)                              | 59                                                         | 0                       | 59                                |
| UAG          | (801)                                                      | 730                     | (71)                              | (51)                                                       | 0                       | (51)                              |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 35,14            | 59,54                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 32,02            | 27,50                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,10             | 1,10                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,88             | 1,54                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,46             | 2,15                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,20             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,68             | 0,36                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 2,18             | 0,95                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,01             | 0,01                 |
| Autres actifs                                                    | 24,33            | 6,84                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\*Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 1,47             | 0,43                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 58,28            | 72,14                |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 16,00            | 8,85                 |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | S/O              | 0,27                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 8,61             | 1,78                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 7,80             | 1,01                 |
| Émissions souveraines                                                                                    | 10,96            | 12,80                |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,25             | 0,62                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 5,88             | 1,71                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 0,70             | 2,38                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,23             | (0,12)               |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,06)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,06             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,55             | 0,23                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit                                                           | S/O              | (0,01)               |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | (0,07)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,27             | 0,08                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,93             | (0,62)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,31)           | 0,90                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,02             | 0,01                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (10,56)          | (2,47)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES              |                                     |                                  |                           |                                                 |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS |                                     |                                  |                           |                                                 |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     |                                  |                           |
| Altice France S.A.              |                                     |                                  |                           | CaixaBank S.A.                                  |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                                     |                                     |                                  |                           |
| 8,735 % éch. - 8,736 % éch.     |                                     |                                  |                           | 4,818 % éch. 22/04/2032                         | \$ 4 800                            | \$ 4 762                         | 0,06                      | 4,408 % éch. 23/04/2030                                  | \$ 28 900                           | \$ 28 658                        | 0,34                      |
| 30/10/2028                      | \$ 2 458                            | \$ 2 459                         | 0,03                      | 6,208 % éch. 18/01/2029                         | 10 100                              | 10 336                           | 0,12                      | Lloyds Banking Group PLC                                 |                                     |                                  |                           |
| 9,048 % éch. 14/05/2029         | 3 314                               | 3 329                            | 0,04                      | 6,684 % éch. 13/09/2027                         | 7 300                               | 7 331                            | 0,09                      | 3,574 % éch. 07/11/2028                                  | 5 000                               | 4 935                            | 0,06                      |
| 10,548 % éch. 31/05/2031        | 16 475                              | 16 854                           | 0,20                      | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF |                                     |                                  |                           | 5,462 % éch. 05/01/2028                                  | 1 300                               | 1 307                            | 0,02                      |
| Discovery Global Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 28/05/2031                         | € 7 200                             | 8 268                            | 0,10                      | Lower Ferry Re Ltd.                                      |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 03/06/2033         | 22 852                              | 22 887                           | 0,27                      | CI Financial Corp.                              |                                     |                                  |                           | 9,014 % éch. 08/07/2030                                  | 900                                 | 900                              | 0,01                      |
| FPS Finance Co. LLC             |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 12/12/2031                         | 5 300                               | 6 143                            | 0,07                      | LPL Holdings, Inc.                                       |                                     |                                  |                           |
| 6,590 % éch. 26/05/2028         | 800                                 | 800                              | 0,01                      | Citadel Finance LLC                             |                                     |                                  |                           | 5,700 % éch. 20/05/2027                                  | 4 100                               | 4 132                            | 0,05                      |
| iHeartCommunications, Inc.      |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 14/02/2029                         | \$ 11 300                           | 11 125                           | 0,13                      | Marex Group PLC                                          |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 01/05/2029           | 0                                   | 0                                | 0,00                      | CoStar Group, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 5,680 % éch. 21/04/2031                                  | 6 200                               | 6 205                            | 0,07                      |
| Jane Street Group LLC           |                                     |                                  |                           | 2,800 % éch. 15/07/2030                         | 34 220                              | 30 798                           | 0,36                      | 5,829 % éch. 08/05/2028                                  | 1 700                               | 1 712                            | 0,02                      |
| 5,666 % éch. 15/12/2031         | 794                                 | 787                              | 0,01                      | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.    |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley                                           |                                     |                                  |                           |
| Lealand Finance Co. BV          |                                     |                                  |                           | 10,100 % éch. 15/12/2043                        | PEN 492                             | 159                              | 0,00                      | 3,485 % éch. 11/06/2030                                  | € 8 600                             | 9 887                            | 0,12                      |
| 3,000 % - 4,758 % éch.          |                                     |                                  |                           | Credit Agricole Opportunities Partners          |                                     |                                  |                           | 4,555 % éch. 10/04/2030                                  | \$ 14 600                           | 14 509                           | 0,17                      |
| 31/12/2027                      | 28                                  | 27                               | 0,00                      | 6,520 % éch. 20/03/2028 (h)                     | \$ 6 200                            | 6 193                            | 0,07                      | National Securities Clearing Corp.                       |                                     |                                  |                           |
| 6,758 % éch. 30/06/2027         | 8                                   | 8                                | 0,00                      | Credit Agricole S.A.                            |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 09/06/2028                                  | 7 900                               | 7 895                            | 0,09                      |
| Mercury Aggregator LP           |                                     |                                  |                           | 4,631 % éch. 11/09/2028                         | 700                                 | 700                              | 0,01                      | Nationwide Building Society                              |                                     |                                  |                           |
| TBD % éch. 03/04/2027           | 152                                 | 0                                | 0,00                      | 4,848 % éch. 11/09/2028                         | 1 400                               | 1 409                            | 0,02                      | 6,557 % éch. 18/10/2027                                  | 14 000                              | 14 080                           | 0,17                      |
| Poseidon Bidco SASU             |                                     |                                  |                           | 6,316 % éch. 03/10/2029                         | 5 900                               | 6 093                            | 0,07                      | NatWest Group PLC                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,504 % éch. 13/03/2030         | € 1 600                             | 531                              | 0,01                      | Deutsche Bank AG                                |                                     |                                  |                           | 4,445 % éch. 08/05/2030                                  | 1 200                               | 1 189                            | 0,01                      |
| Project Dorchester              |                                     |                                  |                           | 2,552 % éch. 07/01/2028                         | 4 500                               | 4 456                            | 0,05                      | 4,892 % éch. 18/05/2029                                  | 4 500                               | 4 513                            | 0,05                      |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (h)     | 1 600                               | 1 829                            | 0,02                      | 2,789 % éch. 18/08/2027                         | € 14 200                            | 16 240                           | 0,19                      | 5,076 % éch. 27/01/2030                                  | 8 600                               | 8 657                            | 0,10                      |
| République du Panama            |                                     |                                  |                           | 5,706 % éch. 08/02/2028                         | \$ 4 800                            | 4 835                            | 0,06                      | 5,516 % éch. 30/09/2028                                  | 700                                 | 708                              | 0,01                      |
| 4,979 % éch. 01/04/2027         | 8 100                               | 9 323                            | 0,11                      | 6,720 % éch. 18/01/2029                         | 200                                 | 206                              | 0,00                      | 5,583 % éch. 01/03/2028                                  | 2 700                               | 2 720                            | 0,03                      |
| Subcalidora                     |                                     |                                  |                           | 6,819 % éch. 20/11/2029                         | 5 700                               | 5 963                            | 0,07                      | 5,808 % éch. 13/09/2029                                  | 2 000                               | 2 044                            | 0,02                      |
| 8,041 % éch. 14/08/2029         | 1 800                               | 2 047                            | 0,02                      | Emirates NBD Bank PJSC                          |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                          |                                     |                                  |                           |
| Syniverse Holdings, Inc.        |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 29/06/2031                         | 36 600                              | 36 600                           | 0,43                      | 1,850 % éch. 16/09/2026                                  | 4 800                               | 4 758                            | 0,06                      |
| 10,732 % éch. 13/05/2027        | \$ 1 570                            | 1 369                            | 0,02                      | EPR Properties                                  |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 13/09/2027                                  | 1 036                               | 1 033                            | 0,01                      |
| TransDigm, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/06/2027                         | 300                                 | 299                              | 0,00                      | 5,625 % éch. 29/09/2028                                  | 800                                 | 799                              | 0,01                      |
| 6,144 % éch. 28/02/2031         | 11 188                              | 11 202                           | 0,13                      | 4,750 % éch. 15/12/2026                         | 8                                   | 8                                | 0,00                      | 5,688 % éch. 13/09/2027                                  | 5 500                               | 5 472                            | 0,06                      |
| U.S. Renal Care, Inc.           |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 15/04/2028                         | 34                                  | 34                               | 0,00                      | 6,125 % éch. 30/09/2030                                  | 1 200                               | 1 181                            | 0,01                      |
| 8,758 % éch. 28/06/2028         | 242                                 | 239                              | 0,00                      | Equinix, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | Nomura Holdings, Inc.                                    |                                     |                                  |                           |
| Westmoreland Coal Co.           |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 18/11/2026                         | 100                                 | 99                               | 0,00                      | 4,996 % éch. 29/06/2029                                  | 3 300                               | 3 308                            | 0,04                      |
| 8,000 % éch. 15/03/2029         | 4                                   | 2                                | 0,00                      | Ford Motor Credit Co. LLC                       |                                     |                                  |                           | Omega Healthcare Investors, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 16/02/2028                         | 2 100                               | 2 029                            | 0,02                      | 5,200 % éch. 01/07/2030                                  | 5 000                               | 5 026                            | 0,06                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,815 % éch. 02/11/2027                         | 1 700                               | 1 675                            | 0,02                      | OnellMain Finance Corp.                                  |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 17/08/2027                         | 4 900                               | 4 858                            | 0,06                      | 6,625 % éch. 15/01/2028                                  | 11 900                              | 12 082                           | 0,14                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,271 % éch. 09/01/2027                         | 6 500                               | 6 482                            | 0,08                      | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC           |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,078 % éch. 05/11/2026                         | 2 500                               | 2 505                            | 0,03                      | 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                              | 9 100                               | 7 413                            | 0,09                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 05/11/2026                         | 5 300                               | 5 307                            | 0,06                      | Principal Life Global Funding                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,850 % éch. 17/05/2027                         | 2 200                               | 2 217                            | 0,03                      | 4,950 % éch. 27/11/2029                                  | 6 900                               | 6 927                            | 0,08                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 04/11/2027                         | 3 700                               | 3 803                            | 0,04                      | Royal Bank of Canada                                     |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | GA Global Funding Trust                         |                                     |                                  |                           | 4,510 % éch. 18/10/2027                                  | 1 900                               | 1 900                            | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 13/01/2030                         | 6 700                               | 6 727                            | 0,08                      | Santander Holdings USA, Inc.                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Gacii First Investment Co.                      |                                     |                                  |                           | 5,247 % éch. 20/03/2029                                  | 2 000                               | 2 021                            | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 14/05/2029                         | 52 100                              | 51 937                           | 0,61                      | 5,473 % éch. 20/03/2029                                  | 2 200                               | 2 222                            | 0,03                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                      |                                     |                                  |                           | Santanderzz UK Group Holdings PLC                        |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,617 % éch. 30/06/2032                         | AUD 23 200                          | 16 143                           | 0,19                      | 3,823 % éch. 03/11/2028                                  | 740                                 | 732                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Genpact UK Finco PLC                            |                                     |                                  |                           | 4,320 % éch. 22/09/2029                                  | 4 100                               | 4 058                            | 0,05                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 18/11/2030                         | \$ 8 000                            | 7 880                            | 0,09                      | 5,694 % éch. 15/04/2031                                  | 3 200                               | 3 283                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | GLP Capital LP                                  |                                     |                                  |                           | SBA Tower Trust                                          |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/01/2030                         | 100                                 | 96                               | 0,00                      | 4,831 % éch. 15/10/2054                                  | 2 500                               | 2 501                            | 0,03                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/01/2031                         | 300                                 | 283                              | 0,00                      | SLM Student Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/01/2029                         | 14 688                              | 14 766                           | 0,17                      | 2,951 % éch. 15/12/2033                                  | € 1 846                             | 1 999                            | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 01/06/2028                         | 500                                 | 506                              | 0,01                      | Société Générale S.A.                                    |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/12/2033                         | 300                                 | 318                              | 0,00                      | 4,857 % éch. 07/07/2029 (a)                              | \$ 7 500                            | 7 499                            | 0,09                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Bank USA                          |                                     |                                  |                           | SRC Sukuk Ltd.                                           |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,656 % éch. 03/06/2029                         | 17 600                              | 17 614                           | 0,21                      | 4,375 % éch. 02/04/2029                                  | 12 000                              | 11 856                           | 0,14                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Starwood Property Trust, Inc.                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,148 % éch. 21/01/2029                         | 4 500                               | 4 462                            | 0,05                      | 5,250 % éch. 15/10/2028                                  | 1 900                               | 1 892                            | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.             |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/01/2031                                  | 8 600                               | 8 557                            | 0,10                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 03/05/2030                         | € 5 000                             | 5 877                            | 0,07                      | 6,125 % éch. 01/06/2031                                  | 5 800                               | 5 834                            | 0,07                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | GSG Bidco Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | Stellantis Finance U.S., Inc.                            |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/06/2031                         | 8 400                               | 9 526                            | 0,11                      | 5,350 % éch. 17/03/2028                                  | 3 105                               | 3 114                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                               |                                     |                                  |                           | Synchrony Financial                                      |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,041 % éch. 13/03/2028                         | \$ 3 100                            | 3 089                            | 0,04                      | 5,019 % éch. 29/07/2029                                  | 3 800                               | 3 804                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,887 % éch. 14/08/2027                         | 200                                 | 200                              | 0,00                      | Titanium Bondco SARL (6,250 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | Intesa Sanpaolo SpA                             |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 14/01/2031 (b)                              | € 9 089                             | 1 521                            | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 23/09/2029                         | 5 100                               | 4 986                            | 0,06                      | Toronto-Dominion Bank                                    |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 29/06/2030                         | 5 300                               | 5 307                            | 0,06                      | 4,361 % éch. 23/04/2029                                  | \$ 14 800                           | 14 724                           | 0,17                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 28/11/2033                         | 700                                 | 788                              | 0,01                      | 5,376 % éch. 21/10/2027                                  | CAD 1 300                           | 943                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Iridium Capital PLC                             |                                     |                                  |                           | UBS AG                                                   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 18/06/2029                         | € 2 200                             | 2 733                            | 0,03                      | 4,678 % éch. 29/11/2030                                  | \$ 11 500                           | 11 482                           | 0,13                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Jackson National Life Global Funding            |                                     |                                  |                           | UBS Group AG                                             |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,603 % éch. 14/01/2028                         | \$ 2 200                            | 2 198                            | 0,03                      | 4,194 % éch. 01/04/2031                                  | 4 100                               | 4 003                            | 0,05                      |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

|                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| DESCRIPTION             |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION                            |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION                             |                                     |                                  |                           |
| 4,214 % éch. 10/04/2030 | \$ 27 300                           | \$ 26 855                        | 0,32                      | DISH DBS Corp.                         |                                     |                                  |                           | United Airlines Pass-Through Trust      |                                     |                                  |                           |
| 6,246 % éch. 22/09/2029 | 16 600                              | 17 123                           | 0,20                      | 5,250 % éch. 01/12/2026                | \$ 29 790                           | \$ 29 490                        | 0,35                      | 2,700 % éch. 01/11/2033                 | \$ 282                              | \$ 258                           | 0,00                      |
| 6,327 % éch. 22/12/2027 | 3 100                               | 3 126                            | 0,04                      | 5,750 % éch. 01/12/2028                | 4 520                               | 4 382                            | 0,05                      | 3,100 % éch. 07/01/2030                 | 1 544                               | 1 513                            | 0,02                      |
| VICI Properties LP      |                                     |                                  |                           | Enbridge, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/09/2031                 | 310                                 | 300                              | 0,00                      |
| 3,750 % éch. 15/02/2027 | 8 800                               | 8 746                            | 0,10                      | 4,200 % éch. 20/11/2028                | 6 500                               | 6 443                            | 0,08                      | 4,150 % éch. 25/02/2033                 | 428                                 | 416                              | 0,01                      |
| 3,875 % éch. 15/02/2029 | 7 100                               | 6 900                            | 0,08                      | Energy Transfer LP                     |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/04/2029                 | 2 863                               | 2 898                            | 0,03                      |
| 4,500 % éch. 15/01/2028 | 4 325                               | 4 297                            | 0,05                      | 6,050 % éch. 01/12/2026                | 7 300                               | 7 347                            | 0,09                      | Venture Global Calcasieu Pass LLC       |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 01/12/2029 | 4 900                               | 4 811                            | 0,06                      | Flora Food Management BV               |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/08/2029                 | 300                                 | 286                              | 0,00                      |
| 4,750 % éch. 01/04/2028 | 2 600                               | 2 599                            | 0,03                      | 6,875 % éch. 02/07/2029                | € 1 600                             | 1 789                            | 0,02                      | Venture Global LNG, Inc.                |                                     |                                  |                           |
| Wells Fargo & Co.       |                                     |                                  |                           | Flutter Treasury DAC                   |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 01/02/2029                 | 13 100                              | 14 106                           | 0,17                      |
| 0,000 % éch. 23/07/2029 | € 3 000                             | 3 402                            | 0,04                      | 5,000 % éch. 29/04/2029                | 10 000                              | 11 693                           | 0,14                      | 9,875 % éch. 01/02/2032                 | 200                                 | 214                              | 0,00                      |
|                         |                                     | 792 681                          | 9,31                      | 6,125 % éch. 04/06/2031                | £ 4 600                             | 6 102                            | 0,07                      | Volkswagen Group of America Finance LLC |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | FMC Corp.                              |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 11/09/2028                 | 1 800                               | 1 790                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/06/2031                | \$ 900                              | 937                              | 0,01                      | Windstream Services LLC                 |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Gartner, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 01/10/2031                 | 5 900                               | 6 225                            | 0,07                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 20/03/2031                | 10 400                              | 10 115                           | 0,12                      |                                         | 524 482                             | 6,16                             |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Imperial Brands Finance PLC            |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 26/07/2026                | € 200                               | 200                              | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 02/08/2033                | € 6 800                             | 7 711                            | 0,09                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | JetBlue Pass-Through Trust             |                                     |                                  |                           | Edison International                    |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/05/2034                | \$ 2 112                            | 2 006                            | 0,02                      | 5,000 % éch. 05/05/2028                 | 3 500                               | 3 505                            | 0,04                      |
|                         |                                     |                                  |                           | JT International Financial Services BV |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/06/2027                 | 1 277                               | 1 285                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 11/04/2034                | € 4 200                             | 4 748                            | 0,06                      | 6,250 % éch. 15/03/2030                 | 900                                 | 925                              | 0,01                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Maple Parent Holdings Corp.            |                                     |                                  |                           | ENEL Finance International NV           |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 3,495 % éch. 26/03/2028                | 7 500                               | 8 613                            | 0,10                      | 2,125 % éch. 12/07/2028                 | 2 000                               | 1 904                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Mitchells & Butlers Finance PLC        |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 30/09/2028                 | 4 900                               | 4 842                            | 0,06                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 6,013 % éch. 15/12/2030                | £ 19                                | 25                               | 0,00                      | 4,375 % éch. 30/09/2030                 | 9 400                               | 9 237                            | 0,11                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Motorola Solutions, Inc.               |                                     |                                  |                           | NorthWestern Corp.                      |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 15/11/2030                | \$ 4 383                            | 3 955                            | 0,05                      | 5,073 % éch. 21/03/2030                 | 5 200                               | 5 252                            | 0,06                      |
|                         |                                     |                                  |                           | MPLX LP                                |                                     |                                  |                           | Pacific Gas & Electric Co.              |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 15/02/2031                | 2 300                               | 2 292                            | 0,03                      | 2,100 % éch. 01/08/2027                 | 16 720                              | 16 284                           | 0,19                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Co. Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/02/2031                 | 2 200                               | 1 975                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,345 % éch. 17/09/2027                | 6 500                               | 6 398                            | 0,08                      | 3,300 % éch. 15/03/2027                 | 773                                 | 766                              | 0,01                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,810 % éch. 17/09/2030                | 300                                 | 280                              | 0,00                      | 3,300 % éch. 01/12/2027                 | 20 052                              | 19 681                           | 0,23                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 17/07/2030                | 1 700                               | 1 754                            | 0,02                      | 3,750 % éch. 01/07/2028                 | 1 459                               | 1 434                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | NPC Ukrenerg                           |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 01/03/2029                 | 200                                 | 197                              | 0,00                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 09/11/2028                | 200                                 | 195                              | 0,00                      | 4,550 % éch. 01/07/2030                 | 1 917                               | 1 888                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | NTT Finance Corp.                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 04/06/2028                 | 6 700                               | 6 738                            | 0,08                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,741 % éch. 31/03/2028 (a)            | 2 000                               | 2 001                            | 0,02                      | 5,050 % éch. 15/11/2031                 | 13 000                              | 12 991                           | 0,15                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,828 % éch. 01/11/2029 (a)            | 1 900                               | 1 899                            | 0,02                      | 5,450 % éch. 15/06/2027                 | 3 720                               | 3 749                            | 0,04                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,876 % éch. 16/07/2030                | 5 600                               | 5 589                            | 0,07                      | 5,550 % éch. 15/05/2029                 | 3 200                               | 3 267                            | 0,04                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Petroleos de Venezuela S.A.            |                                     |                                  |                           | 6,100 % éch. 15/01/2029                 | 7 000                               | 7 209                            | 0,09                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 16/05/2024 ^              | 220                                 | 83                               | 0,00                      | Pinnacle West Capital Corp.             |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Petroleos Mexicanos                    |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 01/06/2029                 | 5 500                               | 5 502                            | 0,07                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 28/01/2031                | 2 800                               | 2 769                            | 0,03                      | Rio Oil Finance Trust                   |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 6,700 % éch. 16/02/2032                | 1 731                               | 1 747                            | 0,02                      | 8,200 % éch. 06/04/2028                 | 441                                 | 453                              | 0,01                      |
|                         |                                     |                                  |                           | QatarEnergy                            |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 06/01/2027                 | 117                                 | 119                              | 0,00                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 23/06/2029                | 11 700                              | 11 629                           | 0,14                      | Southern California Edison Co.          |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC         |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 01/06/2027                 | 3 035                               | 3 035                            | 0,04                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                | 101 064                             | 100 785                          | 1,19                      | 4,950 % éch. 15/09/2031                 | 2 900                               | 2 894                            | 0,03                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Repsol E&P Capital Markets U.S. LLC    |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/03/2030                 | 3 400                               | 3 439                            | 0,04                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 5,204 % éch. 16/09/2030                | 500                                 | 503                              | 0,01                      | 5,850 % éch. 01/11/2027                 | 9 800                               | 9 948                            | 0,12                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Robert Bosch Finance LLC               |                                     |                                  |                           | Sprint Capital Corp.                    |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 21/05/2029                | € 6 200                             | 7 104                            | 0,08                      | 6,875 % éch. 15/11/2028                 | 5 000                               | 5 239                            | 0,06                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Rogers Communications, Inc.            |                                     |                                  |                           | SW Finance PLC                          |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 31/03/2027                | CAD 2 000                           | 1 415                            | 0,02                      | 1,625 % éch. 30/03/2027                 | £ 13 303                            | 17 198                           | 0,20                      |
|                         |                                     |                                  |                           | Rolls-Royce PLC                        |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 31/10/2031                 | 8 200                               | 11 301                           | 0,13                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/10/2027                | \$ 7 000                            | 7 088                            | 0,08                      | Uniti Group LP                          |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | SoftBank Group Corp.                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/02/2029                 | \$ 1 775                            | 1 762                            | 0,02                      |
|                         |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch. 22/10/2029                | 5 800                               | 5 960                            | 0,07                      |                                         | 164 019                             | 1,93                             |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Spirit Airlines Pass-Through Trust     |                                     |                                  |                           | Total des Obligations et billets privés |                                     | 1 481 182                        | 17,40                     |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,100 % éch. 01/10/2029                | 327                                 | 317                              | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | TD SYNEX Corp.                         |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,300 % éch. 17/01/2029                | 4 900                               | 4 840                            | 0,06                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Tennessee Gas Pipeline Co. LLC         |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 2,900 % éch. 01/03/2030                | 1 900                               | 1 781                            | 0,02                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Thames Water Super Senior Issuer PLC   |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 10/10/2027                | £ 134                               | 189                              | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Topaz Solar Farms LLC                  |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 30/09/2039                | \$ 30                               | 26                               | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 30/09/2039                | 164                                 | 162                              | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | U.S. Renal Care, Inc.                  |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 10,625 % éch. 28/06/2028               | 14                                  | 13                               | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | Ubisoft Entertainment S.A.             |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           | 0,878 % éch. 24/11/2027                | € 19 200                            | 19 425                           | 0,23                      |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |
|                         |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,661 % éch. 20/03/2066                                        | \$ 390                              | \$ 392                           | 0,00                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR<br/>DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | Harvest Funding PLC                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 20/07/2053 -<br>20/08/2053                        | 16 114                              | 16 311                           | 0,19                      | 20 Times Square Trust                                                                              |                                     |                                  |                           | 4,643 % éch. 15/11/2069                                                 | £ 31 700                            | \$ 42 080                        | 0,49                      |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | 3,203 % éch. 15/05/2035                                                                            | \$ 3 800                            | \$ 3 587                         | 0,04                      | Hawksmoor Mortgage Funding PLC                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/07/2056                                        | 900                                 | 769                              | 0,01                      | 280 Park Avenue Mortgage Trust                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,587 % éch. 25/02/2057                                                 | 28 000                              | 37 208                           | 0,44                      |
| 3,000 % éch. 01/07/2056                                        | 3 500                               | 3 107                            | 0,04                      | 4,992 % éch. 15/09/2034                                                                            | 9 300                               | 9 278                            | 0,11                      | HomeBanc Mortgage Trust                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/07/2056                                        | 5 000                               | 4 491                            | 0,05                      | AFG Trust                                                                                          |                                     |                                  |                           | 4,383 % éch. 25/03/2035                                                 | \$ 1 510                            | 1 242                            | 0,01                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 5 000                               | 4 649                            | 0,06                      | 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                            | AUD 44 400                          | 30 680                           | 0,36                      | 4,573 % éch. 25/10/2035                                                 | 100                                 | 98                               | 0,00                      |
| 4,500 % éch. 01/08/2056                                        | 14 400                              | 13 821                           | 0,16                      | Aran Funding DAC                                                                                   |                                     |                                  |                           | HSI Asset Securitization Corp. Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 45 200                              | 44 526                           | 0,52                      | 3,379 % éch. 24/12/2065                                                                            | € 16 937                            | 19 395                           | 0,23                      | 4,483 % éch. 25/08/2035                                                 | 264                                 | 253                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/07/2056                                        | 6 850                               | 6 885                            | 0,08                      | Atlas Funding PLC                                                                                  |                                     |                                  |                           | JPMorgan Alternative Loan Trust                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 120 000                             | 122 235                          | 1,44                      | 4,563 % éch. 20/01/2068                                                                            | £ 20 000                            | 26 597                           | 0,31                      | 4,363 % éch. 25/03/2036                                                 | 1 948                               | 1 668                            | 0,02                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 118 900                             | 123 126                          | 1,45                      | Avon Finance PLC                                                                                   |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust                     | 2 509                               | 2 424                            | 0,03                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      | 68                                  | 63                               | 0,00                      | 4,646 % éch. 28/12/2049                                                                            | 5 170                               | 6 865                            | 0,08                      | 5,973 % éch. 15/02/2035                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/11/2047                                        |                                     |                                  |                           | Banc of America Funding Trust                                                                      |                                     |                                  |                           | Jubilee Place BV                                                        | € 7 018                             | 8 033                            | 0,09                      |
| 4,000 % éch. 01/11/2042 -<br>01/03/2049                        | 1 187                               | 1 140                            | 0,01                      | 4,114 % éch. 20/10/2036                                                                            | \$ 5 817                            | 1 829                            | 0,02                      | Jupiter Mortgage PLC                                                    |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/10/2054 -<br>01/05/2056                        | 290 273                             | 286 005                          | 3,36                      | Banc of America Merrill Lynch Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 6,747 % éch. 20/07/2055                                                 | £ 2 500                             | 3 303                            | 0,04                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 4,325 % éch. 15/08/2046                                                                            | 680                                 | 614                              | 0,01                      | La Trobe Financial Capital Markets Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/08/2056                                        | 23 300                              | 19 465                           | 0,23                      | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust                                                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/08/2057                                                 | AUD 18 821                          | 13 034                           | 0,15                      |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 20 350                              | 17 736                           | 0,21                      | 3,966 % éch. 10/08/2033                                                                            | 624                                 | 584                              | 0,01                      | 5,050 % éch. 15/05/2057                                                 | 615                                 | 426                              | 0,01                      |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 68 950                              | 62 515                           | 0,74                      | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                           |                                     |                                  |                           | 5,167 % éch. 13/11/2057                                                 | 16 900                              | 11 710                           | 0,14                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/09/2056                        | 447 450                             | 417 924                          | 4,91                      | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                                                       |                                     |                                  |                           | 5,507 % éch. 13/11/2057                                                 | 24 200                              | 16 777                           | 0,20                      |
| 4,500 % éch. 01/08/2056                                        | 321 560                             | 307 806                          | 3,62                      | 4,495 % éch. 25/09/2035                                                                            | 2 090                               | 674                              | 0,01                      | Landmark Mortgage Securities PLC                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 745 020                             | 731 297                          | 8,59                      | 4,750 % éch. 26/01/2036                                                                            | 3 146                               | 2 196                            | 0,03                      | 2,757 % éch. 17/06/2038                                                 | € 565                               | 641                              | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 660 400                             | 661 640                          | 7,78                      | Benchmark Mortgage Trust                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,066 % éch. 17/06/2039                                                 | £ 3 610                             | 4 747                            | 0,06                      |
| 6,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/09/2056                        | 880 930                             | 897 011                          | 10,54                     | 4,203 % éch. 10/10/2051                                                                            | 3 054                               | 3 049                            | 0,04                      | 4,146 % éch. 17/04/2044                                                 | 1 635                               | 2 138                            | 0,03                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                        | 1 051 300                           | 1 086 768                        | 12,77                     | Blackwattle RMBS Trust                                                                             |                                     |                                  |                           | Lehman Mortgage Trust                                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 01/08/2056                                        | 10 700                              | 11 246                           | 0,13                      | 5,050 % éch. 12/02/2058 (a)                                                                        | AUD 23 300                          | 16 142                           | 0,19                      | 6,000 % éch. 25/07/2036                                                 | \$ 127                              | 58                               | 0,00                      |
|                                                                |                                     | 4 910 451                        | 57,70                     | Bletchley Park Funding PLC                                                                         |                                     |                                  |                           | Lehman XS Trust                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,604 % éch. 27/07/2070                                                                            | £ 1 387                             | 1 844                            | 0,02                      | 4,163 % éch. 25/08/2046                                                 | 4 740                               | 4 693                            | 0,06                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Brants Bridge PLC                                                                                  |                                     |                                  |                           | Liberty Trust                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,647 % éch. 14/06/2066                                                                            | 1 411                               | 1 875                            | 0,02                      | 5,012 % éch. 10/10/2058                                                 | AUD 15 669                          | 10 852                           | 0,13                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | ChaseFlex Trust                                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,305 % éch. 25/04/2058                                                 | 18 124                              | 12 570                           | 0,15                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,443 % éch. 25/05/2037                                                                            | \$ 9                                | 8                                | 0,00                      | Luminent Mortgage Trust                                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates                                               |                                     |                                  |                           | 4,296 % éch. 25/04/2036                                                 | \$ 2 878                            | 1 842                            | 0,02                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,855 % éch. 25/08/2035                                                                            | 687                                 | 574                              | 0,01                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Commercial Mortgage Trust                                                                          |                                     |                                  |                           | 4,453 % éch. 25/08/2036                                                 | 1 178                               | 1 185                            | 0,01                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,921 % éch. 15/09/2033                                                                            | 2 800                               | 2 655                            | 0,03                      | Merrion Square Residential DAC                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Countrywide Alternative Loan Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | 3,378 % éch. 24/03/2081                                                 | € 15 245                            | 17 487                           | 0,21                      |
| Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           | 4,174 % éch. 20/03/2046                                                                            | 8                                   | 7                                | 0,00                      | MortgageIT Trust                                                        |                                     |                                  |                           |
| 2,875 % éch. 15/05/2049                                        | 4 900                               | 3 481                            | 0,04                      | 4,223 % éch. 25/03/2036                                                                            | 29                                  | 28                               | 0,00                      | 4,283 % éch. 25/12/2035                                                 | \$ 8                                | 8                                | 0,00                      |
| 4,625 % éch. 15/11/2045                                        | 9 634                               | 9 254                            | 0,11                      | 4,263 % éch. 25/12/2046                                                                            | 1 377                               | 1 199                            | 0,01                      | Natixis Commercial Mortgage Securities Trust                            |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/02/2046                                        | 4 900                               | 4 705                            | 0,06                      | 4,323 % éch. 25/08/2035                                                                            | 279                                 | 273                              | 0,00                      | 3,858 % éch. 10/04/2037                                                 | 480                                 | 460                              | 0,01                      |
| 4,625 % éch. 15/05/2054                                        | 36 600                              | 34 766                           | 0,41                      | 4,323 % éch. 25/02/2037                                                                            | 2 925                               | 2 447                            | 0,03                      | Newgate Funding PLC                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/02/2056                                        | 25 850                              | 25 117                           | 0,29                      | 4,490 % éch. 25/08/2035                                                                            | 632                                 | 572                              | 0,01                      | 3,001 % éch. 15/12/2050                                                 | € 162                               | 184                              | 0,00                      |
| 4,875 % éch. 15/08/2045                                        | 1 751                               | 1 738                            | 0,02                      | 5,244 % éch. 25/11/2035                                                                            | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,026 % éch. 15/12/2050                                                 | £ 3 849                             | 5 028                            | 0,06                      |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f)     |                                     |                                  |                           | 5,784 % éch. 25/11/2035                                                                            | 3                                   | 3                                | 0,00                      | Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 0,125 % éch. 15/10/2026                                        | 18 032                              | 17 935                           | 0,21                      | 6,250 % éch. 25/04/2037                                                                            | 1 469                               | 637                              | 0,01                      | 4,513 % éch. 25/11/2035                                                 | \$ 1 180                            | 1 170                            | 0,01                      |
| 0,125 % éch. 15/01/2031                                        | 256                                 | 236                              | 0,00                      | 6,250 % éch. 25/08/2037                                                                            | 197                                 | 86                               | 0,00                      | Pepper Prime Trust                                                      |                                     |                                  |                           |
| 0,125 % éch. 15/07/2031                                        | 248                                 | 228                              | 0,00                      | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust                                                     |                                     |                                  |                           | 4,999 % éch. 12/04/2067                                                 | AUD 1 072                           | 743                              | 0,01                      |
| 0,250 % éch. 15/07/2029                                        | 5 469                               | 5 218                            | 0,06                      | 4,103 % éch. 25/06/2035                                                                            | 68                                  | 67                               | 0,00                      | PHH Alternative Mortgage Trust                                          |                                     |                                  |                           |
| 0,250 % éch. 15/02/2050                                        | 1 424                               | 803                              | 0,01                      | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                                        |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/02/2037                                                 | \$ 2 522                            | 2 112                            | 0,02                      |
| 0,375 % éch. 15/01/2027                                        | 244                                 | 241                              | 0,00                      | 5,594 % éch. 15/07/2032                                                                            | 15 277                              | 15 190                           | 0,18                      | Project Cashmere                                                        |                                     |                                  |                           |
| 0,375 % éch. 15/07/2027                                        | 68                                  | 67                               | 0,00                      | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust                                               |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 30/12/2057 (a)                                             | AUD 51 000                          | 35 217                           | 0,41                      |
| 0,625 % éch. 15/07/2032                                        | 10 084                              | 9 342                            | 0,11                      | 6,000 % éch. 25/04/2036                                                                            | 2 381                               | 484                              | 0,01                      | 5,713 % éch. 30/12/2057 (a)                                             | 7 000                               | 4 839                            | 0,06                      |
| 0,750 % éch. 15/07/2028                                        | 1 287                               | 1 258                            | 0,02                      | CSAIL Commercial Mortgage Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,863 % éch. 30/12/2057 (a)                                             | 4 400                               | 3 041                            | 0,04                      |
| 0,750 % éch. 15/02/2042                                        | 442                                 | 338                              | 0,00                      | 4,142 % éch. 15/08/2051                                                                            | 18 710                              | 18 672                           | 0,22                      | 6,163 % éch. 30/12/2057 (a)                                             | 2 900                               | 2 005                            | 0,02                      |
| 0,750 % éch. 15/02/2045                                        | 1 131                               | 804                              | 0,01                      | EMF-UK PLC                                                                                         |                                     |                                  |                           | 6,563 % éch. 30/12/2057 (a)                                             | 2 200                               | 1 521                            | 0,02                      |
| 0,875 % éch. 15/01/2029                                        | 2 605                               | 2 535                            | 0,03                      | 5,686 % éch. 13/03/2046                                                                            | £ 4 239                             | 5 590                            | 0,07                      | Residential Accredited Loans, Inc. Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 0,875 % éch. 15/02/2047                                        | 1 793                               | 1 261                            | 0,02                      | Eurosil PLC                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/07/2036                                                 | \$ 933                              | 887                              | 0,01                      |
| 1,000 % éch. 15/02/2046                                        | 703                                 | 516                              | 0,01                      | 2,801 % éch. 10/09/2044                                                                            | € 1 472                             | 1 680                            | 0,02                      | 4,263 % éch. 25/08/2037                                                 | 223                                 | 218                              | 0,00                      |
| 1,000 % éch. 15/02/2048                                        | 1 890                               | 1 346                            | 0,02                      | FirstMac Mortgage Funding Trust                                                                    |                                     |                                  |                           | Residential Asset Securitization Trust                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 15/02/2049                                        | 3 718                               | 2 613                            | 0,03                      | 5,380 % éch. 11/05/2058                                                                            | AUD 52 900                          | 36 691                           | 0,43                      | 6,609 % éch. 25/02/2037                                                 | 10 618                              | 2 349                            | 0,03                      |
| 1,125 % éch. 15/01/2033                                        | 6 594                               | 6 239                            | 0,07                      | Frontier Mortgage Funding PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust                     |                                     |                                  |                           |
| 1,375 % éch. 15/07/2033                                        | 34 531                              | 33 133                           | 0,39                      | 4,532 % éch. 20/12/2066                                                                            | £ 37 300                            | 49 548                           | 0,58                      | 6,250 % éch. 25/08/2036                                                 | 830                                 | 701                              | 0,01                      |
| 1,375 % éch. 15/02/2044                                        | 143                                 | 117                              | 0,00                      | GreenPoint Mortgage Funding Trust                                                                  |                                     |                                  |                           | Resimac Premier Trust                                                   |                                     |                                  |                           |
| 1,500 % éch. 15/02/2053                                        | 4 256                               | 3 237                            | 0,04                      | 4,163 % éch. 25/05/2037                                                                            | \$ 1 436                            | 1 447                            | 0,02                      | 5,093 % éch. 11/02/2058                                                 | AUD 5 100                           | 3 534                            | 0,04                      |
| 1,625 % éch. 15/04/2030                                        | 3 451                               | 3 410                            | 0,04                      | GS Mortgage-Backed Securities Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 5,423 % éch. 11/02/2058                                                 | 27 200                              | 18 847                           | 0,22                      |
| 1,750 % éch. 15/01/2034                                        | 7 148                               | 6 986                            | 0,08                      | 3,133 % éch. 24/11/2067                                                                            | € 27 100                            | 31 065                           | 0,36                      | RMAC PLC                                                                |                                     |                                  |                           |
| 1,875 % éch. 15/07/2034                                        | 48 064                              | 47 386                           | 0,56                      | 3,750 % éch. 25/10/2057                                                                            | \$ 2 117                            | 2 074                            | 0,02                      | 4,947 % éch. 15/02/2047                                                 | £ 12 219                            | 16 226                           | 0,19                      |
| 2,125 % éch. 15/02/2040                                        | 308                                 | 297                              | 0,00                      | GSR Mortgage Loan Trust                                                                            |                                     |                                  |                           | RMAC Securities PLC                                                     |                                     |                                  |                           |
| 2,125 % éch. 15/02/2041                                        | 152                                 | 145                              | 0,00                      | 6,000 % éch. 25/05/2037                                                                            | 122                                 | 86                               | 0,00                      | 4,049 % éch. 12/06/2044                                                 | \$ 2 128                            | 2 074                            | 0,02                      |
| Billets du Trésor américain                                    |                                     |                                  |                           | HarborView Mortgage Loan Trust                                                                     |                                     |                                  |                           | Santander Residential FT                                                |                                     |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 31/03/2029                                        | 15 600                              | 14 883                           | 0,17                      | 4,134 % éch. 19/09/2037                                                                            | 1 188                               | 1 053                            | 0,01                      | 3,088 % éch. 18/10/2068                                                 | € 19 763                            | 22 653                           | 0,27                      |
| 2,875 % éch. 15/05/2032                                        | 4 500                               | 4 179                            | 0,05                      | Harbour PLC                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 31/07/2032                                        | 35 200                              | 34 695                           | 0,41                      | 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                            | £ 10 112                            | 13 464                           | 0,16                      |                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                        | 6 110                               | 5 962                            | 0,07                      |                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     | 284 471                          | 3,34                      |                                                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                         |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

|                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                            | VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                   | VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------|------|
| DESCRIPTION                                                |                                     |                         |                           | DESCRIPTION                                                             |                                                                |                         |                           | DESCRIPTION                                                        |                                                       |                         |                           |      |
| Sapphire Trust Central Finance                             |                                     |                         |                           | Fulvia SPV SRL                                                          |                                                                |                         |                           | GSAA Home Equity Trust                                             |                                                       |                         |                           |      |
| 4,999 % éch. 12/02/2067                                    | AUD                                 | 334                     | \$ 232                    | 0,00                                                                    | 3,030 % éch. 23/12/2041                                        | € 15 598                | \$ 17 869                 | 0,21                                                               | 4,143 % éch. 25/03/2036                               | \$ 2 124                | \$ 676                    | 0,01 |
| 4,999 % éch. 12/12/2067                                    |                                     | 20 193                  | 13 985                    | 0,16                                                                    | Golden Bar Securitisation SRL                                  |                         |                           | 4,263 % éch. 25/08/2036                                            | 9 601                                                 | 3 051                   | 0,04                      |      |
| 5,131 % éch. 12/03/2068                                    |                                     | 8 700                   | 6 028                     | 0,07                                                                    | 5,286 % éch. 22/09/2043                                        | 899                     | 1 050                     | 0,01                                                               | GSAMP Trust                                           |                         |                           |      |
| 5,570 % éch. 14/01/2066                                    |                                     | 1 829                   | 1 271                     | 0,01                                                                    | 5,986 % éch. 22/09/2043                                        | 450                     | 525                       | 0,01                                                               | 3,903 % éch. 25/12/2036                               | 77                      | 38                        | 0,00 |
| Southern Pacific Securities PLC                            |                                     |                         |                           | Hill FL BV                                                              |                                                                |                         |                           | 4,483 % éch. 25/11/2035                                            | 3 000                                                 | 2 632                   | 0,03                      |      |
| 2,881 % éch. 10/03/2044                                    | €                                   | 610                     | 695                       | 0,01                                                                    | 2,909 % éch. 18/10/2033                                        | 12 400                  | 14 179                    | 0,17                                                               | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust          |                         |                           |      |
| Stratton BTL Mortgage Funding PLC                          |                                     |                         |                           | 2,939 % éch. 18/06/2034                                                 | 18 800                                                         | 21 518                  | 0,25                      | 4,083 % éch. 25/07/2037                                            | 326                                                   | 180                     | 0,00                      |      |
| 4,747 % éch. 20/01/2054                                    | £                                   | 3 000                   | 3 983                     | 0,05                                                                    | Metro Finance Trust                                            |                         |                           | 4,163 % éch. 25/07/2037                                            | 4 371                                                 | 2 412                   | 0,03                      |      |
| Stratton Mortgage Funding PLC                              |                                     |                         |                           | 5,370 % éch. 16/02/2033                                                 | AUD                                                            | 21 777                  | 15 088                    | 0,18                                                               | HSI Asset Securitization Corp. Trust                  |                         |                           |      |
| 4,649 % éch. 28/06/2050                                    |                                     | 5 152                   | 6 841                     | 0,08                                                                    | Panorama Auto Trust                                            |                         |                           | 3,903 % éch. 25/12/2036                                            | 7 057                                                 | 6 241                   | 0,07                      |      |
| 4,721 % éch. 25/06/2049                                    |                                     | 15 418                  | 20 473                    | 0,24                                                                    | 5,230 % éch. 20/04/2034                                        | 31 701                  | 21 948                    | 0,26                                                               | 4,143 % éch. 25/01/2037                               | 2 539                   | 1 754                     | 0,02 |
| 5,496 % éch. 20/06/2060                                    |                                     | 8 000                   | 10 634                    | 0,12                                                                    | 5,270 % éch. 15/03/2033                                        | 11 592                  | 8 034                     | 0,09                                                               | IXIS Real Estate Capital Trust                        |                         |                           |      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust             |                                     |                         |                           | 5,367 % éch. 20/05/2034                                                 | 55 000                                                         | 38 105                  | 0,45                      | 4,223 % éch. 25/01/2037                                            | 3 379                                                 | 1 061                   | 0,01                      |      |
| 4,882 % éch. 25/09/2034                                    | \$                                  | 104                     | 102                       | 0,00                                                                    | Pepper SPARKZ Trust                                            |                         |                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                |                                                       |                         |                           |      |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust                |                                     |                         |                           | 5,300 % éch. 15/01/2033                                                 | 4 071                                                          | 2 822                   | 0,03                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                                            | 1 200                                                 | 1 168                   | 0,01                      |      |
| 5,244 % éch. 25/08/2047                                    |                                     | 4 328                   | 3 759                     | 0,04                                                                    | SC Sweden SARL                                                 |                         |                           | Long Beach Mortgage Loan Trust                                     |                                                       |                         |                           |      |
| TBW Mortgage-Backed Trust                                  |                                     |                         |                           | 2,825 % éch. 25/12/2039                                                 | € 13 600                                                       | 15 567                  | 0,18                      | 4,043 % éch. 25/06/2036                                            | 491                                                   | 470                     | 0,01                      |      |
| 5,965 % éch. 25/07/2037                                    |                                     | 101                     | 28                        | 0,00                                                                    | VCL Multi-Compartment S.A.                                     |                         |                           | 4,223 % éch. 25/10/2036                                            | 7 207                                                 | 2 232                   | 0,03                      |      |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                        |                                     |                         |                           | 2,394 % éch. 21/03/2033                                                 | 35 000                                                         | 40 037                  | 0,47                      | 4,363 % éch. 25/01/2036                                            | 5 468                                                 | 4 937                   | 0,06                      |      |
| 4,778 % éch. 25/12/2042                                    |                                     | 41                      | 39                        | 0,00                                                                    |                                                                |                         | 373 551                   | 4,39                                                               | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust      |                         |                           |      |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                            |                                     |                         |                           |                                                                         |                                                                |                         |                           | 4,263 % éch. 25/06/2037                                            | 621                                                   | 625                     | 0,01                      |      |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                                    | £                                   | 19 020                  | 25 260                    | 0,30                                                                    | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES COMMERCIALES        |                         |                           | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                             |                                                       |                         |                           |      |
| 5,147 % éch. 20/02/2054                                    |                                     | 9 813                   | 13 052                    | 0,15                                                                    | AUTRES                                                         |                         |                           | 4,043 % éch. 25/05/2037                                            | 3 678                                                 | 1 840                   | 0,02                      |      |
| 6,147 % éch. 20/07/2053                                    |                                     | 600                     | 799                       | 0,01                                                                    | BDS LLC                                                        | \$ 8 800                | 8 807                     | 0,10                                                               | 4,063 % éch. 25/08/2037                               | 118                     | 114                       | 0,00 |
| 7,247 % éch. 20/07/2053                                    |                                     | 600                     | 797                       | 0,01                                                                    | Dwight Issuer LLC                                              |                         |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                             |                                                       |                         |                           |      |
| 8,247 % éch. 20/07/2053                                    |                                     | 600                     | 799                       | 0,01                                                                    | 5,000 % éch. 18/01/2044 (a)                                    | 25 100                  | 25 131                    | 0,30                                                               | 3,546 % éch. 25/01/2035                               | 1 330                   | 1 155                     | 0,01 |
| Tower Bridge Funding PLC                                   |                                     |                         |                           | LRECS LLC                                                               |                                                                |                         |                           | 3,963 % éch. 25/05/2037                                            | 800                                                   | 445                     | 0,01                      |      |
| 4,627 % éch. 20/05/2066                                    |                                     | 942                     | 1 251                     | 0,01                                                                    | 5,139 % éch. 19/08/2043                                        | 24 000                  | 24 008                    | 0,28                                                               | 4,063 % éch. 25/06/2036                               | 1 472                   | 1 317                     | 0,02 |
| Trinity Square PLC                                         |                                     |                         |                           |                                                                         |                                                                |                         |                           | 5,763 % éch. 25/07/2037                                            | 1 765                                                 | 1 451                   | 0,02                      |      |
| 4,647 % éch. 15/07/2059                                    |                                     | 19 502                  | 25 903                    | 0,30                                                                    |                                                                |                         |                           | New Century Home Equity Loan Trust                                 |                                                       |                         |                           |      |
| 5,047 % éch. 15/07/2059                                    |                                     | 3 017                   | 4 009                     | 0,05                                                                    |                                                                |                         | 57 946                    | 0,68                                                               | 4,483 % éch. 25/10/2035                               | 2 052                   | 2 051                     | 0,02 |
| Triton Bond Trust                                          |                                     |                         |                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                     |                                                                |                         |                           | NovaStar Mortgage Funding Trust                                    |                                                       |                         |                           |      |
| 5,000 % éch. 15/02/2058                                    | AUD                                 | 3 619                   | 2 506                     | 0,03                                                                    | Aames Mortgage Investment Trust                                |                         |                           | 3,963 % éch. 25/01/2037                                            | 8 015                                                 | 2 583                   | 0,03                      |      |
| 5,250 % éch. 15/02/2058                                    |                                     | 42 100                  | 29 082                    | 0,34                                                                    | 4,678 % éch. 25/10/2035                                        | 2 200                   | 2 115                     | 0,03                                                               | 5,338 % éch. 25/12/2034                               | 2 010                   | 1 965                     | 0,02 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust              |                                     |                         |                           | Accredited Mortgage Loan Trust                                          |                                                                |                         |                           | Option One Mortgage Loan Trust                                     |                                                       |                         |                           |      |
| 4,208 % éch. 25/02/2037                                    | \$                                  | 529                     | 504                       | 0,01                                                                    | 4,633 % éch. 25/09/2035                                        | 1 313                   | 1 285                     | 0,02                                                               | 4,263 % éch. 25/03/2037                               | 4 354                   | 2 104                     | 0,02 |
| 4,523 % éch. 25/01/2045                                    |                                     | 39                      | 38                        | 0,00                                                                    | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                    |                         |                           | 4,528 % éch. 25/08/2035                                            | 825                                                   | 808                     | 0,01                      |      |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                         |                           | 3,983 % éch. 25/10/2036                                                 | 3 980                                                          | 1 505                   | 0,02                      | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                                       |                         |                           |      |
| 6,000 % éch. 25/04/2037                                    |                                     | 3 609                   | 3 035                     | 0,04                                                                    | 4,203 % éch. 25/05/2037                                        | 11 953                  | 1 718                     | 0,02                                                               | 4,543 % éch. 25/09/2035                               | 5 200                   | 4 787                     | 0,06 |
| Wells Fargo Alternative Loan Trust                         |                                     |                         |                           | 4,323 % éch. 25/02/2037                                                 | 4 933                                                          | 2 023                   | 0,02                      | 4,693 % éch. 25/05/2035                                            | 3 907                                                 | 3 373                   | 0,04                      |      |
| 6,500 % éch. 25/07/2037                                    | 2 270                               | 2 054                   | 0,02                      | Aeglis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates |                                                                |                         |                           | 4,708 % éch. 25/09/2035                                            | 1 200                                                 | 1 083                   | 0,01                      |      |
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                      |                                     |                         |                           | 5,713 % éch. 25/06/2034                                                 | 1 291                                                          | 1 251                   | 0,01                      | 4,738 % éch. 25/07/2035                                            | 400                                                   | 352                     | 0,00                      |      |
| 5,761 % éch. 15/09/2040                                    | 4 300                               | 4 245                   | 0,05                      | Amortizing Residential Collateral Trust                                 |                                                                |                         |                           | 5,338 % éch. 25/02/2035                                            | 2 736                                                 | 2 713                   | 0,03                      |      |
| Winchester PLC                                             |                                     |                         |                           | 4,463 % éch. 25/10/2031                                                 | 88                                                             | 87                      | 0,00                      | 5,638 % éch. 25/09/2034                                            | 1 517                                                 | 1 492                   | 0,02                      |      |
| 4,637 % éch. 21/10/2056                                    | £                                   | 7 012                   | 9 315                     | 0,11                                                                    | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                         |                           | People's Choice Home Loan Securities Trust                         |                                                       |                         |                           |      |
|                                                            |                                     |                         | 819 817                   | 9,63                                                                    | 4,528 % éch. 25/10/2035                                        | 98                      | 92                        | 0,00                                                               | 5,788 % éch. 25/10/2034                               | 477                     | 411                       | 0,01 |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                 |                                     |                         |                           |                                                                         | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust           |                         |                           | Renaissance Home Equity Loan Trust                                 |                                                       |                         |                           |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES              |                                     |                         |                           |                                                                         | 2,863 % éch. 25/07/2036                                        | 142                     | 142                       | 0,00                                                               | 5,580 % éch. 25/11/2036                               | 1 235                   | 366                       | 0,00 |
|                                                            |                                     |                         |                           |                                                                         | 3,531 % éch. 25/05/2036                                        | 4 927                   | 4 783                     | 0,06                                                               | 6,566 % éch. 25/02/2036                               | 501                     | 433                       | 0,01 |
| Angle Asset Finance Radian Trust                           |                                     |                         |                           | Bayview Financial Acquisition Trust                                     |                                                                |                         |                           | SG Mortgage Securities Trust                                       |                                                       |                         |                           |      |
| 5,500 % éch. 16/03/2033                                    | AUD                                 | 8 609                   | 5 979                     | 0,07                                                                    | 4,292 % éch. 28/05/2037                                        | 1 495                   | 1 387                     | 0,02                                                               | 4,183 % éch. 25/10/2036                               | 300                     | 247                       | 0,00 |
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL                          |                                     |                         |                           | Bayview Financial Asset Trust                                           |                                                                |                         |                           | Soundview Home Loan Trust                                          |                                                       |                         |                           |      |
| 2,953 % éch. 26/12/2041                                    | €                                   | 29 200                  | 33 444                    | 0,39                                                                    | 5,263 % éch. 25/03/2037                                        | 319                     | 329                       | 0,00                                                               | 4,003 % éch. 25/11/2036                               | 10 296                  | 2 691                     | 0,03 |
| Auto ABS Spanish Loans                                     |                                     |                         |                           | Carrington Mortgage Loan Trust                                          |                                                                |                         |                           | Structured Asset Investment Loan Trust                             |                                                       |                         |                           |      |
| 4,421 % éch. 28/02/2032                                    |                                     | 337                     | 386                       | 0,01                                                                    | 4,243 % éch. 25/08/2036                                        | 1 000                   | 861                       | 0,01                                                               | 4,483 % éch. 25/01/2036                               | 253                     | 245                       | 0,00 |
| BBVA Consumer Auto                                         |                                     |                         |                           | 4,753 % éch. 25/06/2035                                                 | 1 625                                                          | 1 635                   | 0,02                      | 4,763 % éch. 25/09/2034                                            | 1 590                                                 | 1 570                   | 0,02                      |      |
| 2,819 % éch. 25/02/2042                                    |                                     | 11 500                  | 13 160                    | 0,16                                                                    | 5,563 % éch. 25/05/2035                                        | 3 600                   | 3 127                     | 0,04                                                               | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                         |                           |      |
| 3,117 % éch. 19/03/2038                                    |                                     | 7 116                   | 8 162                     | 0,10                                                                    | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                            |                         |                           | 3,993 % éch. 25/05/2047                                            | 106                                                   | 105                     | 0,00                      |      |
| Chesapeake Funding DAC                                     |                                     |                         |                           | 4,023 % éch. 25/03/2037                                                 | 6 941                                                          | 6 349                   | 0,07                      | 4,163 % éch. 25/06/2037                                            | 6 482                                                 | 4 247                   | 0,05                      |      |
| 4,082 % éch. 15/07/2027                                    | \$                                  | 11 600                  | 11 599                    | 0,14                                                                    | 4,393 % éch. 25/02/2035                                        | 1 224                   | 1 165                     | 0,01                                                               | 4,738 % éch. 25/05/2035                               | 2 558                   | 2 497                     | 0,03 |
| 4,260 % éch. 15/12/2028                                    |                                     | 1 900                   | 1 899                     | 0,02                                                                    | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.              |                         |                           | 7,513 % éch. 25/11/2035                                            | 3 000                                                 | 2 791                   | 0,03                      |      |
| Driver Australia Ten                                       |                                     |                         |                           | 4,043 % éch. 25/12/2046                                                 | 756                                                            | 707                     | 0,01                      | Terwin Mortgage Trust                                              |                                                       |                         |                           |      |
| 5,450 % éch. 21/02/2033                                    | AUD                                 | 13 819                  | 9 594                     | 0,11                                                                    | 4,043 % éch. 25/06/2047                                        | 1 411                   | 1 321                     | 0,02                                                               | 5,143 % éch. 25/03/2035                               | 406                     | 409                       | 0,01 |
| E-Carat DE                                                 |                                     |                         |                           | 4,183 % éch. 25/05/2047                                                 | 5 277                                                          | 5 221                   | 0,06                      | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                          |                                                       |                         |                           |      |
| 2,634 % éch. 25/10/2034                                    | €                                   | 10 700                  | 12 243                    | 0,14                                                                    | 4,203 % éch. 25/05/2037                                        | 2 282                   | 2 210                     | 0,03                                                               | 4,053 % éch. 25/05/2037                               | 3 705                   | 3 360                     | 0,04 |
| FACT S.A.                                                  |                                     |                         |                           | 4,288 % éch. 25/08/2036                                                 | 287                                                            | 283                     | 0,00                      | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust              |                                                       |                         |                           |      |
| 2,915 % éch. 20/04/2033                                    |                                     | 12 503                  | 14 316                    | 0,17                                                                    | 4,483 % éch. 25/05/2036                                        | 1 706                   | 1 630                     | 0,02                                                               | 4,513 % éch. 25/12/2035                               | 112                     | 112                       | 0,00 |
| First Mobility SARL                                        |                                     |                         |                           | 4,963 % éch. 25/10/2035                                                 | 213                                                            | 213                     | 0,00                      | 5,488 % éch. 25/11/2035                                            | 992                                                   | 993                     | 0,01                      |      |
| 2,809 % éch. 14/10/2032                                    |                                     | 15 836                  | 18 133                    | 0,21                                                                    | 4,963 % éch. 25/11/2035                                        | 5 000                   | 4 738                     | 0,06                                                               |                                                       |                         |                           |      |
| First Mobility Swiss Lease                                 |                                     |                         |                           | 5,263 % éch. 25/10/2047                                                 | 9 916                                                          | 8 651                   | 0,10                      |                                                                    |                                                       |                         |                           |      |
| 2,959 % éch. 23/09/2033                                    |                                     | 39 357                  | 45 058                    | 0,53                                                                    | Fieldstone Mortgage Investment Trust                           |                         |                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES                          |                                                       |                         |                           |      |
| FTA Santander Consumer Spain Auto                          |                                     |                         |                           | 4,543 % éch. 25/12/2035                                                 | 12 460                                                         | 11 352                  | 0,13                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                  |                                                       |                         |                           |      |
| 3,236 % éch. 22/09/2039                                    |                                     | 2 474                   | 2 836                     | 0,03                                                                    | Fremont Home Loan Trust                                        |                         |                           | 3,089 % éch. 25/01/2037                                            | 15 507                                                | 4 187                   | 0,05                      |      |
|                                                            |                                     |                         |                           | 4,063 % éch. 25/10/2036                                                 | 1 164                                                          | 455                     | 0,01                      | Saxon Asset Securities Trust                                       |                                                       |                         |                           |      |
|                                                            |                                     |                         |                           |                                                                         |                                                                |                         |                           | 4,103 % éch. 25/10/2046                                            | 698                                                   | 694                     | 0,01                      |      |
|                                                            |                                     |                         |                           |                                                                         |                                                                |                         |                           |                                                                    |                                                       | 4 881                   | 0,06                      |      |

|                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)         | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                      | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |           |        |      |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------|------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------|-----------|--------|------|
| AUTRES TITRES ADOSÉS A DES ACTIFS                 |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION                   | DESCRIPTION                                 |                                  |                           |        | DESCRIPTION                                          |                                                       |                           |           |        |      |
| AltaCore Euro CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL | €                                           | 17 790                           | \$ 20 392                 | 0,24   | Tikehau CLO DAC                                      | €                                                     | 13 600                    | \$ 15 571 | 0,18   |      |
| 3,194 % éch. 15/07/2035                           | €                                   | 18 032                           | \$ 20 666                 | 0,24                          | 3,136 % éch. 20/12/2044                     |                                  |                           |        | 3,483 % éch. 20/04/2038                              |                                                       |                           |           |        |      |
| Aqueduct European CLO DAC                         |                                     |                                  |                           |                               | Grosvenor Place CLO DAC                     |                                  |                           |        | Toro European CLO DAC                                |                                                       | 1 018                     | 1 165     | 0,01   |      |
| 3,511 % éch. 15/07/2039 (a)                       | 22 400                              | 25 610                           | 0,30                      |                               | 3,383 % éch. 15/08/2039                     | 13 300                           | 15 221                    | 0,18   | 3,093 % éch. 15/02/2034                              |                                                       |                           |           |        |      |
| 4,121 % éch. 15/07/2039 (a)                       | 4 150                               | 4 745                            | 0,06                      |                               | Harvest CLO DAC                             |                                  |                           |        | Trinitas CLO Ltd.                                    |                                                       |                           |           |        |      |
| Arbour CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           |                               | 3,464 % éch. 15/10/2038                     | 20 580                           | 23 566                    | 0,28   | 4,715 % éch. 20/07/2035                              | \$                                                    | 11 100                    | 11 100    | 0,13   |      |
| 3,453 % éch. 15/08/2038                           | 9 300                               | 10 634                           | 0,12                      |                               | 3,523 % éch. 25/07/2037 (a)                 | 17 000                           | 19 436                    | 0,23   | Voya Euro CLO DAC                                    |                                                       |                           |           |        |      |
| Ares European CLO DAC                             |                                     |                                  |                           |                               | 4,063 % éch. 25/07/2037 (a)                 | 4 800                            | 5 488                     | 0,06   | 3,174 % éch. 15/10/2034                              | €                                                     | 12 700                    | 14 529    | 0,17   |      |
| 3,512 % éch. 15/07/2037                           | 24 600                              | 28 125                           | 0,33                      |                               | Hayfin Emerald CLO DAC                      |                                  |                           |        |                                                      |                                                       | 1 081 221                 | 12,70     |        |      |
| Atlantic Avenue Ltd.                              |                                     |                                  |                           |                               | 3,449 % éch. 17/11/2037                     | 13 100                           | 15 001                    | 0,18   | PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE              |                                                       |                           |           |        |      |
| 5,053 % éch. 15/10/2038                           | \$                                  | 29 800                           | 29 899                    | 0,35                          | 3,454 % éch. 15/10/2038                     | 12 400                           | 14 189                    | 0,17   | Curzon Mortgages PLC                                 |                                                       |                           |           |        |      |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                      |                                     |                                  |                           |                               | ICG Euro CLO DAC                            |                                  |                           |        | 4,592 % éch. 28/07/2049                              | £                                                     | 33 300                    | 44 214    | 0,52   |      |
| 4,762 % éch. 21/10/2034                           | 10 400                              | 10 413                           | 0,12                      |                               | 3,455 % éch. 26/01/2038                     | 16 200                           | 18 540                    | 0,22   | First Franklin Mortgage Loan Trust                   |                                                       |                           |           |        |      |
| Ballyrock CLO Ltd.                                |                                     |                                  |                           |                               | Indigo Credit Management DAC                |                                  |                           |        | 4,003 % éch. 25/10/2036                              | \$                                                    | 269                       | 171       | 0,00   |      |
| 5,177 % éch. 25/07/2037                           | 5 100                               | 5 113                            | 0,06                      |                               | 3,404 % éch. 15/07/2038                     | 18 300                           | 20 955                    | 0,25   | 4,168 % éch. 25/04/2036                              | 1 000                                                 | 813                       | 0,01      |        |      |
| Barings Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                               | Invesco Euro CLO DAC                        |                                  |                           |        | Lehman XS Trust                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,164 % éch. 15/10/2034                           | €                                   | 14 965                           | 17 125                    | 0,20                          | 3,277 % éch. 15/07/2037                     | 10 100                           | 11 561                    | 0,14   | 4,283 % éch. 25/05/2046                              | 1 150                                                 | 1 086                     | 0,01      |        |      |
| 3,164 % éch. 15/04/2036                           | 16 063                              | 18 380                           | 0,22                      |                               | 3,454 % éch. 22/10/2036                     | 17 000                           | 19 459                    | 0,23   | 6,063 % éch. 25/12/2037                              | 1 429                                                 | 1 481                     | 0,02      |        |      |
| 3,184 % éch. 15/10/2034                           | 4 999                               | 5 727                            | 0,07                      |                               | Latitude Australia Personal Loans Trust     | AUD                              | 7 712                     | 5 347  | 0,06                                                 | 6,500 % éch. 25/06/2046                               | 41                        | 36        | 0,00   |      |
| 3,426 % éch. 15/08/2039                           | 12 200                              | 13 959                           | 0,16                      |                               | 5,303 % éch. 17/09/2033                     |                                  |                           |        | Residential Asset Mortgage Products Trust            |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,444 % éch. 21/10/2038                           | 19 800                              | 22 671                           | 0,27                      |                               | Lyra Music Assets Delaware LP               | \$                               | 21 455                    | 21 604 | 0,25                                                 | 4,843 % éch. 25/03/2035                               | 1 420                     | 1 418     | 0,02   |      |
| Bayfront IABS Pte Ltd.                            |                                     |                                  |                           |                               | 5,760 % éch. 22/12/2064                     |                                  |                           |        | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust   |                                                       |                           |           |        |      |
| 4,904 % éch. 11/04/2048                           | \$                                  | 11 543                           | 11 521                    | 0,14                          | Madison Park Euro Funding DAC               |                                  |                           |        | 3,963 % éch. 25/11/2037                              | 1 334                                                 | 722                       | 0,01      |        |      |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.          |                                     |                                  |                           |                               | 3,004 % éch. 15/07/2032                     | €                                | 4 438                     | 5 080  | 0,06                                                 |                                                       | 49 941                    | 0,59      |        |      |
| 4,941 % éch. 11/04/2045                           | 3 984                               | 3 976                            | 0,05                      |                               | 3,384 % éch. 15/07/2036                     | 12 800                           | 14 628                    | 0,17   |                                                      |                                                       | 1 712 126                 | 20,12     |        |      |
| 4,951 % éch. 11/04/2045                           | 3 984                               | 3 977                            | 0,05                      |                               | MV Credit Euro CLO DAC                      |                                  |                           |        | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                                       |                           |           |        |      |
| 5,026 % éch. 11/04/2043                           | 1 274                               | 1 274                            | 0,01                      |                               | 3,583 % éch. 15/02/2038                     | 14 300                           | 16 362                    | 0,19   | Obligation internationale du gouvernement argentin   |                                                       |                           |           |        |      |
| 5,051 % éch. 11/04/2043                           | 3 963                               | 3 966                            | 0,05                      |                               | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |                                  |                           |        | 0,750 % éch. 09/07/2030                              | 6 564                                                 | 5 466                     | 0,06      |        |      |
| BBVA Consumer FTA                                 |                                     |                                  |                           |                               | 3,414 % éch. 15/07/2039                     | 18 700                           | 21 406                    | 0,25   | 1,000 % éch. 09/07/2029                              | 84                                                    | 76                        | 0,00      |        |      |
| 2,849 % éch. 20/05/2039                           | €                                   | 7 221                            | 8 250                     | 0,10                          | Ocean Trails CLO                            | \$                               | 1 000                     | 1 001  | 0,01                                                 | 3,500 % éch. 09/07/2041                               | 3 463                     | 2 597     | 0,03   |      |
| Blackrock European CLO DAC                        |                                     |                                  |                           |                               | 4,973 % éch. 15/10/2034                     |                                  |                           |        | 4,125 % éch. 09/07/2035                              | 7 232                                                 | 5 756                     | 0,07      |        |      |
| 3,118 % éch. 19/07/2035                           | 11 078                              | 12 681                           | 0,15                      |                               | OCP Euro CLO DAC                            |                                  |                           |        | Obligation internationale du gouvernement australien |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,158 % éch. 20/01/2036                           | 4 500                               | 5 150                            | 0,06                      |                               | 3,158 % éch. 20/04/2035                     | €                                | 5 000                     | 5 722  | 0,07                                                 | 1,750 % éch. 21/06/2051                               | AUD                       | 2 500     | 890    | 0,01 |
| BlueMountain Euro CLO DAC                         |                                     |                                  |                           |                               | 3,468 % éch. 20/10/2039                     | 12 400                           | 14 188                    | 0,17   | Obligation internationale du gouvernement brésilien  |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,204 % éch. 15/10/2035                           | 2 100                               | 2 405                            | 0,03                      |                               | 3,513 % éch. 15/04/2037                     | 25 300                           | 28 925                    | 0,34   | 4,000 % éch. 23/04/2030                              | €                                                     | 25 800                    | 29 604    | 0,35   |      |
| Bosphorus CLO DAC                                 |                                     |                                  |                           |                               | 4,063 % éch. 15/04/2037                     | 3 800                            | 4 345                     | 0,05   | Obligation internationale du gouvernement colombien  |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,407 % éch. 12/12/2032                           | 50                                  | 57                               | 0,00                      |                               | Palmer Square BDC CLO Ltd.                  | \$                               | 8 700                     | 8 705  | 0,10                                                 | 3,750 % éch. 19/09/2028                               | 4 600                     | 5 233     | 0,06   |      |
| Boyce Park CLO Ltd.                               |                                     |                                  |                           |                               | 5,273 % éch. 15/07/2037                     |                                  |                           |        | 4,500 % éch. 26/11/2030                              | 27 200                                                | 31 204                    | 0,37      |        |      |
| 4,672 % éch. 21/04/2035                           | \$                                  | 29 600                           | 29 620                    | 0,35                          | Palmer Square European Loan Funding DAC     | €                                | 11 329                    | 12 951 | 0,15                                                 | 5,375 % éch. 21/01/2029                               | \$                        | 14 800    | 14 773 | 0,17 |
| Cairn CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           |                               | 3,054 % éch. 15/10/2034                     | 10 550                           | 12 077                    | 0,14   | TES colombien                                        |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,434 % éch. 15/01/2040                           | €                                   | 12 000                           | 13 731                    | 0,16                          | 3,273 % éch. 15/05/2034                     | 1 500                            | 1 719                     | 0,02   | 6,500 % éch. 22/01/2031 (f)                          | 5 059 7                                               | 1 455                     | 0,02      |        |      |
| Capital Four CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                               | 3,983 % éch. 15/08/2033                     | 600                              | 688                       | 0,01   | COP                                                  | 55                                                    |                           |           |        |      |
| 3,394 % éch. 15/04/2038                           | 18 400                              | 21 039                           | 0,25                      |                               | 4,173 % éch. 15/05/2034                     |                                  |                           |        | 11,000 % éch. 22/08/2029                             | 44 554                                                | 12 543                    | 0,15      |        |      |
| Carlyle Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                               | Penta CLO DAC                               |                                  |                           |        | 11,750 % éch. 24/01/2035                             | 110 464 70                                            | 31 469                    | 0,37      |        |      |
| 3,493 % éch. 15/08/2038                           | 3 500                               | 4 010                            | 0,05                      |                               | 3,015 % éch. 25/07/2036                     | 6 700                            | 7 668                     | 0,09   | 12,500 % éch. 27/02/2030                             | 95 844                                                | 27 976                    | 0,33      |        |      |
| Castlelake Aircraft Structured Trust              |                                     |                                  |                           |                               | Pepper Iberia Consumer                      | 4 500                            | 5 144                     | 0,06   | 12,750 % éch. 28/11/2040                             | 100                                                   | 13 596                    | 0,16      |        |      |
| 5,465 % éch. 15/08/2050                           | \$                                  | 8 977                            | 8 930                     | 0,10                          | 3,142 % éch. 25/04/2037                     |                                  |                           |        | 13,250 % éch. 09/02/2033                             | 44 027                                                | 13 475                    | 0,16      |        |      |
| 5,783 % éch. 15/02/2050                           | 6 219                               | 6 245                            | 0,07                      |                               | Planet Fitness Master Issuer LLC            |                                  |                           |        |                                                      | 900                                                   |                           |           |        |      |
| College Avenue Student Loans LLC                  |                                     |                                  |                           |                               | 5,274 % éch. 06/12/2055                     | \$                               | 3 092                     | 3 071  | 0,04                                                 | Obligation internationale du gouvernement costaricain |                           |           |        |      |
| 4,130 % éch. 26/12/2047                           | 10                                  | 10                               | 0,00                      |                               | Plenti PL & Green ABS Trust                 | AUD                              | 3 719                     | 2 574  | 0,03                                                 | 5,500 % éch. 21/11/2030                               | €                         | 4 000     | 4 812  | 0,06 |
| 4,963 % éch. 26/12/2047                           | 10                                  | 10                               | 0,00                      |                               | 5,276 % éch. 11/07/2037                     |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| Cumulus Static CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |                               | Providus CLO DAC                            |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,483 % éch. 15/11/2033                           | €                                   | 6 400                            | 7 323                     | 0,09                          | 3,189 % éch. 20/05/2034                     | €                                | 20 000                    | 22 895 | 0,27                                                 |                                                       |                           |           |        |      |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                        |                                     |                                  |                           |                               | 3,374 % éch. 15/07/2038                     | 19 100                           | 21 840                    | 0,26   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,341 % éch. 15/12/2034                           | 10 000                              | 11 442                           | 0,13                      |                               | 3,415 % éch. 20/11/2038                     | 26 400                           | 30 198                    | 0,35   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC            |                                     |                                  |                           |                               | 3,513 % éch. 15/11/2039                     | 14 300                           | 16 368                    | 0,19   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,123 % éch. 15/08/2033                           | 5 772                               | 6 597                            | 0,08                      |                               | 3,995 % éch. 20/11/2038                     | 7 700                            | 8 819                     | 0,10   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| Dartry Park CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |                               | RIN LLC                                     |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 2,963 % éch. 28/01/2034                           | 14 112                              | 16 147                           | 0,19                      |                               | 5,044 % éch. 20/07/2037 (a)                 | \$                               | 25 000                    | 25 000 | 0,29                                                 |                                                       |                           |           |        |      |
| DB Master Finance LLC                             |                                     |                                  |                           |                               | 5,194 % éch. 20/07/2037 (a)                 | 500                              | 500                       | 0,01   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 4,030 % éch. 20/11/2047                           | \$                                  | 2 202                            | 2 181                     | 0,03                          | 5,344 % éch. 20/07/2037 (a)                 | 2 900                            | 2 900                     | 0,03   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| Domino's Pizza Master Issuer LLC                  |                                     |                                  |                           |                               | 5,594 % éch. 20/07/2037 (a)                 | 1 800                            | 1 797                     | 0,02   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 2,662 % éch. 25/04/2051                           | 1 848                               | 1 757                            | 0,02                      |                               | Rockfield Park CLO DAC                      | €                                | 19 117                    | 21 873 | 0,26                                                 |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,151 % éch. 25/04/2051                           | 973                                 | 893                              | 0,01                      |                               | 3,143 % éch. 16/07/2034                     |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,668 % éch. 25/10/2049                           | 5 184                               | 4 982                            | 0,06                      |                               | SC Germany S.A., Compartment Consumer       |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| Dryden Euro CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |                               | 2,859 % éch. 14/12/2038                     | 5 169                            | 5 928                     | 0,07   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,218 % éch. 18/10/2034                           | €                                   | 7 000                            | 8 010                     | 0,09                          | SLM Student Loan Trust                      |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| Fair Oaks Loan Funding DAC                        |                                     |                                  |                           |                               | 2,565 % éch. 25/10/2039                     | 332                              | 355                       | 0,00   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,084 % éch. 15/04/2034                           | 9 098                               | 10 416                           | 0,12                      |                               | 2,715 % éch. 25/07/2039                     | 926                              | 1 003                     | 0,01   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| Flexcommercial ABS Trust                          |                                     |                                  |                           |                               | SMB Private Education Loan Trust            |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 5,550 % éch. 14/06/2031                           | AUD                                 | 2 984                            | 2 073                     | 0,02                          | 3,500 % éch. 16/12/2041                     | \$                               | 477                       | 471    | 0,01                                                 |                                                       |                           |           |        |      |
| GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                                  |                           |                               | St. Paul's CLO DAC                          |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 2,918 % éch. 25/10/2035                           | €                                   | 7 257                            | 8 304                     | 0,10                          | 2,995 % éch. 25/04/2030                     | €                                | 7 735                     | 8 848  | 0,10                                                 |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,095 % éch. 25/02/2034                           | 6 583                               | 7 555                            | 0,09                      |                               | 3,090 % éch. 17/01/2032                     | 6 562                            | 7 509                     | 0,09   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
| 3,158 % éch. 23/12/2036                           | 15 100                              | 17 288                           | 0,20                      |                               | 3,145 % éch. 25/10/2035                     | 12 700                           | 14 532                    | 0,17   |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
|                                                   |                                     |                                  |                           |                               | Taco Bell Funding LLC                       |                                  |                           |        |                                                      |                                                       |                           |           |        |      |
|                                                   |                                     |                                  |                           |                               | 1,946 % éch. 25/08/2051                     | \$                               | 16 408                    | 16 120 | 0,19                                                 |                                                       |                           |           |        |      |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|-------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Eagle Funding Luxco SARL<br>5,500 % éch. 17/08/2030                                          | \$ 19 550                           | \$ 19 654                        | 0,23                      | ACTIONS ORDINAIRES                                         |           |                                  |                           | 21,097 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien<br>19,698 % éch. 14/10/2030               | EGP 880 900                         | 17 070                           | 0,20                      | SERVICES DE COMMUNICATION                                  |           |                                  |                           | 07/07/2026 (d)(e) | NGN 235 400                         | \$ 171                           | 0,00                      |
| 21,954 % éch. 04/03/2028                                                                     | 428 000                             | 8 445                            | 0,10                      | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)                   | 173 174   | \$ 419                           | 0,00                      | 21,137 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033 | \$ 11 000                           | 10 964                           | 0,13                      | iHeartMedia, Inc. « A » (c)                                | 36 558    | 157                              | 0,00                      | 06/10/2026 (d)(e) | 156 594                             | 108                              | 0,00                      |
| 4,875 % éch. 30/04/2029                                                                      | 15 300                              | 15 414                           | 0,18                      | iHeartMedia, Inc. « B » (c)                                | 32 182    | 119                              | 0,00                      | 21,241 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Export-Import Bank of Korea<br>0,000 % éch. 27/01/2027 (d)                                   | 2 100                               | 4 132                            | 0,05                      | SES S.A. (c)                                               | 45 580    | 689                              | 0,01                      | 14/07/2026 (d)(e) | 391 485                             | 283                              | 0,01                      |
| Obligation internationale du gouvernement israélien<br>5,375 % éch. 19/02/2030               | 16 200                              | 16 429                           | 0,19                      | Uniti Group, Inc. (c)                                      | 148       | 2                                | 0,00                      | 21,322 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>1,800 % éch. 20/03/2054                | ¥ 144 000                           | 569                              | 0,01                      |                                                            |           | 1 386                            | 0,01                      | 28/07/2026 (d)(e) | 187 913                             | 135                              | 0,00                      |
| 2,100 % éch. 20/09/2054                                                                      | 479 950                             | 2 038                            | 0,02                      | SERVICES FINANCIERS                                        |           |                                  |                           | 21,450 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 2,200 % éch. 20/06/2054                                                                      | 64 000                              | 279                              | 0,00                      | Adler Group S.A. (c)                                       | 1 601 197 | 0                                | 0,00                      | 07/07/2026 (d)(e) | 294 300                             | 214                              | 0,00                      |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                                                                      | 433 850                             | 1 932                            | 0,02                      | SOINS DE SANTÉ                                             |           |                                  |                           | 21,480 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 2,400 % éch. 20/03/2045                                                                      | 284 000                             | 1 474                            | 0,02                      | Amsurg Escrow (c)                                          | 45 588    | 42                               | 0,00                      | 28/07/2026 (d)(e) | 234 900                             | 168                              | 0,00                      |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                                                                      | 599 300                             | 2 733                            | 0,03                      | INDUSTRIE                                                  |           |                                  |                           | 21,587 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 2,700 % éch. 20/09/2045                                                                      | 435 050                             | 2 352                            | 0,03                      | Westmoreland Mining LLC (c)(h)                             | 149       | 1                                | 0,00                      | 04/08/2026 (d)(e) | 88 300                              | 63                               | 0,00                      |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                                                                      | 2 899 850                           | 15 666                           | 0,18                      | Westmoreland Mining LLC « L » (c)(h)                       | 149       | 0                                | 0,00                      | 21,625 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 20/12/2055                                                                      | 1 219 400                           | 6 848                            | 0,08                      |                                                            |           | 1                                | 0,00                      | 11/08/2026 (d)(e) | 537 000                             | 382                              | 0,01                      |
| 3,700 % éch. 20/03/2056                                                                      | 630 000                             | 3 746                            | 0,04                      | TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION                              |           |                                  |                           | 21,638 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,016 % éch. 09/10/2028               | \$ 16 800                           | 16 584                           | 0,20                      | NVIDIA Corp.                                               | 2 325     | 465                              | 0,01                      | 11/08/2026 (d)(e) | 353 200                             | 251                              | 0,00                      |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (h)                                                                  | 13 500                              | 13 477                           | 0,16                      | Unity Bancorp, Inc. (c)                                    | 432       | 5                                | 0,00                      | 21,659 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>3,500 % éch. 19/09/2029                | € 7 100                             | 8 065                            | 0,10                      |                                                            |           |                                  |                           | 25/08/2026 (d)(e) | 206 000                             | 145                              | 0,00                      |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>5,350 % éch. 12/08/2040                | PEN 1 522                           | 390                              | 0,00                      | BONS DE SOUSCRIPTION                                       |           |                                  |                           | 21,675 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                                                                      | 4 088                               | 1 298                            | 0,02                      | Windstream Holdings II LLC - Exp.<br>01/08/2035            | 84        | 1                                | 0,00                      | 18/08/2026 (d)(e) | 117 700                             | 83                               | 0,00                      |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033                  | \$ 8 900                            | 8 948                            | 0,11                      | TITRES PRIVILÉGIÉS                                         |           |                                  |                           | 21,676 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>2,000 % éch. 14/04/2033                 | € 1 300                             | 1 223                            | 0,01                      | Windstream Holdings LLC                                    |           |                                  |                           | 11/08/2026 (d)(e) | 529 600                             | 376                              | 0,01                      |
| 5,250 % éch. 10/03/2030                                                                      | 14 700                              | 17 462                           | 0,21                      | 11,000 %                                                   | 3         | 3                                | 0,00                      | 21,690 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 30/05/2032                                                                      | 3 630                               | 4 237                            | 0,05                      |                                                            |           |                                  |                           | 07/07/2026 (d)(e) | 268 400                             | 195                              | 0,00                      |
| 5,375 % éch. 22/03/2031                                                                      | 1 010                               | 1 197                            | 0,01                      | INSTRUMENTS À COURT TERME                                  |           |                                  |                           | 21,699 % éch.     |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 07/06/2033                                                                      | 9 900                               | 11 436                           | 0,13                      | BILLET À COURT TERME                                       |           |                                  |                           | 25/08/2026 (d)(e) | 161 000                             | 113                              | 0,00                      |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>4,125 % éch. 12/01/2029                | \$ 14 700                           | 14 491                           | 0,17                      | Discovery Global Holdings, Inc.<br>3,755 % éch. 15/03/2027 | \$ 14 900 | 14 806                           | 0,17                      | 01/09/2026 (d)(e) | 161 000                             | 113                              | 0,00                      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>7,000 % éch. 28/02/2031            | ZAR 2 800                           | 165                              | 0,00                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                                                      | 39 000                              | 2 370                            | 0,03                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                                                      | 112 700                             | 7 126                            | 0,08                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                                                      | 12 600                              | 778                              | 0,01                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement turc<br>5,250 % éch. 13/03/2030                    | \$ 800                              | 777                              | 0,01                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 40,305 % éch. 06/09/2028                                                                     | TRY 11 400                          | 246                              | 0,00                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 40,760 % éch. 19/08/2026                                                                     | 800                                 | 17                               | 0,00                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 40,760 % éch. 17/05/2028                                                                     | 176 800                             | 3 826                            | 0,05                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien<br>8,250 % éch. 13/10/2024 ^           | \$ 2 000                            | 910                              | 0,01                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 07/05/2023 ^                                                                    | 1 600                               | 760                              | 0,01                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |
|                                                                                              |                                     | 446 453                          | 5,25                      |                                                            |           |                                  |                           |                   |                                     |                                  |                           |

|                                     |             |              |        |
|-------------------------------------|-------------|--------------|--------|
| 21,097 % éch.                       |             |              |        |
| 07/07/2026 (d)(e)                   | NGN 235 400 | \$ 171       | 0,00   |
| 21,137 % éch.                       |             |              |        |
| 06/10/2026 (d)(e)                   | 156 594     | 108          | 0,00   |
| 21,241 % éch.                       |             |              |        |
| 14/07/2026 (d)(e)                   | 391 485     | 283          | 0,01   |
| 21,322 % éch.                       |             |              |        |
| 28/07/2026 (d)(e)                   | 187 913     | 135          | 0,00   |
| 21,450 % éch.                       |             |              |        |
| 07/07/2026 (d)(e)                   | 294 300     | 214          | 0,00   |
| 21,480 % éch.                       |             |              |        |
| 28/07/2026 (d)(e)                   | 234 900     | 168          | 0,00   |
| 21,587 % éch.                       |             |              |        |
| 04/08/2026 (d)(e)                   | 88 300      | 63           | 0,00   |
| 21,625 % éch.                       |             |              |        |
| 11/08/2026 (d)(e)                   | 537 000     | 382          | 0,01   |
| 21,638 % éch.                       |             |              |        |
| 11/08/2026 (d)(e)                   | 353 200     | 251          | 0,00   |
| 21,659 % éch.                       |             |              |        |
| 25/08/2026 (d)(e)                   | 206 000     | 145          | 0,00   |
| 21,675 % éch.                       |             |              |        |
| 18/08/2026 (d)(e)                   | 117 700     | 83           | 0,00   |
| 21,676 % éch.                       |             |              |        |
| 11/08/2026 (d)(e)                   | 529 600     | 376          | 0,01   |
| 21,690 % éch.                       |             |              |        |
| 07/07/2026 (d)(e)                   | 268 400     | 195          | 0,00   |
| 21,699 % éch.                       |             |              |        |
| 25/08/2026 (d)(e)                   | 161 000     | 113          | 0,00   |
| 21,704 % éch.                       |             |              |        |
| 01/09/2026 (d)(e)                   | 161 000     | 113          | 0,00   |
|                                     |             | 2 800        | 0,03   |
| Total des Instruments à court terme |             | 21 445       | 0,25   |
| Total des Valeurs mobilières        |             | \$ 9 757 382 | 114,65 |

|                                                                                          |            |            |      |
|------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------------|------|
| ACTIONS                                                                                  |            |            |      |
| FONDS D'INVESTISSEMENT                                                                   |            |            |      |
| ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF                                                        |            |            |      |
| PIMCO Select Funds plc -<br>Fonds PIMCO US<br>Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (g) | 81 426 111 | 812 004    | 9,54 |
| FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE                                                                 |            |            |      |
| PIMCO ETFs plc - Fonds<br>PIMCO US Dollar<br>Short Maturity UCITS<br>ETF (g)             | 166 285    | 16 708     | 0,20 |
| Total des Fonds d'investissement                                                         |            | \$ 828 712 | 9,74 |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                       | Garantie<br>(reçue) | Contrats de<br>mise<br>en pension,<br>à la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|--------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOS          | 3,660 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 784 000              | Billets du Trésor américain 0,375 % - 4,000 %<br>échéance 30/09/2027 - 31/12/2027 | \$ (799 741)        | \$ 784 000                                        | \$ 784 080                                                                     | 9,22                   |
|              | 3,720           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 703 100                 | Billets du Trésor américain 1,625 % - 3,500 %<br>échéance 15/08/2029 - 30/09/2029 | (716 887)           | 703 100                                           | 703 173                                                                        | 8,26                   |
| CEW          | 2,240           | 10/06/2026           | 02/07/2026         | CAD 200 000             | Province de l'Ontario 2,800 % échéance 02/06/2048                                 | (147 213)           | 140 969                                           | 141 152                                                                        | 1,66                   |
|              | 2,240           | 18/06/2026           | 02/07/2026         | 70 000                  | Province de l'Ontario 3,750 % échéance 02/12/2053                                 | (16 132)            | 49 339                                            | 49 379                                                                         | 0,58                   |
|              |                 |                      |                    |                         | Province du Québec 4,400 % échéance 01/12/2055                                    | (34 377)            |                                                   |                                                                                |                        |

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                                 | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
|                                       | 2,240 %      | 16/06/2026        | 07/07/2026      | CAD 450 000          | Province de l'Ontario 2,550 % - 2,900 %<br>échéance 02/12/2046 - 02/12/2052 | \$ (275 261)     | \$ 317 181                               | \$ 317 474                                                         | 3,73                |
|                                       |              |                   |                 |                      | Province du Québec 2,850 % échéance 01/12/2053                              | (51 715)         |                                          |                                                                    |                     |
|                                       | 2,240        | 25/06/2026        | 08/07/2026      | 102 508              | Province du Québec 3,500 % - 4,400 %<br>échéance 01/12/2045 - 01/12/2055    | (73 865)         | 72 252                                   | 72 279                                                             | 0,85                |
|                                       | 2,240        | 30/06/2026        | 08/07/2026      | 147 492              | Province de l'Ontario 3,450 % - 3,500 %<br>échéance 02/06/2043 - 02/06/2045 | (106 467)        | 103 959                                  | 103 965                                                            | 1,22                |
|                                       | 2,270        | 25/06/2026        | 02/07/2026      | 80 000               | Province de l'Ontario 2,800 % échéance 02/06/2048                           | (57 389)         | 56 388                                   | 56 409                                                             | 0,66                |
|                                       | 2,270        | 24/06/2026        | 08/07/2026      | 146 238              | Province du Québec 4,400 % échéance 01/12/2055                              | (103 130)        | 103 075                                  | 103 120                                                            | 1,21                |
|                                       |              |                   |                 |                      | Province de l'Ontario 4,650 % échéance 02/06/2041                           | (3 059)          |                                          |                                                                    |                     |
|                                       | 2,270        | 25/06/2026        | 08/07/2026      | 153 762              | Province du Québec 4,400 % échéance 01/12/2055                              | (110 810)        | 108 379                                  | 108 419                                                            | 1,27                |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                                             | \$ (2 496 046)   | \$ 2 438 642                             | \$ 2 439 450                                                       | 28,66               |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

##### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026           | 806                | \$ 879                            | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026           | 123                | (72)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 132                | (203)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026           | 242                | (25)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 6 722              | 2 208                             | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 10 692             | 4 011                             | 0,05                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 1 334              | (1 718)                           | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 708                | (1 793)                           | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 273                | (414)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 1 203              | 3 418                             | 0,04                |
|                                                                                               |       |                   |                    | \$ 6 291                          | 0,07                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | \$ 6 291                          | 0,07                |

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

##### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence          | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc.                   | 1,000 %              | 20/06/2028      | \$ 600                           | \$ 10                             | 0,00                |
| Barclays PLC                 | 1,000                | 20/12/2030      | € 12 500                         | (1)                               | 0,00                |
| Danske Bank A/S              | 1,000                | 20/12/2030      | 20 000                           | 37                                | 0,00                |
| Ford Motor Credit Co. LLC    | 5,000                | 20/06/2027      | \$ 200                           | (2)                               | 0,00                |
| Lloyds Banking Group PLC     | 1,000                | 20/12/2030      | € 16 600                         | (6)                               | 0,00                |
| Oracle Corp.                 | 1,000                | 20/06/2030      | \$ 2 800                         | (103)                             | 0,00                |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                | 20/06/2027      | € 1 100                          | 114                               | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 400                           | (8)                               | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/06/2028      | 3 400                            | 48                                | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2028      | 900                              | 15                                | 0,00                |
|                              |                      |                 |                                  | \$ 104                            | 0,00                |

##### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 9 108                         | \$ 437                            | 0,01                |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2027      | 800                              | 74                                | 0,00                |
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2028      | 100                              | 8                                 | 0,00                |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2028      | 3 000                            | 165                               | 0,00                |
| Indice CDX.EM-41 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2029      | 600                              | 27                                | 0,00                |
| Indice CDX.EM-42 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2029      | 700                              | 24                                | 0,00                |
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | 1,000                | 20/12/2030      | 300                              | 6                                 | 0,00                |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 36 860                           | 44                                | 0,00                |
| Indice CDX.HY-37 Index à 5 ans | 5,000                | 20/12/2026      | 2 185                            | (77)                              | 0,00                |



## Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans | 5,000 %                 | 20/12/2027         | \$ 480                              | \$ 15                                   | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/06/2030         | 980                                 | 7                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 26 186                              | 170                                     | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                   | 20/06/2031         | 122 800                             | 1 497                                   | 0,02                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 130 660                             | 47                                      | 0,00                   |
|                                |                         |                    |                                     | \$ 2 444                                | 0,03                   |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------|-----------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2028         | £ 91 200             | \$ 874                                  | 0,01                   |
| À payer                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2031         | 75 000               | (852)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,700     | 28/03/2034         | 1 400                | 68                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056         | 1 620                | 84                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 15/03/2029         | ¥ 8 473 000          | (16)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,176     | 27/04/2027         | 550 000              | 6                                       | 0,00                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 15/06/2032         | 1 467 200            | 106                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500     | 15/03/2042         | 702 000              | 196                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,700     | 18/09/2029         | 7 040 000            | 96                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,711     | 27/04/2042         | 130 000              | 38                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/09/2034         | 3 620 000            | 536                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 18/06/2035         | 732 000              | 145                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,500     | 16/06/2028         | \$ 10 869            | (237)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 15/06/2027         | 3 600                | (38)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 15/06/2029         | 4 070                | 103                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 16/12/2030         | 20 713               | 3 273                                   | 0,04                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,235     | 12/05/2028         | 1 100                | 67                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 17/06/2030         | 4 400                | 256                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 15/06/2032         | 22 690               | (1 432)                                 | (0,02)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 16/12/2050         | 12 600               | 5 106                                   | 0,06                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 16/06/2051         | 8 700                | 2 987                                   | 0,04                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,317     | 16/12/2050         | 400                  | (187)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,360     | 15/02/2027         | 6 700                | 120                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,360     | 20/07/2031         | 1 400                | 186                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,370     | 19/07/2031         | 900                  | 119                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,380     | 04/01/2027         | 3 600                | (52)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,418     | 20/01/2027         | 1 300                | (20)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,425     | 18/01/2027         | 2 500                | (35)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,438     | 22/01/2051         | 9 000                | (4 147)                                 | (0,05)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,450     | 17/02/2027         | 6 300                | 106                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,450     | 16/07/2031         | 2 000                | 261                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 15/12/2028         | 7 919                | (690)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 18/12/2029         | 1 200                | 69                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 17/06/2050         | 7 700                | 4 620                                   | 0,06                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,518     | 20/01/2029         | 800                  | (52)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,570     | 12/01/2027         | 1 400                | (18)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,580     | 16/02/2027         | 2 800                | (36)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,580     | 13/01/2051         | 9 300                | (4 141)                                 | (0,05)                 |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,600     | 15/02/2027         | 26 800               | (325)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,625     | 06/01/2030         | 300                  | 31                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,630     | 26/01/2029         | 1 300                | (80)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,700     | 17/02/2027         | 25 000               | (266)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,730     | 24/02/2032         | 1 600                | (181)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2029         | 3 538                | (1)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/01/2030         | 4 600                | 428                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2032         | 1 608                | 29                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2052         | 28 100               | 7 442                                   | 0,09                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,765     | 16/03/2032         | 600                  | (66)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,783     | 22/04/2027         | 2 100                | (37)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,785     | 12/08/2051         | 1 100                | 479                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,788     | 03/05/2027         | 2 300                | (41)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,815     | 24/01/2052         | 300                  | (124)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,867     | 26/01/2052         | 300                  | (121)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,910     | 17/10/2049         | 400                  | 166                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,988     | 09/02/2032         | 1 100                | 112                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 21/12/2027         | 2 100                | (72)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 10/12/2029         | 21 000               | 1 755                                   | 0,02                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 21/12/2029         | 11 170               | (326)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 12/02/2030         | 2 500                | 224                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 10/03/2030         | 1 200                | 87                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 21/12/2032         | 17 930               | 139                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,008     | 09/02/2032         | 1 900                | 196                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,250     | 12/03/2050         | 15 700               | 5 304                                   | 0,06                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,385     | 08/06/2032         | 1 400                | 100                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,436     | 08/06/2032         | 6 800                | 471                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,450     | 04/10/2027         | 5 430                | 160                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,451     | 08/06/2032         | 8 700                | 597                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,468     | 27/07/2028         | 1 500                | (30)                                    | 0,00                   |



| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable       | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------|-------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,537 %      | 24/07/2053         | \$ 400               | \$ (85)                                 | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,550        | 21/07/2053         | 400                  | (84)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,590        | 23/07/2026         | 11 300               | (1)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,675        | 24/07/2028         | 1 500                | (22)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,700        | 21/07/2028         | 1 500                | (21)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,900        | 04/10/2027         | 15 500               | (207)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000        | 17/06/2028         | 120 300              | (771)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000        | 19/03/2030         | 52 030               | (496)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000        | 21/06/2030         | 85 750               | 2 605                                   | 0,03                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000        | 21/06/2033         | 7 110                | 339                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000        | 21/06/2033         | 270                  | (10)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050        | 07/09/2027         | 1 400                | (18)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050        | 06/09/2032         | 2 000                | (92)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080        | 23/02/2053         | 1 200                | (211)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,231        | 18/09/2034         | 5 700                | 342                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,232        | 10/09/2034         | 3 250                | 199                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,248        | 18/09/2034         | 5 700                | 334                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250        | 21/06/2028         | 850                  | (3)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250        | 21/06/2028         | 42 970               | 611                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250        | 19/03/2032         | 36 840               | (104)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250        | 18/06/2032         | 5 190                | 118                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250        | 19/03/2055         | 45 200               | 836                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300        | 28/02/2029         | 2 390                | 42                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300        | 30/06/2031         | 5 610                | 194                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300        | 06/03/2033         | 2 000                | (70)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300        | 15/11/2053         | 1 900                | 301                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,325        | 31/08/2030         | 40 350               | 715                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,328        | 30/04/2031         | 1 870                | 49                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350        | 14/12/2032         | 500                  | 20                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,368        | 15/11/2049         | 820                  | 109                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370        | 01/03/2033         | 2 000                | (59)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370        | 12/07/2053         | 2 800                | (381)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,375        | 15/10/2034         | 6 100                | (253)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,395        | 17/10/2034         | 10 900               | (437)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400        | 23/02/2033         | 3 200                | (89)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405        | 01/03/2033         | 2 100                | (58)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,410        | 05/09/2034         | 3 700                | 173                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420        | 24/05/2033         | 7 600                | (207)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430        | 27/02/2033         | 2 100                | (55)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,431        | 30/04/2031         | 3 070                | 66                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,446        | 23/10/2034         | 3 700                | (136)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450        | 07/03/2033         | 3 900                | (99)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450        | 11/10/2034         | 6 100                | (217)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,463        | 23/10/2034         | 6 600                | (232)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,464        | 15/11/2049         | 1 220                | 145                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,465        | 30/10/2034         | 13 700               | (475)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,481        | 29/10/2034         | 6 800                | (228)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,495        | 30/10/2034         | 6 400                | (207)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 20/12/2030         | 45 820               | 326                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 18/03/2031         | 71 410               | 1 917                                   | 0,02                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 22/05/2033         | 29 710               | 136                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 17/06/2033         | 168 740              | (660)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 17/06/2033         | 9 590                | 86                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 21/06/2033         | 8 100                | (179)                                   | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>               | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 16/09/2033         | 122 430              | 491                                     | 0,01                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 20/12/2033         | 2 500                | 28                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 20/06/2054         | 19 500               | 753                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500        | 17/09/2055         | 27 400               | 568                                     | 0,01                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,510        | 30/11/2028         | 1 500                | 18                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,514        | 04/09/2034         | 7 400                | 284                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,515        | 30/11/2028         | 2 360                | 28                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,515        | 06/11/2034         | 12 300               | (375)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,527        | 15/11/2049         | 540                  | 59                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,532        | 20/08/2034         | 5 800                | 214                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,545        | 31/10/2030         | 4 100                | 66                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,550        | 31/10/2030         | 8 300                | 131                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,551        | 17/09/2035         | 5 100                | 202                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,555        | 05/03/2054         | 1 300                | (129)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,558        | 21/08/2034         | 6 600                | 229                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,564        | 31/01/2033         | 1 990                | 42                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,569        | 14/08/2034         | 6 400                | 217                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,572        | 31/10/2030         | 9 000                | 133                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,582        | 31/10/2030         | 16 400               | 235                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,594        | 09/01/2034         | 2 800                | 66                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,595        | 19/08/2034         | 6 300                | 202                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600        | 17/01/2034         | 1 400                | 39                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,601        | 31/10/2030         | 8 300                | 112                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,602        | 31/10/2030         | 27 100               | 362                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,606        | 31/10/2030         | 8 400                | 111                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610        | 12/12/2032         | 1 100                | 26                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,613        | 22/08/2034         | 5 800                | 177                                     | 0,00                   |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,623 %   | 31/10/2030      | \$ 9 000          | \$ 112                            | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,645     | 07/08/2034      | 5 800             | 163                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,648     | 08/01/2034      | 2 700             | 66                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 10/07/2033      | 4 600             | (81)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 05/03/2034      | 3 400             | (54)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,664     | 31/10/2030      | 7 300             | 77                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,665     | 24/01/2034      | 2 600             | (38)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,670     | 08/01/2034      | 2 900             | 67                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,677     | 31/10/2030      | 5 900             | 59                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 13/08/2034      | 5 700             | 146                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 15/02/2036      | 3 580             | 94                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684     | 03/01/2034      | 1 300             | 28                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,685     | 24/01/2034      | 2 600             | (35)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,687     | 31/10/2030      | 7 600             | 72                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,691     | 31/10/2030      | 11 600            | 107                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 06/06/2033      | 66 350            | 1 488                             | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,710     | 05/03/2034      | 3 300             | (41)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,721     | 31/10/2030      | 7 300             | 57                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,722     | 31/10/2030      | 7 300             | 57                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,725     | 07/02/2034      | 1 500             | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,727     | 31/10/2030      | 7 300             | 55                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730     | 03/08/2033      | 1 400             | (16)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,732     | 31/10/2030      | 4 900             | 36                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 31/10/2030      | 7 300             | 53                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 07/08/2033      | 1 600             | (17)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 23/01/2034      | 1 300             | (13)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,738     | 23/01/2034      | 800               | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,739     | 31/10/2030      | 7 300             | 51                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,749     | 31/10/2030      | 7 300             | 48                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/12/2028      | 51 850            | 244                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 9 700             | 170                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 110 210           | (100)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 255 080           | 4 494                             | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      | 218 810           | 4 501                             | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 24 280            | 455                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 46 220            | 1 214                             | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 109 200           | 3 075                             | 0,04                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 118 860           | 1 830                             | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 15/05/2032      | 51 340            | 497                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2032      | 174 870           | 4 171                             | 0,05                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2032      | 90 080            | 2 371                             | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/03/2033      | 426 292           | 9 667                             | 0,11                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 12/07/2033      | 4 000             | (41)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 02/01/2034      | 1 300             | 22                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 7 160             | 84                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 6 920             | 152                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 49 030            | (995)                             | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 07/05/2035      | 9 100             | (114)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035      | 53 200            | 1 502                             | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 6 480             | 241                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 16/09/2036      | 90 400            | 448                               | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,755     | 15/02/2036      | 7 410             | 148                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,783     | 07/02/2034      | 1 300             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,795     | 06/08/2034      | 5 800             | 98                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 10/03/2028      | 2 000             | (2)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 22/08/2030      | 1 200             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810     | 02/01/2034      | 1 300             | 17                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,840     | 08/01/2035      | 4 100             | (27)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 05/08/2034      | 6 100             | 77                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854     | 29/12/2033      | 2 600             | 25                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 21/02/2034      | 6 200             | (7)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,865     | 20/11/2034      | 6 800             | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 05/03/2035      | 2 300             | 25                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,874     | 05/03/2035      | 4 600             | 49                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,899     | 11/03/2035      | 7 500             | 66                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 30/08/2033      | 2 400             | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 10/04/2034      | 3 100             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 15/04/2034      | 1 600             | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 08/01/2035      | 4 100             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,908     | 04/03/2035      | 4 400             | 36                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 22/02/2029      | 9 100             | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 19/12/2033      | 2 900             | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 27/02/2029      | 3 100             | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,975     | 15/11/2053      | 4 200             | 80                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,994     | 02/07/2034      | 4 800             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 1 200             | 42                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 30 450            | (43)                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 15/02/2036      | 2 370             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,010     | 15/11/2053      | 1 090             | 36                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 30/12/2034      | 7 000             | 53                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 15/11/2053      | 1 090             | 35                                | 0,00                |

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir |                               | Taux<br>fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------|-------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
|                                         | Indice de taux variable       |              |                    |                      |                                         |                        |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 %      | 04/10/2033         | \$ 4 900             | \$ 51                                   | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030        | 15/12/2033         | 2 600                | (7)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,052        | 15/02/2056         | 1 690                | 39                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,059        | 15/02/2056         | 1 790                | 39                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060        | 02/07/2034         | 3 400                | (14)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,066        | 15/02/2046         | 1 360                | 29                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,071        | 15/01/2035         | 6 700                | 75                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,076        | 15/02/2046         | 3 080                | 61                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,078        | 29/04/2034         | 3 300                | 38                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080        | 17/04/2034         | 3 100                | 38                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,082        | 15/11/2053         | 900                  | 19                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,083        | 15/11/2053         | 1 400                | 30                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085        | 22/04/2034         | 3 100                | 41                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085        | 15/11/2053         | 12 284               | 247                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090        | 30/04/2034         | 3 300                | 41                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,100        | 21/01/2035         | 3 400                | 46                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,130        | 03/05/2034         | 3 200                | 48                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150        | 12/10/2033         | 2 400                | 46                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175        | 10/10/2033         | 2 400                | 50                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200        | 18/10/2033         | 2 000                | 45                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220        | 20/10/2033         | 2 400                | 57                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230        | 23/10/2033         | 1 300                | 32                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250        | 20/03/2029         | 2 100                | 51                                      | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250        | 20/03/2031         | 4 210                | 130                                     | 0,00                   |
| À recevoir                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250        | 22/11/2033         | 2 600                | (46)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255        | 23/10/2033         | 1 300                | 34                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393        | 25/10/2033         | 1 200                | 43                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435        | 01/11/2033         | 1 300                | 51                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450        | 01/11/2033         | 2 600                | 106                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 9,998        | 04/01/2027         | BRL 12 000           | (213)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,037       | 04/01/2027         | 2 800                | (49)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,041       | 04/01/2027         | 11 300               | (199)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,072       | 04/01/2027         | 6 980                | (105)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,090       | 04/01/2027         | 21 200               | (367)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,098       | 04/01/2027         | 21 120               | (315)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,138       | 04/01/2027         | 5 300                | (90)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,165       | 04/01/2027         | 10 710               | (156)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,170       | 04/01/2027         | 17 870               | (260)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,183       | 04/01/2027         | 32 100               | (465)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,203       | 04/01/2027         | 25 010               | (360)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,210       | 04/01/2027         | 3 600                | (52)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,256       | 04/01/2027         | 24 990               | (353)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 10,328       | 04/01/2027         | 35 470               | (488)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,250       | 04/01/2027         | 200                  | (3)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,275       | 04/01/2027         | 100                  | (2)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,290       | 04/01/2027         | 100                  | (2)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,746       | 04/01/2027         | 200                  | (2)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 11,901       | 04/01/2027         | 500                  | (5)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 12,047       | 04/01/2027         | 57 400               | (495)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 12,800       | 02/01/2031         | 139 500              | (919)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 12,841       | 02/01/2031         | 50 700               | (327)                                   | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,245       | 02/01/2031         | 3 500                | (13)                                    | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,255       | 02/01/2031         | 31 900               | (112)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,291       | 02/01/2029         | 33 600               | (147)                                   | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,350       | 02/01/2031         | 7 600                | (25)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,354       | 02/01/2029         | 66 800               | (281)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,435       | 02/01/2031         | 2 540                | (7)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,440       | 02/01/2031         | 2 560                | (7)                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,520       | 02/01/2031         | 23 900               | (59)                                    | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,560       | 02/01/2031         | 13 500               | (30)                                    | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | CDI BRL à un an               | 13,670       | 02/01/2031         | 3 200                | (5)                                     | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,724       | 02/01/2031         | 415 400              | (518)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,790       | 02/01/2031         | 110 100              | (103)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,882       | 02/01/2031         | 540 900              | (277)                                   | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 13,927       | 04/01/2027         | 51 300               | (84)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | CDI BRL à un an               | 14,009       | 04/01/2027         | 36 500               | (50)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | BBR NZD à 3 mois              | 4,750        | 19/06/2029         | NZD 14 100           | 216                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                  | JIBAR ZAR à 3 mois            | 6,770        | 10/03/2028         | 21 400               | (12)                                    | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,000        | 03/01/2031         | 9 700                | 16                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,001        | 06/01/2031         | 9 700                | 16                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,010        | 07/01/2031         | 9 500                | 17                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,030        | 07/01/2031         | 9 500                | 17                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,053        | 07/01/2031         | 9 500                | 17                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,058        | 07/01/2031         | 9 500                | 17                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,063        | 08/01/2031         | 9 500                | 18                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,080        | 08/01/2031         | 32 800               | 62                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,203        | 10/01/2031         | 9 500                | 21                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,360        | 07/08/2028         | 37 400               | 52                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,380        | 04/08/2028         | 35 400               | 51                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,410        | 31/07/2028         | 24 200               | 36                                      | 0,00                   |
| À payer                                 | JIBAR ZAR à 3 mois            | 8,410        | 07/08/2028         | 5 500                | 8                                       | 0,00                   |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/<br>à recevoir               | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,415 %   | 31/07/2028      | ZAR 6 500         | \$ 10                                   | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,415     | 04/08/2028      | 9 000             | 13                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,420     | 31/07/2028      | 24 200            | 36                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,421     | 04/08/2028      | 12 400            | 18                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,426     | 01/08/2028      | 9 800             | 15                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,460     | 01/08/2028      | 16 500            | 25                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,460     | 02/08/2028      | 16 700            | 25                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,543     | 04/08/2028      | 9 100             | 15                                      | 0,00                |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,550     | 03/08/2028      | 19 800            | 33                                      | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 3,000     | 21/03/2027      | AUD 12 400        | (404)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 20/09/2033      | 6 500             | (49)                                    | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 20/03/2034      | 19 100            | (127)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 18/09/2034      | 6 800             | (170)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 18/06/2035      | 98 700            | (2 676)                                 | (0,03)              |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,480     | 11/03/2036      | CZK 5 100         | 6                                       | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,250     | 18/03/2050      | € 2 500           | 1 272                                   | 0,02                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,500     | 17/06/2050      | 600               | 328                                     | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,650     | 11/05/2027      | 14 200            | (213)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,700     | 11/04/2027      | 4 800             | (79)                                    | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,830     | 09/12/2052      | 27 100            | 3 375                                   | 0,04                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 1,000     | 13/05/2027      | 9 800             | (145)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 1,000     | 18/05/2027      | 4 700             | (71)                                    | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 1,750     | 21/09/2027      | 3 500             | (10)                                    | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,280     | 04/03/2030      | 5 400             | 94                                      | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,380     | 31/12/2034      | 3 600             | (90)                                    | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 09/04/2030      | 4 800             | 73                                      | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 12/02/2035      | 4 700             | 195                                     | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,420     | 07/03/2035      | 2 700             | (94)                                    | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,460     | 13/03/2035      | 4 600             | (145)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,460     | 01/04/2035      | 2 800             | (95)                                    | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 17 100            | (241)                                   | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,510     | 09/04/2035      | 2 700             | 96                                      | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 27/03/2035      | 2 700             | (76)                                    | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 09/04/2035      | 2 900             | 101                                     | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,547     | 09/03/2033      | 4 900             | 38                                      | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,590     | 19/08/2034      | 3 600             | 24                                      | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,650     | 14/08/2029      | 2 900             | (42)                                    | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 05/03/2034      | 2 200             | 1                                       | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 9 990             | 21                                      | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 04/03/2034      | 2 200             | 2                                       | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 16/04/2029      | 3 300             | 14                                      | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,780     | 02/05/2029      | 3 200             | 14                                      | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,827     | 06/05/2029      | 6 800             | 37                                      | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,950     | 12/06/2029      | 2 700             | 26                                      | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 22 850            | 9                                       | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,270     | 21/08/2033      | 1 600             | 100                                     | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,450     | 20/10/2028      | 2 900             | 124                                     | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      | MXN 124 800       | (46)                                    | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      | 59 900            | (56)                                    | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,990     | 18/12/2029      | 15 900            | 44                                      | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,135     | 27/12/2029      | 30 800            | 93                                      | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,000     | 15/09/2031      | £ 900             | (126)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,020     | 15/10/2031      | 1 200             | (157)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,055     | 15/09/2031      | 800               | (110)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,066     | 15/09/2031      | 1 700             | (202)                                   | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,140     | 15/10/2031      | 2 300             | (258)                                   | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ 64 057                               | 0,75                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ 66 605                               | 0,78                |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## OPTIONS ACHETÉES

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,110 %         | 26/07/2032        | 1 100                            | \$ 178   | \$ 52        | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,110           | 26/07/2032        | 1 600                            | 259      | 518          | 0,01                |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,170           | 19/07/2032        | 1 200                            | 190      | 56           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,170           | 19/07/2032        | 1 400                            | 222      | 443          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,400           | 20/07/2027        | 1 200                            | 159      | 8            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 2,400           | 20/07/2027        | 1 400                            | 185      | 417          | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 1 193 | \$ 1 494     | 0,02                |

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable       | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| MYC          | Option d'achat - Taux d'intérêt plafond à 2 ans hors cote   | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,026 %         | 23/07/2026        | 11 300                           | \$ (200) | \$ (31)      | 0,00                |
|              | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,026           | 23/07/2026        | 11 300                           | (200)    | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                               |                 |                   |                                  | \$ (400) | \$ (31)      | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                    | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000 %              | 20/12/2027      | \$ 500                           | \$ (45)                | \$ 48                            | \$ 3         | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2026      | 900                              | (41)                   | 44                               | 3            | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 400                              | (14)                   | 16                               | 2            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement israélien    | 1,000                | 20/06/2030      | 1 400                            | (19)                   | 48                               | 29           | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                    | 1,000                | 20/12/2026      | 3 100                            | (30)                   | 33                               | 3            | 0,00                |
| DUB          | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/12/2026      | 100                              | (5)                    | 5                                | 0            | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 500                              | (18)                   | 20                               | 2            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2027      | 300                              | (27)                   | 29                               | 2            | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement israélien    | 1,000                | 20/06/2030      | 1 400                            | (15)                   | 44                               | 29           | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/06/2027      | 700                              | (27)                   | 30                               | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien    | 1,000                | 20/12/2027      | 800                              | (71)                   | 75                               | 4            | 0,00                |
|              | Petroleos Mexicanos                                    | 1,000                | 20/06/2027      | 2 400                            | (30)                   | 30                               | 0            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000                | 20/12/2026      | 1 400                            | (62)                   | 68                               | 6            | 0,00                |
|              |                                                        |                      |                 |                                  | \$ (404)               | \$ 490                           | \$ 86        | 0,00                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 7 190                          | \$ 1 631               | \$ (101)                         | \$ 1 530     | 0,02                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 5 780                            | 1 328                  | (98)                             | 1 230        | 0,01                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 1 900                            | 431                    | (27)                             | 404          | 0,01                |
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | \$ 2 300                         | 92                     | 262                              | 354          | 0,00                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | € 6 910                          | 1 582                  | (112)                            | 1 470        | 0,02                |
| MEI          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | \$ 15 300                        | (74)                   | 120                              | 46           | 0,00                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 15 442                           | 0                      | 14                               | 14           | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 25 365                           | 0                      | 74                               | 74           | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 300                              | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index                       | 0,500                | 16/12/2072      | 25 500                           | 0                      | 145                              | 145          | 0,00                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 4 990               | \$ 278                           | \$ 5 268     | 0,06                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À payer            | Nvidia Corp. | 2 325                        | 5,620 %       | \$ 448            | 29/07/2026      | \$ 0                   | \$ (18)                          | \$ (18)      | 0,00                |



# Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 66 670      | \$ 47 674         | \$ 1 485           | \$ 0                  | \$ 1 485                                | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH 3 385       | 501               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 17 761      | 10 489            | 386                | 0                     | 386                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 050        | 14 250            | 56                 | 0                     | 56                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 321             | SGD 409           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 14 250      | \$ 8 059          | 0                  | (56)                  | (56)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 417         | 80                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 134           | 179               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 3 252       | 34                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 236 588     | 155               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | NOK 9 260       | 936               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 59          | 46                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 884        | CNH 19 502        | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 356           | € 2 883           | 0                  | (60)                  | (60)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 107           | ¥ 176 123         | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 985           | NOK 18 440        | 0                  | (122)                 | (122)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 321             | PLN 1 211         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 4 606       | \$ 1 549          | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 29 314       | BRL 149 752       | 0                  | (607)                 | (607)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | INR 17 559      | \$ 185            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 09/2026           | MXN 7 076       | 399               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 34           | INR 3 274         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 7 041           | MXN 123 922       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 117 531     | \$ 81 728         | 546                | (243)                 | 303                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 9 057       | 1 749             | 6                  | (6)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 2 457       | 3 123             | 77                 | 0                     | 77                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 10 373      | 1 533             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 2 733       | 131               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 1 207 135     | 1 403 590         | 24 112             | (640)                 | 23 472                                  | 0,28                |
|              | 07/2026           | £ 69 515        | 92 970            | 706                | 0                     | 706                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR 335 161 006 | 18 701            | 15                 | (11)                  | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 6 952       | 2 359             | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 604 131     | 6 290             | 0                  | (92)                  | (92)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 1 385 542   | 909               | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 2 220       | 226               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 87 666      | 2 672             | 36                 | (5)                   | 31                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 406          | BRL 2 049         | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 788           | CNY 12 195        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7 970           | £ 6 023           | 36                 | (12)                  | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 18 357          | INR 1 740 506     | 37                 | (34)                  | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 758           | ¥ 759 255         | 0                  | (87)                  | (87)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 495           | KRW 6 896 618     | 0                  | (40)                  | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 293             | KWD 89            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 387             | TWD 12 226        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 055           | ZAR 82 932        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 181       | \$ 396            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2 929        | BRL 14 917        | 0                  | (69)                  | (69)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 12 116          | ¥ 1 956 300       | 0                  | (48)                  | (48)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 3 462 488   | \$ 950            | 0                  | (37)                  | (37)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 24 770 390  | 1 362             | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 73 473      | 2 265             | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 8 969        | IDR 158 705 124   | 10                 | (181)                 | (171)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 088           | INR 103 333       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 449             | THB 14 727        | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | 662             | IDR 12 044 892    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | 228             | KWD 69            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2029           | KWD 131         | \$ 450            | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
|              | 05/2030           | 733             | 2 523             | 129                | 0                     | 129                                     | 0,00                |
|              | 08/2030           | 318             | 1 071             | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
|              | 01/2031           | 1 445           | 4 871             | 143                | 0                     | 143                                     | 0,00                |
| BRC          | 06/2031           | 666             | 2 242             | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 765 499     | 548 586           | 8 913              | 0                     | 8 913                                   | 0,10                |
|              | 07/2026           | ILS 8 541       | 2 886             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 898         | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 25 798      | 15 257            | 581                | 0                     | 581                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD 3           | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY 331 524     | 6 911             | 0                  | (91)                  | (91)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 32 646       | TRY 1 556 470     | 384                | 0                     | 384                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 25 216          | ZAR 409 579       | 0                  | (266)                 | (266)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 2 451 697   | \$ 649            | 0                  | (56)                  | (56)                                    | 0,00                |
| BSH          | 08/2026           | \$ 12           | ¥ 1 893           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 21 141        | \$ 24 628         | 457                | 0                     | 457                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 19 856       | ¥ 3 157 010       | 0                  | (431)                 | (431)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 13 946          | NZD 24 683        | 95                 | 0                     | 95                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 24 683      | \$ 13 961         | 0                  | (95)                  | (95)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 37 686 640  | 9 658             | 0                  | (1 083)               | (1 083)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 7 228 020       | 1 896             | 0                  | (195)                 | (195)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 7 752       | 2 668             | 65                 | 0                     | 65                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 372 531     | 3 948             | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 10 520      | 1 134             | 71                 | 0                     | 71                                      | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | \$ 3 717        | AUD 5 259         | \$ 0               | \$ (73)               | \$ (73)                                 | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 583           | CAD 11 913        | 0                  | (186)                 | (186)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 613           | COP 12 563 439    | 27                 | (10)                  | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 323           | £ 986             | 0                  | (14)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 543           | IDR 63 573 615    | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 844           | INR 372 531       | 91                 | 0                     | 91                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 474             | KRW 716 886       | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 627           | PLN 5 947         | 0                  | (45)                  | (45)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 69              | SEK 637           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 138             | TWD 4 379         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 148           | ZAR 101 247       | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 10 685      | \$ 3 694          | 105                | 0                     | 105                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 940          | ILS 2 791         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 55 950 989  | \$ 14 847         | 0                  | (1 100)               | (1 100)                                 | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR 86 177 310  | 4 774             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 39 603      | 412               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 5 780       | 1 672             | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 93 817      | 2 833             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 806        | IDR 32 202 889    | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 832             | MXN 14 888        | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP 5 832 322   | \$ 1 653          | 9                  | (2)                   | 7                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 22 175      | 6 522             | 46                 | 0                     | 46                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 7 071 015   | 1 960             | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 1 231        | IDR 22 386 086    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 27 046          | PEN 94 539        | 502                | 0                     | 502                                     | 0,01                |
|              | 01/2027           | PEN 19 824      | \$ 5 817          | 48                 | 0                     | 48                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 2 953       | 142               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 8 545 936   | 478               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 124 449     | 1 318             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 879          | INR 84 829        | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 596             | NOK 5 541         | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 626           | PLN 6 032         | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 11 765          | ZAR 190 457       | 0                  | (163)                 | (163)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 79 366 892  | \$ 4 405          | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 108        | IDR 20 125 952    | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 318           | INR 125 292       | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CAD 300 261     | \$ 211 622        | 0                  | (70)                  | (70)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 10 319      | 1 525             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 249 692       | 335 494           | 4 090              | 0                     | 4 090                                   | 0,05                |
|              | 07/2026           | INR 122 021     | 1 293             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 15 532 754    | 95 999            | 428                | 0                     | 428                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | PEN 34 709      | 10 362            | 195                | 0                     | 195                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 379         | 39                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 53 873      | 42 228            | 577                | 0                     | 577                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 7 878        | CAD 10 969        | 0                  | (146)                 | (146)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 307           | CNH 22 494        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 110 673         | £ 83 659          | 364                | 0                     | 364                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 279           | INR 122 021       | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 150           | ¥ 659 499         | 0                  | (93)                  | (93)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 560           | PLN 24 098        | 0                  | (149)                 | (149)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4               | SGD 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16 441          | ZAR 271 325       | 87                 | 0                     | 87                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 22 444      | \$ 3 307          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 7 466 371   | 1 978             | 0                  | (171)                 | (171)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 83 659        | 110 670           | 0                  | (365)                 | (365)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 4 446       | 1 553             | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 5           | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 95 999       | ¥ 15 492 109      | 0                  | (430)                 | (430)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 39              | SEK 378           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 19 772          | BRL 101 769       | 0                  | (402)                 | (402)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 625             | INR 59 871        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 676             | MXN 11 928        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| GLM          | 03/2027           | COP 68 468 017  | \$ 16 850         | 0                  | (1 840)               | (1 840)                                 | (0,02)              |
|              | 07/2026           | BRL 148 371     | 28 796            | 130                | 0                     | 130                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 1 350 605   | 875               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 29 225       | BRL 151 473       | 494                | (454)                 | 40                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 493           | COP 5 244 663     | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 363           | IDR 60 290 844    | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 875             | KRW 1 350 413     | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 4 763           | BRL 24 338        | 0                  | (97)                  | (97)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 863             | INR 82 735        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 60 643 914  | \$ 3 363          | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 3 279       | 189               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 189 124     | 5 860             | 132                | 0                     | 132                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 35 137       | BRL 183 229       | 0                  | (263)                 | (263)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 5 169           | IDR 92 816 251    | 11                 | (35)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 3 499           | INR 336 496       | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 32 415          | MXN 568 899       | 0                  | (63)                  | (63)                                    | 0,00                |
| JPM          | 11/2026           | COP 5 399 659   | \$ 1 493          | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 283 464     | 202 075           | 5 691              | 0                     | 5 691                                   | 0,07                |
|              | 07/2026           | CAD 80 035      | 56 256            | 0                  | (157)                 | (157)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 21 861      | 7 321             | 0                  | (17)                  | (17)                                    | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | INR 48 063      | \$ 509            | \$ 2               | \$ 0                  | \$ 2                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 417 345     | 270               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 11 357      | 1 147             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 639         | 378               | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 330         | 259               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 703        | £ 1 269           | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 519             | IDR 9 330 503     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 509             | INR 48 063        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 404             | KRW 619 832       | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 268           | NZD 2 248         | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 225           | PLN 19 071        | 1                  | (153)                 | (152)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 894           | THB 63 319        | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 17 504      | \$ 6 012          | 132                | 0                     | 132                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 084        | BRL 36 933        | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 147           | NOK 11 362        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 4 194 922   | \$ 1 149          | 0                  | (46)                  | (46)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 9 684 696   | 536               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 246 554     | 2 586             | 1                  | (2)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 16 846      | 955               | 1                  | (4)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 160 941     | 4 922             | 66                 | (19)                  | 47                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 673        | INR 159 605       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 3 860           | MXN 67 405        | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | 45 865          | 805 304           | 0                  | (396)                 | (396)                                   | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | AUD 31 446      | \$ 21 700         | 27                 | (113)                 | (86)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 70 060      | 49 955            | 573                | 0                     | 573                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF 22 363      | 28 377            | 678                | (25)                  | 653                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | COP 11 493 014  | 3 034             | 0                  | (284)                 | (284)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 75 736        | 87 822            | 1 233              | 0                     | 1 233                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR 829 638     | 46                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 124 941     | 1 323             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 4 072 243   | 2 686             | 56                 | 0                     | 56                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 3 746       | 378               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 231         | 24                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 103 517      | AUD 149 768       | 394                | (151)                 | 243                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 15 311          | CAD 21 264        | 0                  | (324)                 | (324)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 448 715       | € 1 275 188       | 9 407              | (199)                 | 9 208                                   | 0,11                |
|              | 07/2026           | 2 861           | £ 2 133           | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 040           | INR 196 624       | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 18 514          | ¥ 2 941 693       | 0                  | (414)                 | (414)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 1 420           | NOK 13 167        | 0                  | (89)                  | (89)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 702           | NZD 3 017         | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 140 533     | \$ 96 907         | 0                  | (397)                 | (397)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 1 261 257     | 1 434 502         | 0                  | (9 426)               | (9 426)                                 | (0,11)              |
|              | 08/2026           | ILS 506         | 169               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 128          | NOK 1 277         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 24              | SEK 231           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 1 760       | \$ 100            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 57 340      | 1 717             | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
| MYI          | 09/2026           | \$ 5 525        | INR 528 628       | 26                 | (7)                   | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 131           | \$ 149            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 16            | 21                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 11          | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 164          | € 143             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 54              | £ 40              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6               | SGD 8             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN 19 824      | \$ 5 727          | 0                  | (49)                  | (49)                                    | 0,00                |
| NSL          | 01/2027           | \$ 5 717        | PEN 19 824        | 52                 | 0                     | 52                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 130           | IDR 55 806 465    | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 063           | INR 198 451       | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 718           | TRY 127 775       | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 56 119 440  | \$ 3 130          | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
| RYL          | 09/2026           | \$ 1 105        | IDR 19 660 574    | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | CAD 12 544      | \$ 8 979          | 137                | 0                     | 137                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥8              | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 2           | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 185        | CNY 28 563        | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 206           | IDR 21 641 652    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 715           | INR 260 220       | 32                 | 0                     | 32                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 145           | 205 499           | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | 0               | ¥ 8               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 63 148 775  | \$ 3 498          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 67 132      | 2 079             | 46                 | 0                     | 46                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 2 817        | IDR 50 567 104    | 4                  | (18)                  | (14)                                    | 0,00                |
| SOG          | 11/2026           | NGN 181 160     | \$ 112            | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 17 918      | 2 649             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 575           | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 13 795      | 4 082             | 39                 | 0                     | 39                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 79          | 61                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 143 768      | AUD 208 360       | 583                | 0                     | 583                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | 784             | CHF 634           | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 87              | € 75              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 116 993         | £ 88 457          | 411                | 0                     | 411                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 48 217          | ¥ 7 660 123       | 0                  | (1 085)               | (1 085)                                 | (0,01)              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ 41 651       | SGD 53 938        | \$ 50              | \$ 0                  | \$ 50                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 208 360     | \$ 143 676        | 0                  | (591)                 | (591)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CHF 632         | 784               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 88 457        | 116 990           | 0                  | (412)                 | (412)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | SGD 53 817      | 41 651            | 0                  | (52)                  | (52)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 4            | ¥ 574             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 61              | SGD 79            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF 834         | \$ 1 061          | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 3           | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 123        | ¥ 181 500         | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 17 249 598  | \$ 4 522          | 0                  | (427)                 | (427)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 26 139        | 29 841            | 0                  | (84)                  | (84)                                    | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | CAD 213 891     | 153 500           | 2 740              | 0                     | 2 740                                   | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$ 1 655        | PLN 6 047         | 0                  | (46)                  | (46)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 14 291 345  | \$ 3 785          | 0                  | (329)                 | (329)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | 74 263 571      | 19 245            | 0                  | (1 922)               | (1 922)                                 | (0,02)              |
|              | 09/2026           | MXN 6 545       | 373               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 10 133      | 309               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$ 30 989       | CHF 25 020        | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 24 931      | \$ 30 989         | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 68 817          | \$ (28 439)           | \$ 40 378                               | 0,48                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation, Institutions en AUD (couverte) de distribution, Investisseurs en AUD (couverte) de capitalisation, Investisseurs en AUD (couverte) de distribution et H Institutions en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 40 736      | \$ 28 087         | \$ 0               | \$ (134)              | \$ (134)                                | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 44 217       | AUD 62 088        | 0                  | (1 203)               | (1 203)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 28 069          | 40 736            | 136                | 0                     | 136                                     | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD 485         | \$ 346            | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 916        | AUD 2 757         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 14 082          | 20 007            | 0                  | (221)                 | (221)                                   | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | AUD 39 511      | \$ 27 445         | 71                 | 0                     | 71                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 34 783       | AUD 48 806        | 0                  | (970)                 | (970)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 27 427          | 39 511            | 0                  | (70)                  | (70)                                    | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | AUD 908         | \$ 649            | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10           | AUD 15            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 4 780           | 6 693             | 0                  | (144)                 | (144)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | AUD 38 507      | \$ 26 739         | 62                 | 0                     | 62                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 45 587       | AUD 63 904        | 0                  | (1 314)               | (1 314)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 26 723          | 38 507            | 0                  | (61)                  | (61)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 64 917      | \$ 45 409         | 435                | 0                     | 435                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 1 084        | AUD 1 521         | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 45 380          | 64 917            | 0                  | (432)                 | (432)                                   | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | AUD 39 580      | \$ 27 253         | 0                  | (168)                 | (168)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 664        | AUD 3 792         | 5                  | (42)                  | (37)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 27 154          | 39 461            | 169                | 0                     | 169                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 20              | 28                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           | 231 911         | 336 231           | 1 030              | 0                     | 1 030                                   | 0,01                |
| SCX          | 07/2026           | 231 915         | 336 231           | 1 026              | 0                     | 1 026                                   | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | 10 696          | 15 033            | 0                  | (281)                 | (281)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 53          | \$ 37             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | \$ 231 918      | AUD 336 231       | 1 023              | 0                     | 1 023                                   | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3 987           | \$ (5 076)            | \$ (1 089)                              | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | \$ 3 580        | CHF 2 798         | \$ 0               | \$ (111)              | \$ (111)                                | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | CHF 14          | \$ 17             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 929        | CHF 3 078         | 0                  | (114)                 | (114)                                   | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 32              | 25                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 34          | \$ 42             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | 3 044           | 3 763             | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 70           | CHF 55            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 3 763           | 3 033             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CHF 60          | \$ 74             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 866        | CHF 3 039         | 0                  | (99)                  | (99)                                    | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | CHF 3 036       | \$ 3 760          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 3 760        | CHF 3 025         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 14              | \$ (341)              | \$ (327)                                | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | €               | 655               | \$ 763             | \$ 13                 | \$ 13                                   | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 96                | 109                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 728 635           | € 625 524          | 17                    | (13 491)                                | (0,16)              |
| BSH          | 07/2026           |                 | 682 072           | 585 003            | 0                     | (13 238)                                | (0,15)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 10 067            | 8 631              | 0                     | (199)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | 600 929           | \$ 685 358         | 0                     | (1 684)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$              | 686 282           | € 600 929          | 1 680                 | 0                                       | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | €               | 642 185           | \$ 729 466         | 48                    | (4 793)                                 | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$              | 48 928            | € 42 295           | 0                     | (572)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 727 085           | 639 289            | 4 792                 | 0                                       | 0,06                |
| SOG          | 07/2026           | €               | 639 004           | \$ 726 867         | 0                     | (3 706)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$              | 724 795           | € 621 321          | 0                     | (14 440)                                | (0,17)              |
|              | 08/2026           |                 | 727 853           | 639 004            | 3 700                 | 0                                       | 0,04                |
| SSB          | 07/2026           |                 | 109               | 96                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 96                | \$ 109             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 10 250          | \$ (52 123)           | \$ (41 873)                             | (0,49)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et Investisseurs en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 110 906           | £ 82 610           | \$ 0                  | \$ (1 262)                              | (0,02)              |
| BPS          | 07/2026           | £               | 76 060            | \$ 100 308         | 0                     | (642)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 122 260           | £ 91 233           | 0                     | (1 171)                                 | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 100 305           | 76 060             | 643                   | 0                                       | 0,01                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 95                | 72                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £               | 513               | \$ 679             | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 369             | £ 4 736            | 0                     | (83)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 679               | 513                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           |                 | 119 928           | 89 375             | 0                     | (1 305)                                 | (0,02)              |
| MBC          | 07/2026           |                 | 6 524             | 4 895              | 10                    | (37)                                    | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £               | 17 982            | \$ 23 665          | 0                     | (202)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 23 665            | £ 17 982           | 202                   | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £               | 88 298            | \$ 116 872         | 0                     | (322)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 15                | £ 12               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 116 867           | 88 298             | 324                   | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £               | 88 319            | \$ 116 671         | 0                     | (551)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 116 667           | £ 88 319           | 552                   | 0                                       | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | £               | 921               | \$ 1 217           | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 217             | £ 921              | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 738           | \$ (5 582)            | \$ (3 844)                              | (0,05)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en RMB (couverte) de distribution et Investisseurs en RMB (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$              | 33                | CNH 221            | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 2                 | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | CNH             | 583               | \$ 86              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 86                | CNH 582            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CNH             | 585               | \$ 86              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 23                | CNH 159            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 86                | 584                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           |                 | 24                | 164                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           |                 | 86                | 579                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 86                | 579                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en AUD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et H Institutions en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 15 882            | SGD 20 251         | \$ 0                  | \$ (225)                                | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD             | 7 200             | \$ 5 563           | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 31 015            | SGD 39 623         | 0                     | (382)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 5 563             | 7 184              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 120               | 155                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD             | 966               | \$ 755             | 8                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 801               | SGD 1 035          | 1                     | (2)                                     | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | SGD             | \$ 5 666          | 4 380              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 18 263            | SGD 23 295         | 0                     | (253)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 4 380             | 5 653              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD             | \$ 18 140         | 13 987             | 0                     | (37)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 30 688            | SGD 39 151         | 0                     | (420)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 13 987            | 18 098             | 37                    | 37                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           |                 | 650               | 835                | 0                     | (5)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           |                 | 174               | 226                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD             | \$ 3 814          | 2 946              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 946             | SGD 3 806          | 3                     | 3                                       | 0,00                |
| RBC          | 07/2026           |                 | 115               | 148                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD             | \$ 87 722         | 67 714             | 1                     | (107)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 628             | SGD 2 087          | 0                     | (15)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 67 524            | 87 279             | 109                   | 109                                     | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | SGD             | \$ 39             | 30                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 165             | \$ (1 454)            | \$ (1 289)                              | (0,02)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (1 246) (0,01)

| DESCRIPTION                                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                                |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                                     | \$ 1 900                      | \$ 670                     | 0,01                |
| Obligation internationale du gouvernement russe<br>5,250 % échéance 23/06/2047 | 600                           | 0                          | 0,00                |
| Total des Autres actifs financiers                                             | \$ 670                        |                            | 0,01                |
| Total des Investissements                                                      | \$ 13 097 056                 |                            | 153,90              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                         | \$ (4 586 880)                |                            | (53,90)             |
| Actif net                                                                      | \$ 8 510 176                  |                            | 100,00              |

## NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,25 %) :

| Description de l'émetteur                                                       | Date d'achat | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,520 % échéance 20/03/2028              | 20/02/2025   | \$ 6 200  | \$ 6 193     | 0,07                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït 4,804 % échéance 20/04/2033 | 13/04/2026   | 13 500    | 13 477       | 0,16                |
| Project Dorchester 4,610 % échéance 04/01/2027                                  | 10/12/2025   | 1 863     | 1 829        | 0,02                |
| Westmoreland Mining LLC                                                         | 07/03/2023   | 1         | 1            | 0,00                |
| Westmoreland Mining LLC « L »                                                   | 26/03/2019   | 0         | 0            | 0,00                |
|                                                                                 |              | \$ 21 564 | \$ 21 500    | 0,25                |

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 3 032 \$) et un montant en numéraire de 5 470 \$ (31 décembre 2025 : 2 249 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 156 956 \$ (31 décembre 2025 : 103 440 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 35 850 \$ (31 décembre 2025 : 9 260 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur         |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1 043                                                                          | \$ 9 515 375                                         | \$ 240 964                                        | \$ 9 757 382         |
| Fonds d'investissement                        | 828 712                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 828 712              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 2 438 642                                            | 0                                                 | 2 438 642            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 3 997                                                                             | 67 653                                               | 0                                                 | 71 650               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 670                                                  | 0                                                 | 670                  |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 833 752</b>                                                                 | <b>\$ 12 022 340</b>                                 | <b>\$ 240 964</b>                                 | <b>\$ 13 097 056</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 556                                                                            | \$ 6 162 672                                         | \$ 117 748                                        | \$ 6 280 976        |
| Fonds d'investissement                        | 507 982                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 507 982             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 1 574 781                                            | 0                                                 | 1 574 781           |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 227                                                                             | 55 282                                               | 0                                                 | 56 509              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 561                                                  | 0                                                 | 561                 |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 509 765</b>                                                                 | <b>\$ 7 793 296</b>                                  | <b>\$ 117 748</b>                                 | <b>\$ 8 420 809</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (819)                                                   | \$ 1 440                | \$ 621                            | \$ 3 063                                                   | \$ (3 370)              | \$ (307)                          |
| BOA          | 346                                                        | (130)                   | 216                               | 1 847                                                      | (1 780)                 | 67                                |
| BPS          | 11 109                                                     | (12 230)                | (1 121)                           | 545                                                        | 0                       | 545                               |
| BRC          | 9 272                                                      | (9 810)                 | (538)                             | 11 085                                                     | (12 020)                | (935)                             |
| BSH          | (15 264)                                                   | 16 070                  | 806                               | 643                                                        | (630)                   | 13                                |
| CBK          | (447)                                                      | 520                     | 73                                | 637                                                        | (320)                   | 317                               |
| DUB          | (586)                                                      | 810                     | 224                               | 104                                                        | 0                       | 104                               |
| FAR          | 322                                                        | (890)                   | (568)                             | (1 822)                                                    | 2 650                   | 828                               |
| GLM          | 477                                                        | 0                       | 477                               | 624                                                        | (80)                    | 544                               |
| GST          | 358                                                        | (360)                   | (2)                               | 319                                                        | (340)                   | (21)                              |
| IND          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (706)                                                      | 1 110                   | 404                               |
| JPM          | 5 144                                                      | (6 160)                 | (1 016)                           | 2 635                                                      | (2 670)                 | (35)                              |
| MBC          | 259                                                        | (390)                   | (131)                             | 6 536                                                      | (7 140)                 | (604)                             |
| MEI          | 46                                                         | 0                       | 46                                | 95                                                         | 0                       | 95                                |
| MYC          | 906                                                        | 0                       | 906                               | 1 223                                                      | (260)                   | 963                               |
| MYI          | 237                                                        | (200)                   | 37                                | 248                                                        | (260)                   | (12)                              |
| NSL          | 33                                                         | 0                       | 33                                | 228                                                        | 0                       | 228                               |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| RYL          | 1 167                                                      | 0                       | 1 167                             | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | 1 106                                                      | 450                     | 1 556                             | 35                                                         | (270)                   | (235)                             |
| SOG          | (15 790)                                                   | 16 010                  | 220                               | (5 210)                                                    | 5 500                   | 290                               |
| SSB          | (590)                                                      | 550                     | (40)                              | 240                                                        | (280)                   | (40)                              |
| UAG          | 1 469                                                      | (470)                   | 999                               | 264                                                        | (260)                   | 4                                 |
| WST          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 399                                                        | (280)                   | 119                               |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 8,70             | 9,56                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 43,73            | 37,20                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,30             | 0,09                 |
| Fonds d'investissement                                           | 4,48             | 3,79                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 13,18            | 11,75                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,06             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,55             | 0,52                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,50             | 0,38                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,00             | 0,00                 |
| Autres actifs                                                    | 28,50            | 36,69                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,87             | 0,77                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 17,40            | 20,75                |
| Obligations et billets convertibles                                                                      | 0,07             | S/O                  |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 57,70            | 59,74                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 3,34             | 4,73                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 9,63             | 9,56                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 20,12            | 19,91                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 5,25             | 4,84                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 0,02             | 0,08                 |
| Bons de souscription                                                                                     | 0,00             | 0,00                 |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,25             | 0,21                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 9,74             | 9,75                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 28,66            | 30,24                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,07             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,03             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,75             | 0,64                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,02             | 0,03                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options à taux d'intérêt plafonnées                                                                      | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,06             | 0,11                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,48             | (0,37)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,57)           | 0,67                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,01             | 0,01                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (53,90)          | (61,68)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund

| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>               |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |
| <b>CÉRÉTIÉS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS</b> |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |
| American Airlines, Inc.                 |                                     |                                  |                           | Capital One Financial Corp.                                          |                                     |                                  |                           | Logicor Financing SARL                         |                                     |                                  |                           |
| 5,925 % éch. 20/04/2028                 | \$ 708                              | \$ 708                           | 0,07                      | 4,722 % éch. 30/01/2032                                              | \$ 1 000                            | \$ 987                           | 0,09                      | 3,250 % éch. 13/11/2028                        | € 700                               | \$ 799                           | 0,08                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.         |                                     |                                  |                           | CapitaLand Ascendas REIT                                             |                                     |                                  |                           | Longleaf Pine Re Ltd.                          |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 03/06/2033                 | 1 471                               | 1 473                            | 0,14                      | 0,750 % éch. 23/06/2028                                              | € 1 100                             | 1 202                            | 0,11                      | 21,453 % éch. 27/05/2031                       | \$ 400                              | 408                              | 0,04                      |
| INEOS U.S. Finance LLC                  |                                     |                                  |                           | CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF                      |                                     |                                  |                           | Lower Ferry Re Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| 6,894 % éch. 18/02/2030                 | 500                                 | 462                              | 0,04                      | 3,875 % éch. 28/05/2031                                              | 800                                 | 919                              | 0,09                      | 6,260 % éch. 08/07/2033                        | 250                                 | 250                              | 0,02                      |
| IRB Holding Corp.                       |                                     |                                  |                           | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European |                                     |                                  |                           | Luca RE Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 16/12/2030                 | 2 835                               | 2 838                            | 0,27                      | Core Fund                                                            |                                     |                                  |                           | 9,036 % éch. 09/07/2032                        | 300                                 | 300                              | 0,03                      |
| LifePoint Health, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 0,500 % éch. 27/01/2028                                              | 1 600                               | 1 757                            | 0,17                      | Mayflower Re Ltd.                              |                                     |                                  |                           |
| 7,177 % éch. 19/05/2031                 | 295                                 | 290                              | 0,03                      | Charles River Re Ltd.                                                |                                     |                                  |                           | 8,565 % éch. 08/07/2030                        | 250                                 | 250                              | 0,02                      |
| 7,423 % éch. 19/05/2031                 | 1 116                               | 1 101                            | 0,10                      | 11,152 % éch. 10/05/2031                                             | \$ 300                              | 304                              | 0,03                      | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.           |                                     |                                  |                           |
| République du Panama                    |                                     |                                  |                           | CI Financial Corp.                                                   |                                     |                                  |                           | 5,242 % éch. 19/04/2029                        | 600                                 | 606                              | 0,06                      |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                 | € 500                               | 573                              | 0,05                      | 4,625 % éch. 12/12/2031                                              | € 400                               | 464                              | 0,04                      | Morgan Stanley                                 |                                     |                                  |                           |
| Virgin Media Bristol LLC                |                                     |                                  |                           | CIMA Finance DAC                                                     |                                     |                                  |                           | 3,485 % éch. 11/06/2030                        | € 2 100                             | 2 414                            | 0,23                      |
| 6,990 % éch. 31/01/2029                 | \$ 1 000                            | 961                              | 0,09                      | 2,950 % éch. 05/09/2029                                              | \$ 443                              | 422                              | 0,04                      | 4,238 % éch. 09/01/2030                        | \$ 2 600                            | 2 566                            | 0,24                      |
|                                         |                                     | 8 406                            | 0,79                      | Commonwealth RE Ltd.                                                 |                                     |                                  |                           | 4,708 % éch. 12/03/2032                        | 1 200                               | 1 185                            | 0,11                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>    |                                     |                                  |                           | 7,407 % éch. 08/07/2030                                              | 250                                 | 250                              | 0,02                      | Morgan Stanley Bank N.A.                       |                                     |                                  |                           |
| <b>BANQUE ET FINANCE</b>                |                                     |                                  |                           | Cooperative Rabobank UA                                              |                                     |                                  |                           | 4,788 % éch. 10/05/2030                        | 300                                 | 300                              | 0,03                      |
| Acef Holding S.C.A.                     |                                     |                                  |                           | 3,100 % éch. 29/06/2028 (g)(i)                                       | € 1 000                             | 1 121                            | 0,11                      | Nature Coast Re Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| 1,250 % éch. 26/04/2030                 | € 1 000                             | 1 054                            | 0,10                      | CPI Property Group S.A.                                              |                                     |                                  |                           | 11,789 % éch. 26/02/2030                       | 500                                 | 504                              | 0,05                      |
| AGFC Capital Trust                      |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 22/07/2030                                              | 700                                 | 764                              | 0,07                      | New Immo Holding S.A.                          |                                     |                                  |                           |
| 5,685 % éch. 15/01/2067                 | \$ 500                              | 312                              | 0,03                      | Crédit Agricole S.A.                                                 |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 14/11/2030                        | € 600                               | 685                              | 0,06                      |
| Aircastle Ltd.                          |                                     |                                  |                           | 5,186 % éch. 01/08/2032                                              | \$ 2 100                            | 2 110                            | 0,20                      | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                |                                     |                                  |                           |
| 2,850 % éch. 26/01/2028                 | 1 500                               | 1 455                            | 0,14                      | Deutsche Bank AG                                                     |                                     |                                  |                           | 2,450 % éch. 15/09/2028                        | \$ 800                              | 743                              | 0,07                      |
| AMCO - Asset Management Co. SpA         |                                     |                                  |                           | 5,060 % éch. 14/04/2032                                              | 1 000                               | 998                              | 0,09                      | Norinchukin Bank                               |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 17/07/2027                 | € 811                               | 921                              | 0,09                      | Digital Dutch Finco BV                                               |                                     |                                  |                           | 5,094 % éch. 16/10/2029                        | 800                                 | 806                              | 0,08                      |
| American Assets Trust LP                |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/01/2032                                              | € 900                               | 892                              | 0,08                      | Orange Capital RE DAC                          |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 01/02/2031                 | \$ 2 050                            | 1 875                            | 0,18                      | Digital Intrepid Holding BV                                          |                                     |                                  |                           | 8,103 % éch. 17/01/2029                        | € 250                               | 298                              | 0,03                      |
| American Honda Finance Corp.            |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch. 18/07/2032                                              | 900                                 | 897                              | 0,08                      | Palm RE Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,358 % éch. 13/08/2027                 | 1 900                               | 1 902                            | 0,18                      | Everglades Re Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           | 13,220 % éch. 09/06/2031                       | \$ 250                              | 258                              | 0,02                      |
| American Tower Corp.                    |                                     |                                  |                           | 9,289 % éch. 22/05/2033                                              | \$ 300                              | 300                              | 0,03                      | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 15/07/2028                 | 2 000                               | 2 024                            | 0,19                      | Fairfax Financial Holdings Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 05/04/2032 (e)                    | 1 048                               | 854                              | 0,08                      |
| Athene Global Funding                   |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 29/04/2030                                              | 700                                 | 696                              | 0,07                      | Peugeot Invest S.A.                            |                                     |                                  |                           |
| 3,204 % éch. 23/02/2027                 | € 1 200                             | 1 375                            | 0,13                      | Fédération des Caisses Desjardins du Québec                          |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 30/10/2026                        | € 2 300                             | 2 620                            | 0,25                      |
| Aviation Capital Group LLC              |                                     |                                  |                           | 4,387 % éch. 30/11/2026                                              | £ 1 000                             | 1 329                            | 0,12                      | Polestar Re Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 28/01/2033                 | \$ 2 200                            | 2 142                            | 0,20                      | 5,132 % éch. 02/12/2027                                              | AUD 2 500                           | 1 738                            | 0,16                      | 14,140 % éch. 07/01/2028                       | \$ 250                              | 260                              | 0,02                      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.            |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                                            |                                     |                                  |                           | 16,800 % éch. 07/01/2027                       | 700                                 | 719                              | 0,07                      |
| 2,528 % éch. 18/11/2027                 | 793                                 | 770                              | 0,07                      | 3,530 % éch. 24/12/2029                                              | € 1 200                             | 1 378                            | 0,13                      | PPI Public Property Invest AB                  |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 30/01/2031                 | 1 500                               | 1 474                            | 0,14                      | 4,789 % éch. 03/06/2031                                              | \$ 1 200                            | 1 202                            | 0,11                      | 4,125 % éch. 21/04/2033                        | € 900                               | 1 016                            | 0,10                      |
| 4,950 % éch. 15/01/2028                 | 1 200                               | 1 203                            | 0,11                      | Ford Motor Credit Co. LLC                                            |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 01/10/2032                        | 1 300                               | 1 500                            | 0,14                      |
| 4,950 % éch. 15/10/2032                 | 800                                 | 781                              | 0,07                      | 5,303 % éch. 06/09/2029                                              | 1 100                               | 1 096                            | 0,10                      | Purple Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| Balder Finland Oyj                      |                                     |                                  |                           | 5,420 % éch. 09/04/2031                                              | 1 600                               | 1 587                            | 0,15                      | 10,050 % éch. 07/06/2033                       | \$ 300                              | 300                              | 0,03                      |
| 1,000 % éch. 18/01/2027                 | € 1 900                             | 2 151                            | 0,20                      | 5,918 % éch. 20/03/2028                                              | 500                                 | 506                              | 0,05                      | 12,676 % éch. 06/06/2031                       | 300                                 | 308                              | 0,03                      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA     |                                     |                                  |                           | GA Global Funding Trust                                              |                                     |                                  |                           | QNB Finance Ltd.                               |                                     |                                  |                           |
| 7,708 % éch. 18/01/2028                 | 3 800                               | 4 613                            | 0,43                      | 5,414 % éch. 15/12/2032                                              | £ 700                               | 908                              | 0,09                      | 4,538 % éch. 19/09/2027                        | 3 100                               | 3 099                            | 0,29                      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.    |                                     |                                  |                           | Gaci First Investment Co.                                            |                                     |                                  |                           | Sagax AB                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,968 % éch. 08/05/2031                 | \$ 800                              | 799                              | 0,08                      | 4,875 % éch. 14/05/2029                                              | \$ 2 600                            | 2 592                            | 0,24                      | 1,125 % éch. 30/01/2027                        | € 1 700                             | 1 924                            | 0,18                      |
| Banco Santander S.A.                    |                                     |                                  |                           | Galderna Finance Europe BV                                           |                                     |                                  |                           | Sagax Euro MTN NL BV                           |                                     |                                  |                           |
| 4,867 % éch. 15/04/2031                 | 3 800                               | 3 779                            | 0,35                      | 3,375 % éch. 17/03/2031                                              | € 500                               | 571                              | 0,05                      | 0,750 % éch. 26/01/2028                        | 600                                 | 661                              | 0,06                      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.               |                                     |                                  |                           | Gateway Re Ltd.                                                      |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 17/05/2029                        | 1 000                               | 1 071                            | 0,10                      |
| 5,343 % éch. 29/06/2029                 | 500                                 | 502                              | 0,05                      | 5,550 % éch. 06/07/2029                                              | \$ 600                              | 599                              | 0,06                      | Santander Holdings USA, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| Bank of America Corp.                   |                                     |                                  |                           | Golden Bear Re Ltd.                                                  |                                     |                                  |                           | 3,244 % éch. 05/10/2026                        | \$ 100                              | 100                              | 0,01                      |
| 4,376 % éch. 27/04/2028                 | 1 000                               | 999                              | 0,09                      | 13,289 % éch. 08/03/2032                                             | 350                                 | 353                              | 0,03                      | Santander UK Group Holdings PLC                |                                     |                                  |                           |
| 4,456 % éch. 06/02/2032                 | 2 700                               | 2 653                            | 0,25                      | 13,300 % éch. 08/01/2029                                             | 500                                 | 513                              | 0,05                      | 3,823 % éch. 03/11/2028                        | 300                                 | 297                              | 0,03                      |
| 4,695 % éch. 23/04/2032                 | 1 900                               | 1 884                            | 0,18                      | Goldman Sachs Group, Inc.                                            |                                     |                                  |                           | SELP Finance SARL                              |                                     |                                  |                           |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. |                                     |                                  |                           | 3,088 % éch. 18/12/2029                                              | € 2 600                             | 2 979                            | 0,28                      | 3,875 % éch. 21/04/2031                        | € 600                               | 692                              | 0,06                      |
| 4,541 % éch. 15/01/2031                 | 2 200                               | 2 164                            | 0,20                      | 3,691 % éch. 05/06/2028                                              | \$ 100                              | 99                               | 0,01                      | 4,000 % éch. 29/06/2033                        | 600                                 | 689                              | 0,06                      |
| Barclays PLC                            |                                     |                                  |                           | 4,369 % éch. 21/10/2031                                              | 2 200                               | 2 152                            | 0,20                      | Simon Global Development BV                    |                                     |                                  |                           |
| 4,219 % éch. 24/05/2030                 | 2 500                               | 2 459                            | 0,23                      | 4,516 % éch. 21/01/2032                                              | 2 900                               | 2 846                            | 0,27                      | 3,650 % éch. 15/06/2031                        | 800                                 | 922                              | 0,09                      |
| BNP Paribas S.A.                        |                                     |                                  |                           | 4,594 % éch. 20/04/2030                                              | 800                                 | 796                              | 0,07                      | Société Générale S.A.                          |                                     |                                  |                           |
| 1,904 % éch. 30/09/2028                 | 1 300                               | 1 258                            | 0,12                      | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | 4,857 % éch. 07/07/2029 (b)                    | \$ 900                              | 900                              | 0,08                      |
| 4,916 % éch. 15/01/2034                 | 2 200                               | 2 159                            | 0,20                      | 3,875 % éch. 29/04/2033                                              | € 600                               | 687                              | 0,06                      | Sofina S.A.                                    |                                     |                                  |                           |
| BPCE S.A.                               |                                     |                                  |                           | Greengrove RE Ltd.                                                   |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 23/09/2028                        | € 2 500                             | 2 715                            | 0,25                      |
| 1,250 % éch. 13/01/2042                 | € 1 800                             | 2 045                            | 0,19                      | 11,270 % éch. 08/04/2032                                             | \$ 300                              | 306                              | 0,03                      | Stellantis Financial Services U.S. Corp.       |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 12/09/2028                 | \$ 2 500                            | 2 496                            | 0,23                      | GSG Bidco Ltd.                                                       |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 15/06/2029                        | \$ 1 600                            | 1 595                            | 0,15                      |
| Buttonwood RE Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/06/2031                                              | € 1 100                             | 1 247                            | 0,12                      | Sumisho Air Lease Corp.                        |                                     |                                  |                           |
| 9,050 % éch. 29/05/2029                 | 250                                 | 250                              | 0,02                      | HSBC Holdings PLC                                                    |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 24/03/2031                        | 1 300                               | 1 287                            | 0,12                      |
| Canadian Imperial Bank of Commerce      |                                     |                                  |                           | 4,398 % éch. 10/03/2030                                              | \$ 2 100                            | 2 078                            | 0,20                      | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.          |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 31/03/2027                 | € 3 200                             | 3 674                            | 0,34                      | Intesa Sanpaolo SpA                                                  |                                     |                                  |                           | 5,138 % éch. 07/07/2034 (b)                    | 3 300                               | 3 289                            | 0,31                      |
| Cape Lookout Re Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 11/01/2027 (g)(i)                                       | € 1 700                             | 1 990                            | 0,19                      | Sun Communities Operating LP                   |                                     |                                  |                           |
| 10,420 % éch. 13/03/2032                | \$ 400                              | 418                              | 0,04                      | JPMorgan Chase & Co.                                                 |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 15/04/2032                        | 2 500                               | 2 395                            | 0,22                      |
| 12,226 % éch. 05/04/2027                | 700                                 | 699                              | 0,07                      | 3,136 % éch. 18/02/2032                                              | \$ 1 400                            | 1 583                            | 0,15                      | TAG Immobilien AG                              |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,408 % éch. 23/04/2030                                              | \$ 3 700                            | 3 669                            | 0,34                      | 3,625 % éch. 03/03/2032                        | € 400                               | 453                              | 0,04                      |
|                                         |                                     |                                  |                           | Lineage Europe Finco BV                                              |                                     |                                  |                           | Torrey Pines Re Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 26/11/2031                                              | € 500                               | 571                              | 0,05                      | 6,789 % éch. 07/06/2034                        | \$ 400                              | 403                              | 0,04                      |
|                                         |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC                                             |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,241 % éch. 10/02/2030                                              | \$ 2 000                            | 1 975                            | 0,19                      |                                                |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| TP ICAP Finance PLC                                                                               |                                     |                                  |                           | Greene King Finance PLC                                                              |                                     |                                  |                           | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 2,625 % éch. 18/11/2028                                                                           | £ 1 000                             | \$ 1 252                         | 0,12                      | 5,318 % éch. 15/09/2031                                                              | £ 243                               | \$ 322                           | 0,03                      | AES Corp.                                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| UBS AG                                                                                            |                                     |                                  |                           | 5,666 % éch. 15/12/2034                                                              | 100                                 | 124                              | 0,01                      | 2,450 % éch. 15/01/2031                                                                                           | \$ 1 800                            | \$ 1 606                         | 0,15                      |
| 0,250 % éch. 01/09/2028                                                                           | € 300                               | 324                              | 0,03                      | GSG Bidco Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 01/06/2028                                                                                           | 100                                 | 101                              | 0,01                      |
| UBS AG                                                                                            |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 15/06/2036                                                              | € 1 100                             | 1 248                            | 0,12                      | Anglian Water Osprey Financing PLC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,632 % éch. 16/02/2032                                                                           | \$ 1 800                            | 1 786                            | 0,17                      | Haleon U.S. Capital LLC                                                              |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 27/08/2031                                                                                           | £ 2 600                             | 3 478                            | 0,33                      |
| UBS Group AG                                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 24/03/2027                                                              | \$ 1 000                            | 993                              | 0,09                      | Anglian Water Services Financing PLC                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,194 % éch. 01/04/2031                                                                           | 800                                 | 781                              | 0,07                      | Heathrow Funding Ltd.                                                                |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 23/06/2036                                                                                           | € 2 200                             | 2 519                            | 0,24                      |
| 4,588 % éch. 10/08/2032                                                                           | 200                                 | 196                              | 0,02                      | HOCHTIEF AG                                                                          |                                     |                                  |                           | DWR Cymru Financing UK PLC                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/04/2034                                                              | € 1 070                             | 1 231                            | 0,12                      | 2,375 % éch. 31/03/2034                                                                                           | £ 2 000                             | 2 036                            | 0,19                      |
| 15,000 % éch. 31/12/2044 <sup>(c)</sup>                                                           | 150                                 | 3                                | 0,00                      | IHO Verwaltungs GmbH                                                                 |                                     |                                  |                           | Edison International                                                                                              |                                     |                                  |                           |
| Ursa Re Ltd.                                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/05/2031                                                              | 900                                 | 1 072                            | 0,10                      | 6,250 % éch. 15/03/2030                                                                                           | \$ 500                              | 514                              | 0,05                      |
| 8,510 % éch. 07/12/2029                                                                           | 300                                 | 304                              | 0,03                      | InterContinental Hotels Group PLC                                                    |                                     |                                  |                           | Emera U.S. Finance LLC                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 11,260 % éch. 07/06/2028                                                                          | 600                                 | 617                              | 0,06                      | 2,125 % éch. 24/08/2026                                                              | £ 200                               | 265                              | 0,02                      | 4,500 % éch. 01/04/2029                                                                                           | 300                                 | 298                              | 0,03                      |
| Veraison Re Ltd.                                                                                  |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 15/05/2027                                                              | € 700                               | 795                              | 0,07                      | EPH Financing International A/S                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 7,671 % éch. 08/03/2034                                                                           | 300                                 | 300                              | 0,03                      | John Lewis PLC                                                                       |                                     |                                  |                           | 6,651 % éch. 13/11/2028                                                                                           | € 1 100                             | 1 337                            | 0,12                      |
| Volkswagen Bank GmbH                                                                              |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 18/12/2034                                                              | £ 1 300                             | 1 463                            | 0,14                      | Evergy, Inc.                                                                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 26/11/2028                                                                           | € 400                               | 460                              | 0,04                      | Las Vegas Sands Corp.                                                                |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 15/03/2029                                                                                           | \$ 1 600                            | 1 582                            | 0,15                      |
| Volkswagen Financial Services NV                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/06/2028                                                              | \$ 1 100                            | 1 114                            | 0,10                      | Pacific Gas & Electric Co.                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 04/04/2029                                                                           | £ 200                               | 266                              | 0,03                      | Latvenergo A/S                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,950 % éch. 01/12/2047                                                                                           | 200                                 | 147                              | 0,01                      |
| Volkswagen Leasing GmbH                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,612 % éch. 13/11/2030                                                              | € 1 700                             | 1 934                            | 0,18                      | 4,000 % éch. 01/12/2046                                                                                           | 300                                 | 224                              | 0,02                      |
| 3,625 % éch. 11/10/2026                                                                           | € 100                               | 115                              | 0,01                      | Lottomatica Group SpA                                                                |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 15/01/2033                                                                                           | 2 100                               | 2 195                            | 0,20                      |
| Vonovia SE                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 30/04/2032                                                              | 800                                 | 922                              | 0,09                      | PacifiCorp                                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,385 % éch. 20/05/2033                                                                           | AUD 700                             | 495                              | 0,05                      | Maple Parent Holdings Corp.                                                          |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 15/04/2033                                                                                           | 600                                 | 609                              | 0,06                      |
| Wells Fargo & Co.                                                                                 |                                     |                                  |                           | 3,881 % éch. 26/03/2030                                                              | 1 100                               | 1 268                            | 0,12                      | Southern California Edison Co.                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 1,375 % éch. 26/10/2026                                                                           |                                     | 2                                |                           | Mitchells & Butlers Finance PLC                                                      |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 15/09/2031                                                                                           | 600                                 | 599                              | 0,06                      |
|                                                                                                   | € 2 400                             | 735                              | 0,26                      | 4,350 % éch. 15/12/2030                                                              | \$ 56                               | 54                               | 0,01                      | 5,150 % éch. 01/06/2029                                                                                           | 400                                 | 404                              | 0,04                      |
| 4,808 % éch. 25/07/2028                                                                           | \$ 2 000                            | 2 006                            | 0,19                      | 6,013 % éch. 15/12/2030                                                              | £ 735                               | 981                              | 0,09                      | SW Finance PLC                                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| WP Carey, Inc.                                                                                    |                                     |                                  |                           | 6,469 % éch. 15/09/2032                                                              | 400                                 | 535                              | 0,05                      | 5,750 % éch. 19/11/2030                                                                                           | £ 2 500                             | 3 237                            | 0,30                      |
| 3,250 % éch. 02/10/2031                                                                           | € 700                               | 788                              | 0,07                      | MSCI, Inc.                                                                           |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 14/11/2034                                                                                           | 800                                 | 1 063                            | 0,10                      |
| Yardstick RE DAC                                                                                  |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 01/11/2031                                                              | \$ 2 300                            | 2 134                            | 0,20                      | TDC Net A/S                                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,274 % éch. 08/07/2034                                                                           | 300                                 | 343                              | 0,03                      | National Fuel Gas Co.                                                                |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 09/08/2032                                                                                           | € 1 700                             | 2 018                            | 0,19                      |
|                                                                                                   |                                     | 158 935                          | 14,91                     | 5,050 % éch. 15/10/2031                                                              | 700                                 | 697                              | 0,07                      |                                                                                                                   |                                     | 23 967                           | 2,25                      |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | NTT Finance Corp.                                                                    |                                     |                                  |                           | Total des Obligations et billets privés                                                                           |                                     | 268 782                          | 25,22                     |
|                                                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,713 % éch. 16/07/2028                                                              | 800                                 | 807                              | 0,08                      |                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| INDUSTRIE                                                                                         |                                     |                                  |                           | Oracle Corp.                                                                         |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Air Canada                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 04/02/2029                                                              | 1 700                               | 1 676                            | 0,16                      | Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021 |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/08/2026                                                                           | \$ 1 200                            | 1 200                            | 0,11                      | QatarEnergy                                                                          |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/06/2046                                                                                           | \$ 270                              | 247                              | 0,02                      |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 23/06/2029                                                              | 800                                 | 795                              | 0,07                      | Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021                      |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 15/02/2029                                                                           | 1 195                               | 1 195                            | 0,11                      | RD Michigan Property Owner LLC                                                       |                                     |                                  |                           | 3,487 % éch. 01/06/2036                                                                                           | 1 300                               | 1 081                            | 0,10                      |
| American Airlines Pass-Through Trust                                                              |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                                                              | 13 500                              | 13 463                           | 1,26                      | Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021                          |                                     |                                  |                           |
| 3,150 % éch. 15/08/2033                                                                           | 472                                 | 444                              | 0,04                      | Royal Caribbean Cruises Ltd.                                                         |                                     |                                  |                           | 2,587 % éch. 01/06/2029                                                                                           |                                     | 3 75                             |                           |
| 3,250 % éch. 15/04/2030                                                                           | 14                                  | 13                               | 0,00                      | Sandoz Finance BV                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                                                   | 4 000 0                             |                                  | 0,35                      |
| 3,375 % éch. 01/11/2028                                                                           | 763                                 | 754                              | 0,07                      | 3,970 % éch. 17/04/2027                                                              | € 800                               | 922                              | 0,09                      | Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007                        |                                     |                                  |                           |
| 3,650 % éch. 15/08/2030                                                                           | 568                                 | 555                              | 0,05                      | Sands China Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 01/06/2047 (e)                                                                                       | 4 700                               | 471                              | 0,05                      |
| APA Infrastructure Ltd.                                                                           |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 08/03/2027                                                              | \$ 200                              | 197                              | 0,02                      | Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020                        |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 15/03/2029                                                                           | € 350                               | 375                              | 0,04                      | Spirit AeroSystems, Inc.                                                             |                                     |                                  |                           | 3,151 % éch. 01/06/2032                                                                                           | 200                                 | 179                              | 0,02                      |
| Arcadis NV                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 15/06/2028                                                              | 1 100                               | 1 097                            | 0,10                      | 3,401 % éch. 01/06/2034                                                                                           | 1 150                               | 981                              | 0,09                      |
| 4,000 % éch. 20/05/2031                                                                           | 600                                 | 689                              | 0,06                      | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV                                           |                                     |                                  |                           | 3,501 % éch. 01/06/2035                                                                                           | 1 700                               | 1 428                            | 0,13                      |
| Ashtead Capital, Inc.                                                                             |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 09/05/2030                                                              | € 1 000                             | 1 166                            | 0,11                      |                                                                                                                   |                                     | 8 137                            | 0,76                      |
| 5,950 % éch. 15/10/2033                                                                           | \$ 1 700                            | 1 755                            | 0,16                      | Ubisoft Entertainment S.A.                                                           |                                     |                                  |                           | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           | 0,878 % éch. 24/11/2027 (k)                                                          | 1 000                               | 1 012                            | 0,09                      | Fannie Mae                                                                                                        |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 22/10/2031                                                                           | 400                                 | 407                              | 0,04                      | Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % en numéraire ou 12,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 25/08/2052 (a)                                                                                       | 4 811                               | 640                              | 0,06                      |
| Baker Hughes Holdings LLC                                                                         |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 31/12/2028 <sup>(c)</sup>                                              | \$ 166                              | 5                                | 0,00                      | 2,500 % éch. 25/02/2051 (a)                                                                                       | 1 530                               | 263                              | 0,02                      |
| 4,650 % éch. 15/06/2033                                                                           | 2 500                               | 2 446                            | 0,23                      | Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 25/10/2051 (a)                                                                                       | 532                                 | 103                              | 0,01                      |
| Beignet Investor LLC                                                                              |                                     |                                  |                           | 13,500 % éch. 31/12/2027 <sup>(c)</sup>                                              | 74                                  | 5                                | 0,00                      | 3,500 % éch. 25/01/2051 -                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049                                                                           | 8 390                               | 8 563                            | 0,80                      | United Airlines Pass-Through Trust                                                   |                                     |                                  |                           | 25/11/2051 (a)                                                                                                    | 12 316                              | 1 998                            | 0,19                      |
| British Airways Pass-Through Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch. 01/11/2033                                                              | 847                                 | 773                              | 0,07                      | 5,000 % éch. 25/12/2040 -                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 3,300 % éch. 15/06/2034                                                                           | 69                                  | 65                               | 0,01                      | Venture Global Calcasieu Pass LLC                                                    |                                     |                                  |                           | 25/05/2055 (a)                                                                                                    | 9 740                               | 2 094                            | 0,20                      |
| Burberry Group PLC                                                                                |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/11/2033                                                              | 3 400                               | 3 033                            | 0,28                      | 5,500 % éch. 25/10/2035 -                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 20/06/2030                                                                           | £ 700                               | 938                              | 0,09                      | Viper Energy Partners LLC                                                            |                                     |                                  |                           | 25/05/2055 (a)                                                                                                    | 4 018                               | 775                              | 0,07                      |
| Chanel Ceres PLC                                                                                  |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 01/08/2030                                                              | 800                                 | 798                              | 0,07                      | 5,500 % éch. 25/01/2041 (a)                                                                                       | 405                                 | 77                               | 0,01                      |
| 0,500 % éch. 31/07/2026                                                                           | € 800                               | 913                              | 0,09                      | 5,700 % éch. 01/08/2035                                                              | 800                                 | 813                              | 0,08                      | Freddie Mac                                                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 1,000 % éch. 31/07/2031                                                                           | 2 100                               | 2 123                            | 0,20                      | VistaJet Malta Finance PLC                                                           |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 25/02/2051 -                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| Chick-fil-A, Inc.                                                                                 |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 15/01/2032                                                              | 500                                 | 496                              | 0,05                      | 25/04/2051 (a)                                                                                                    | 15 786                              | 1 651                            | 0,16                      |
| 4,800 % éch. 21/07/2031 (b)(j)                                                                    | \$ 1 700                            | 1 682                            | 0,16                      | Vmed O2 UK Financing PLC                                                             |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 25/05/2042 -                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| DAE Funding LLC                                                                                   |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/04/2032                                                              | € 3 300                             | 3 325                            | 0,31                      | 25/06/2051 (a)                                                                                                    | 11 865                              | 1 449                            | 0,14                      |
| 3,375 % éch. 20/03/2028                                                                           | 1 900                               | 1 840                            | 0,17                      | Volkswagen Group of America Finance LLC                                              |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 25/08/2050 (a)                                                                                       | 5 368                               | 727                              | 0,07                      |
| Davide Campari-Milano NV                                                                          |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 27/03/2028                                                              | \$ 700                              | 703                              | 0,07                      | 3,000 % éch. 25/10/2050 (a)                                                                                       | 694                                 | 97                               | 0,01                      |
| 4,250 % éch. 17/06/2033                                                                           | € 600                               | 698                              | 0,07                      | Yorkshire Water Finance PLC                                                          |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/10/2032 -                                                                                         |                                     |                                  |                           |
| DSV Finance BV                                                                                    |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 22/07/2033                                                              | £ 1 000                             | 1 332                            | 0,12                      | 25/12/2051 (a)                                                                                                    | 12 753                              | 2 098                            | 0,20                      |
| 2,875 % éch. 06/11/2026                                                                           | 700                                 | 801                              | 0,08                      | 6,375 % éch. 18/11/2034                                                              | 1 000                               | 1 359                            | 0,13                      | 4,500 % éch. 25/08/2049 (a)                                                                                       | 2 420                               | 361                              | 0,03                      |
| Fedex Freight Holding Co., Inc.                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                                                      |                                     | 85 880                           | 8,06                      |                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,650 % éch. 15/03/2031                                                                           | \$ 2 400                            | 2 358                            | 0,22                      |                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Flora Food Management BV                                                                          |                                     |                                  |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 02/07/2029                                                                           | € 1 400                             | 1 566                            | 0,15                      |                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                                                   |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 5,000 % éch. 15/11/2052 -<br>25/08/2055 (a)                                                | \$ 6 084                            | \$ 1 370                         | 0,13                      | EMF-UK PLC                                                 | £ 17                                | \$ 23                            | 0,00                      |
| Ginnie Mae                                                                                 |                                     |                                  |                           | 4,846 % éch. 13/03/2046                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 15/07/2045                                                                    | 14 169                              | 13 128                           | 1,23                      | Eurohome UK Mortgages PLC                                  | 2                                   | 3                                | 0,00                      |
| Ginnie Mae, TBA                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,016 % éch. 15/06/2044                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 01/07/2056                                                                    | 7 100                               | 6 063                            | 0,57                      | Eurosail PLC                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                    | 17 600                              | 17 354                           | 1,63                      | 4,816 % éch. 13/06/2045                                    | 49                                  | 64                               | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 01/07/2056                                                                    | 37 700                              | 38 495                           | 3,61                      | GSMPS Mortgage Loan Trust                                  |                                     |                                  |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                                  |                                     |                                  |                           | 4,113 % éch. 25/03/2035                                    | \$ 66                               | 63                               | 0,01                      |
| 3,500 % éch. 01/12/2047 -<br>01/07/2048                                                    | 9 664                               | 8 836                            | 0,83                      | GSR Mortgage Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/04/2055                                                                    | 5 712                               | 5 954                            | 0,56                      | 6,000 % éch. 25/01/2037                                    | 1 106                               | 649                              | 0,06                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA                             |                                     |                                  |                           | HarborView Mortgage Loan Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                                                    | 37 200                              | 32 422                           | 3,04                      | 4,134 % éch. 19/01/2038                                    | 27                                  | 25                               | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                                                    | 7 700                               | 6 981                            | 0,66                      | 4,164 % éch. 19/12/2036                                    | 3 503                               | 3 175                            | 0,30                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                                                    | 5 400                               | 5 048                            | 0,47                      | 5,744 % éch. 19/10/2035                                    | 417                                 | 190                              | 0,02                      |
| 4,500 % éch. 01/08/2056                                                                    | 38 900                              | 37 236                           | 3,49                      | Harmony French Home Loans                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 -<br>01/08/2056                                                    | 213 000                             | 209 078                          | 19,62                     | 2,854 % éch. 27/05/2062                                    | € 3 654                             | 4 181                            | 0,39                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                                                    | 32 700                              | 32 761                           | 3,07                      | IndyMac Mortgage Loan Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                                                    | 170 900                             | 174 008                          | 16,33                     | 4,183 % éch. 25/07/2036                                    | \$ 1 429                            | 1 422                            | 0,13                      |
|                                                                                            |                                     | 601 067                          | 56,41                     | JPMorgan Alternative Loan Trust                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/06/2037                                    | 3 557                               | 1 775                            | 0,17                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Landmark Mortgage Securities PLC                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,146 % éch. 17/04/2044                                    | £ 88                                | 115                              | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Lehman XS Trust                                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/08/2046                                    | \$ 116                              | 114                              | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,213 % éch. 25/08/2046                                    | 274                                 | 291                              | 0,03                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Ludgate Funding PLC                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 2,448 % éch. 01/12/2060                                    | € 10                                | 11                               | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,056 % éch. 01/12/2060                                    | £ 68                                | 89                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Mansard Mortgages PLC                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,046 % éch. 15/04/2047                                    | 12                                  | 16                               | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,516 % éch. 15/12/2049                                    | 42                                  | 56                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,013 % éch. 25/11/2034                                    | \$ 401                              | 400                              | 0,04                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,651 % éch. 25/12/2037                                    | 765                                 | 472                              | 0,04                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,354 % éch. 25/08/2036                                    | 10 086                              | 1 628                            | 0,15                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Mortgage Equity Conversion Asset Trust                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,510 % éch. 25/05/2042                                    | 99                                  | 89                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates            |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/02/2035                                    | 337                                 | 293                              | 0,03                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | New Century Alternative Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,460 % éch. 25/10/2036                                    | 476                                 | 84                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Newgate Funding PLC                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,001 % éch. 15/12/2050                                    | € 38                                | 43                               | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,026 % éch. 15/12/2050                                    | £ 115                               | 151                              | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | NovaStar Mortgage Funding Trust                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 0,382 % éch. 25/09/2046                                    | \$ 1 952                            | 718                              | 0,07                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | OBX Trust                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,413 % éch. 25/06/2057                                    | 69                                  | 69                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Project Cashmere                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                | AUD 13 100                          | 9 046                            | 0,85                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Residential Accredited Loans, Inc. Trust                   |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 25/06/2036                                    | \$ 15                               | 12                               | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/04/2036                                    | 717                                 | 585                              | 0,06                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/06/2036                                    | 98                                  | 78                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Residential Asset Securitization Trust                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/06/2037                                    | 2 916                               | 534                              | 0,05                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | RMAC Securities PLC                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,016 % éch. 12/06/2044                                    | £ 26                                | 35                               | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Stratton BTL Mortgage Funding PLC                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,477 % éch. 20/01/2054                                    | 2 423                               | 3 219                            | 0,30                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Structured Asset Mortgage Investments Trust                |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/09/2047                                    | \$ 532                              | 483                              | 0,05                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust              |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 3,986 % éch. 25/02/2037                                    | 55                                  | 52                               | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/07/2036                                    | 82                                  | 53                               | 0,01                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           | 6,115 % éch. 25/07/2034                                    | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     | 35 038                           | 3,29                      |
| TITRES ADOSSES À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON EMIS<br>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSES À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES             |                                     |                                  |                           |
| Adjustable Rate Mortgage Trust                                                             |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                              |                                     |                                  |                           |
| 4,673 % éch. 25/11/2035                                                                    | 207                                 | 142                              | 0,01                      | 3,436 % éch. 22/09/2043                                    | € 719                               | 827                              | 0,08                      |
| American Home Mortgage Investment Trust                                                    |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,343 % éch. 25/11/2045                                                                    | 1 055                               | 970                              | 0,09                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Banc of America Funding Trust                                                              |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,074 % éch. 20/02/2047                                                                    | 428                                 | 426                              | 0,04                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,134 % éch. 20/07/2036                                                                    | 209                                 | 209                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,412 % éch. 25/10/2036                                                                    | 6                                   | 5                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| BCAP LLC Trust                                                                             |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,836 % éch. 26/11/2036                                                                    | 226                                 | 247                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,123 % éch. 25/03/2037                                                                    | 42                                  | 40                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                                |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 25/02/2036                                                                    | 7                                   | 7                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,548 % éch. 25/01/2035                                                                    | 7                                   | 7                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,252 % éch. 25/09/2035                                                                    | 80                                  | 32                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                        |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,860 % éch. 25/09/2035                                                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                         |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/04/2047                                                                    | 236                                 | 218                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/09/2047                                                                    | 25                                  | 23                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,183 % éch. 25/07/2046                                                                    | 9                                   | 8                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,394 % éch. 20/12/2035                                                                    | 700                                 | 672                              | 0,06                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,744 % éch. 25/12/2035                                                                    | 30                                  | 27                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 25/04/2035                                                                    | 804                                 | 523                              | 0,05                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/05/2036                                                                    | 71                                  | 25                               | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/11/2036                                                                    | 117                                 | 58                               | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/07/2037                                                                    | 423                                 | 210                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                          |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/12/2035                                                                    | 11                                  | 5                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/02/2037                                                                    | 471                                 | 187                              | 0,02                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 25/08/2037                                                                    | 582                                 | 277                              | 0,03                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/07/2036                                                                    | 253                                 | 114                              | 0,01                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 25/11/2036                                                                    | 7                                   | 2                                | 0,00                      |                                                            |                                     |                                  |                           |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                                      |                                     |                                  |                           |                                                            |                                     |                                  |                           |
| 3,944 % éch. 19/10/2036                                                                    | 314                                 | 293                              | 0,03                      |                                                            |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN %<br>DE L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| PRETS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                        |                                     |                                  |                           | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                          |                                     |                                  |                           |
| Accredited Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/07/2036                                              | 82                                  | 63                               | 0,01                      |
| 4,023 % éch. 25/09/2036                                                    | \$ 62                               | \$ 62                            | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                              | 988                                 | 323                              | 0,03                      |
| 4,708 % éch. 25/09/2035                                                    | 1 500                               | 1 336                            | 0,13                      | 4,378 % éch. 25/12/2035                                              | 1 629                               | 1 544                            | 0,15                      |
| Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | 4,468 % éch. 25/11/2035                                              | 155                                 | 154                              | 0,01                      |
| 4,633 % éch. 25/01/2036                                                    | 3 243                               | 3 192                            | 0,30                      | 4,633 % éch. 25/05/2035                                              | 53                                  | 49                               | 0,00                      |
| Argent Mortgage Loan Trust                                                 |                                     |                                  |                           | Argent Securities Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,243 % éch. 25/05/2035                                                    |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 25/05/2036                                              | 154                                 | 36                               | 0,00                      |
| Argent Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/07/2036                                              | 81                                  | 74                               | 0,01                      |
| 3,983 % éch. 25/05/2036                                                    |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                           |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/07/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,223 % éch. 25/02/2037                                              | 2 427                               | 2 362                            | 0,22                      |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                 |                                     |                                  |                           | 4,618 % éch. 25/07/2034                                              | 899                                 | 892                              | 0,08                      |
| 4,223 % éch. 25/02/2037                                                    |                                     |                                  |                           | 4,783 % éch. 25/10/2035                                              | 146                                 | 146                              | 0,01                      |
| 4,618 % éch. 25/07/2034                                                    |                                     |                                  |                           | 4,813 % éch. 25/08/2037                                              | 654                                 | 594                              | 0,06                      |
| 4,783 % éch. 25/10/2035                                                    |                                     |                                  |                           | CIT Mortgage Loan Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,813 % éch. 25/08/2037                                                    |                                     |                                  |                           | 5,263 % éch. 25/10/2037                                              | 3 115                               | 3 148                            | 0,30                      |
| CIT Mortgage Loan Trust                                                    |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 5,263 % éch. 25/10/2037                                                    |                                     |                                  |                           | 4,708 % éch. 25/10/2034                                              | 15                                  | 14                               | 0,00                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates       |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,708 % éch. 25/10/2034                                                    |                                     |                                  |                           | 3,823 % éch. 25/07/2045                                              | 320                                 | 232                              | 0,02                      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                        |                                     |                                  |                           | 3,933 % éch. 25/07/2045                                              | 5 961                               | 4 325                            | 0,41                      |
| 3,823 % éch. 25/07/2045                                                    |                                     |                                  |                           | 4,023 % éch. 25/03/2037                                              | 2 180                               | 1 994                            | 0,19                      |
| 3,933 % éch. 25/07/2045                                                    |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/12/2036                                              | 88                                  | 32                               | 0,00                      |
| 4,023 % éch. 25/03/2037                                                    |                                     |                                  |                           | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/12/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 3,963 % éch. 25/06/2047                                              | 2 359                               | 2 081                            | 0,20                      |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/06/2035                                              | 2 572                               | 2 338                            | 0,22                      |
| 3,963 % éch. 25/06/2047                                                    |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/05/2047                                              | 55                                  | 54                               | 0,01                      |
| 4,043 % éch. 25/06/2035                                                    |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/09/2037                                              | 206                                 | 225                              | 0,02                      |
| 4,183 % éch. 25/05/2047                                                    |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/08/2035                                              | 119                                 | 118                              | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/09/2037                                                    |                                     |                                  |                           | 4,483 % éch. 25/05/2036                                              | 398                                 | 398                              | 0,04                      |
| 4,233 % éch. 25/08/2035                                                    |                                     |                                  |                           | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                    |                                     |                                  |                           |
| 4,483 % éch. 25/05/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,678 % éch. 25/01/2034                                              | 334                                 | 367                              | 0,03                      |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                          |                                     |                                  |                           | Ellington Loan Acquisition Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,678 % éch. 25/01/2034                                                    |                                     |                                  |                           | 4,863 % éch. 25/05/2037                                              | 1 554                               | 1 518                            | 0,14                      |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                           |                                     |                                  |                           | Fieldstone Mortgage Investment Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,863 % éch. 25/05/2037                                                    |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/04/2047                                              | 1 497                               | 999                              | 0,09                      |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust                                       |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,103 % éch. 25/04/2047                                                    |                                     |                                  |                           | 3,963 % éch. 25/08/2036                                              | 195                                 | 60                               | 0,01                      |
| Fremont Home Loan Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 4,033 % éch. 25/10/2036                                              | 108                                 | 98                               | 0,01                      |
| 3,963 % éch. 25/08/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,633 % éch. 25/05/2034                                              | 1 113                               | 1 115                            | 0,10                      |
| 4,033 % éch. 25/10/2036                                                    |                                     |                                  |                           | GE-WMC Mortgage Securities Trust                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,633 % éch. 25/05/2034                                                    |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/08/2036                                              | 4 647                               | 1 917                            | 0,18                      |
| GE-WMC Mortgage Securities Trust                                           |                                     |                                  |                           | GSAH Home Equity Trust                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,063 % éch. 25/08/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 5,772 % éch. 25/11/2036                                              | 435                                 | 121                              | 0,01                      |
| GSAH Home Equity Trust                                                     |                                     |                                  |                           | 5,985 % éch. 25/06/2036                                              | 1 259                               | 272                              | 0,03                      |
| 5,772 % éch. 25/11/2036                                                    |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,985 % éch. 25/06/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/11/2036                                              | 1 642                               | 744                              | 0,07                      |
| GSAMP Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 4,283 % éch. 25/02/2046                                              | 369                                 | 341                              | 0,03                      |
| 4,043 % éch. 25/11/2036                                                    |                                     |                                  |                           | HSI Asset Securitization Corp. Trust                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,283 % éch. 25/02/2046                                                    |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 25/01/2036                                              | 2 200                               | 1 913                            | 0,18                      |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust                                       |                                     |                                  |                           | Long Beach Mortgage Loan Trust                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,543 % éch. 25/01/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,203 % éch. 25/02/2036                                              | 144                                 | 143                              | 0,01                      |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           | 4,678 % éch. 25/08/2035                                              | 4 270                               | 3 980                            | 0,37                      |
| 4,203 % éch. 25/02/2036                                                    |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                               |                                     |                                  |                           |
| 4,678 % éch. 25/08/2035                                                    |                                     |                                  |                           | 3,833 % éch. 25/10/2036                                              | 1 278                               | 553                              | 0,05                      |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                     |                                     |                                  |                           | 3,893 % éch. 25/11/2036                                              | 1 471                               | 632                              | 0,06                      |
| 3,833 % éch. 25/10/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 3,903 % éch. 25/05/2037                                              | 1 061                               | 974                              | 0,09                      |
| 3,893 % éch. 25/11/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 3,993 % éch. 25/10/2036                                              | 1 022                               | 530                              | 0,05                      |
| 3,903 % éch. 25/05/2037                                                    |                                     |                                  |                           | 3,993 % éch. 25/11/2036                                              | 4 447                               | 2 478                            | 0,23                      |
| 3,993 % éch. 25/10/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,013 % éch. 25/07/2036                                              | 324                                 | 294                              | 0,03                      |
| 3,993 % éch. 25/11/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/09/2036                                              | 14 034                              | 4 714                            | 0,44                      |
| 4,013 % éch. 25/07/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/04/2036                                              | 71                                  | 69                               | 0,01                      |
| 4,063 % éch. 25/09/2036                                                    |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/12/2034                                              | 1 362                               | 1 290                            | 0,12                      |
| 4,263 % éch. 25/04/2036                                                    |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                                |                                     |                                  |                           |
| 4,303 % éch. 25/12/2034                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| NovaStar Mortgage Funding Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 4,083 % éch. 25/05/2036                               | \$ 7                                | \$ 7                             | 0,00                      |
| Option One Mortgage Loan Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 3,903 % éch. 25/03/2037                               | 541                                 | 491                              | 0,05                      |
| 3,983 % éch. 25/04/2037                               | 466                                 | 335                              | 0,03                      |
| 4,043 % éch. 25/01/2037                               | 43                                  | 25                               | 0,00                      |
| 4,043 % éch. 25/02/2037                               | 510                                 | 337                              | 0,03                      |
| 4,203 % éch. 25/05/2037                               | 527                                 | 318                              | 0,03                      |
| Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust               |                                     |                                  |                           |
| 4,258 % éch. 25/07/2036                               | 398                                 | 379                              | 0,04                      |
| RAAC Trust                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,523 % éch. 25/10/2046                               | 69                                  | 68                               | 0,01                      |
| Residential Asset Securities Corp. Trust              |                                     |                                  |                           |
| 4,103 % éch. 25/11/2036                               | 27                                  | 26                               | 0,00                      |
| SG Mortgage Securities Trust                          |                                     |                                  |                           |
| 4,183 % éch. 25/10/2036                               | 3 600                               | 2 970                            | 0,28                      |
| Soundview Home Loan Trust                             |                                     |                                  |                           |
| 3,963 % éch. 25/06/2037                               | 1 844                               | 1 312                            | 0,12                      |
| 4,263 % éch. 25/10/2036                               | 895                                 | 865                              | 0,08                      |
| 4,283 % éch. 25/02/2037                               | 934                                 | 250                              | 0,02                      |
| Structured Asset Investment Loan Trust                |                                     |                                  |                           |
| 4,738 % éch. 25/01/2035                               | 1 685                               | 1 615                            | 0,15                      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| 3,918 % éch. 25/09/2036                               | 3 843                               | 2 298                            | 0,22                      |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust             |                                     |                                  |                           |
| 3,988 % éch. 25/05/2037                               | 345                                 | 329                              | 0,03                      |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                     |                                  |                           |
| 4,363 % éch. 25/04/2037                               | 3 301                               | 2 450                            | 0,23                      |
| 5,488 % éch. 25/11/2035                               | 20                                  | 20                               | 0,00                      |
|                                                       |                                     | 67 297                           | 6,32                      |

## PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES

|                                                   |     |     |      |
|---------------------------------------------------|-----|-----|------|
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC |     |     |      |
| 2,928 % éch. 25/12/2036                           | 137 | 111 | 0,01 |

## AUTRES TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS

|                                             |          |       |      |
|---------------------------------------------|----------|-------|------|
| Arbour CLO DAC                              |          |       |      |
| 3,453 % éch. 15/08/2038                     | € 2 100  | 2 401 | 0,22 |
| Ares European CLO DAC                       |          |       |      |
| 3,088 % éch. 20/04/2032                     | 1 453    | 1 663 | 0,16 |
| Barings Euro CLO DAC                        |          |       |      |
| 3,426 % éch. 15/08/2039                     | 2 700    | 3 089 | 0,29 |
| Barings Private Credit Corp. CLO            |          |       |      |
| 5,126 % éch. 22/05/2034                     | \$ 2 400 | 2 402 | 0,22 |
| Black Diamond CLO DAC                       |          |       |      |
| 3,263 % éch. 15/05/2032                     | € 355    | 406   | 0,04 |
| Boyce Park CLO Ltd.                         |          |       |      |
| 4,672 % éch. 21/04/2035                     | \$ 3 300 | 3 302 | 0,31 |
| Cairn CLO DAC                               |          |       |      |
| 2,820 % éch. 31/01/2030                     | € 223    | 255   | 0,02 |
| Capital Four CLO DAC                        |          |       |      |
| 3,394 % éch. 15/04/2038                     | 3 800    | 4 345 | 0,41 |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                  |          |       |      |
| 3,066 % éch. 25/04/2036                     | 1 000    | 1 144 | 0,11 |
| Dryden Euro CLO DAC                         |          |       |      |
| 2,864 % éch. 15/04/2033                     | 1 389    | 1 589 | 0,15 |
| ICG Euro CLO DAC                            |          |       |      |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                     | 2 100    | 2 403 | 0,22 |
| Invesco Euro CLO DAC                        |          |       |      |
| 3,277 % éch. 15/07/2037                     | 2 200    | 2 518 | 0,24 |
| LCM 39 Ltd.                                 |          |       |      |
| 4,713 % éch. 15/10/2034                     | \$ 1 500 | 1 501 | 0,14 |
| MV Credit Euro CLO DAC                      |          |       |      |
| 3,583 % éch. 15/02/2038                     | € 1 600  | 1 831 | 0,17 |
| Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |          |       |      |
| 3,414 % éch. 15/07/2039                     | 3 500    | 4 007 | 0,38 |
| OCF Euro CLO DAC                            |          |       |      |
| 3,513 % éch. 15/04/2037                     | 2 400    | 2 744 | 0,26 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC     |          |       |      |
| 3,433 % éch. 15/02/2035                     | 1 257    | 1 438 | 0,13 |
| Penta CLO DAC                               |          |       |      |
| 3,015 % éch. 25/07/2036                     | 2 500    | 2 861 | 0,27 |
| Providus CLO DAC                            |          |       |      |
| 3,189 % éch. 20/05/2034                     | 1 800    | 2 061 | 0,19 |
| 3,374 % éch. 15/07/2038                     | 2 400    | 2 744 | 0,26 |

| DESCRIPTION               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| RRE Loan Management DAC   |                                     |                                  |                           |
| 3,494 % éch. 15/12/2039   | € 1 000                             | \$ 1 144                         | 0,11                      |
| Sculptor European CLO DAC |                                     |                                  |                           |
| 3,082 % éch. 10/10/2034   | 1 400                               | 1 602                            | 0,15                      |
| Sierra Madre Funding Ltd. |                                     |                                  |                           |
| 4,108 % éch. 07/09/2039   | \$ 1 629                            | 841                              | 0,08                      |
| Sound Point CLO Ltd.      |                                     |                                  |                           |
| 5,028 % éch. 26/07/2031   | 72                                  | 72                               | 0,01                      |
| 5,087 % éch. 18/04/2031   | 1 377                               | 1 378                            | 0,13                      |
| Toro European CLO DAC     |                                     |                                  |                           |
| 3,474 % éch. 15/04/2037   | € 1 500                             | 1 717                            | 0,16                      |
|                           |                                     | 51 458                           | 4,83                      |

## PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE

|                                              |        |         |       |
|----------------------------------------------|--------|---------|-------|
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.          |        |         |       |
| 7,250 % éch. 25/05/2036                      | \$ 694 | 336     | 0,03  |
| Lehman XS Trust                              |        |         |       |
| 4,645 % éch. 25/03/2037                      | 1 077  | 1 149   | 0,11  |
| Securitiz Asset-Backed Receivables LLC Trust |        |         |       |
| 4,083 % éch. 25/10/2036                      | 8 838  | 2 876   | 0,27  |
| 4,423 % éch. 25/08/2035                      | 36     | 28      | 0,00  |
|                                              |        | 4 389   | 0,41  |
|                                              |        | 124 082 | 11,65 |

## ÉMISSIONS SOUVERAINES

|                                                                   |                |        |      |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------|------|
| Baiterek National Investment Holding JSC                          |                |        |      |
| 16,950 % éch. 02/04/2029                                          | KZT 100 000    | 212    | 0,02 |
| 16,950 % éch. 02/04/2031                                          | 100 000        | 215    | 0,02 |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare                 |                |        |      |
| 3,625 % éch. 05/09/2032                                           | € 900          | 1 047  | 0,10 |
| 5,000 % éch. 05/03/2037                                           | \$ 1 000       | 978    | 0,09 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien               |                |        |      |
| 1,000 % éch. 18/09/2030                                           | COP 20 316 400 | 5 073  | 0,48 |
| 1,000 % éch. 24/01/2035                                           | 22 777 600     | 6 488  | 0,61 |
| 6,500 % éch. 21/01/2033                                           | \$ 400         | 407    | 0,04 |
| TES colombien                                                     |                |        |      |
| 3,000 % éch. 25/03/2033 (f)                                       | COP 373 261    | 89     | 0,01 |
| 6,500 % éch. 22/01/2031 (f)                                       | 5 225 648      | 1 503  | 0,14 |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                          | 5 952 000      | 1 676  | 0,16 |
| 11,500 % éch. 25/07/2046                                          | 796 500        | 224    | 0,02 |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                          | 10 536 500     | 3 002  | 0,28 |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                          | 20 309 700     | 6 146  | 0,58 |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                                          | 5 195 000      | 1 590  | 0,15 |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain             |                |        |      |
| 5,500 % éch. 21/11/2030                                           | € 500          | 601    | 0,06 |
| 6,001 % éch. 16/01/2036                                           | 500            | 605    | 0,06 |
| Development Bank of Kazakhstan JSC                                |                |        |      |
| 18,400 % éch. 16/10/2028                                          | KZT 156 500    | 341    | 0,03 |
| Eagle Funding Luxco SARL                                          |                |        |      |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                                           | \$ 2 400       | 2 413  | 0,23 |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                |        |      |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 700            | 698    | 0,06 |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                           | 1 400          | 1 424  | 0,13 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien               |                |        |      |
| 5,000 % éch. 30/10/2026                                           | € 3 300        | 3 798  | 0,36 |
| 5,625 % éch. 19/02/2035                                           | \$ 1 600       | 1 638  | 0,15 |
| Japan Finance Organization for Municipalities                     |                |        |      |
| 0,050 % éch. 12/02/2027                                           | € 1 500        | 1 688  | 0,16 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                |                |        |      |
| 2,000 % éch. 20/12/2044                                           | ¥ 980 000      | 4 782  | 0,45 |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                                           | 750 000        | 3 339  | 0,31 |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                                           | 210 000        | 958    | 0,09 |
| 3,700 % éch. 20/03/2056                                           | 363 700        | 2 163  | 0,20 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                |                |        |      |
| 5,400 % éch. 09/02/2028                                           | \$ 1 700       | 1 716  | 0,16 |
| 5,850 % éch. 02/07/2032                                           | 1 300          | 1 314  | 0,12 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                |                |        |      |
| 5,400 % éch. 12/08/2034                                           | PEN 13 000     | 3 726  | 0,35 |
| 6,150 % éch. 12/08/2032                                           | 16 200         | 5 146  | 0,48 |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                                           | 3 800          | 1 173  | 0,11 |
| 6,900 % éch. 12/08/2037                                           | 18 500         | 5 560  | 0,52 |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                                           | 36 161         | 12 064 | 1,13 |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                           | 20 700         | 6 801  | 0,64 |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                  |                |        |      |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                           | \$ 1 500       | 1 508  | 0,14 |

| DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 13/07/2030                                | € 1 500                             | \$ 1 558                         | 0,15                      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           |
| 4,850 % éch. 30/09/2029                                | \$ 2 000                            | 1 987                            | 0,19                      |
| 7,000 % éch. 28/02/2031                                | ZAR 304 400                         | 17 939                           | 1,68                      |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                | 103 900                             | 6 392                            | 0,60                      |
| 8,250 % éch. 31/03/2032                                | 17 100                              | 1 055                            | 0,10                      |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                | 62 000                              | 3 768                            | 0,35                      |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 52 800                              | 3 338                            | 0,31                      |
| 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 21 700                              | 1 339                            | 0,13                      |
| 9,875 % éch. 31/03/2039                                | 14 800                              | 977                              | 0,09                      |
|                                                        |                                     | 130 459                          | 12,24                     |

## ACTIONS

| ACTIONS ORDINAIRES                    |        |        |      |
|---------------------------------------|--------|--------|------|
| BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE |        |        |      |
| Booking Holdings, Inc.                | 83 000 | 14 794 | 1,39 |
| MercadoLibre, Inc. (d)                | 6 600  | 11 203 | 1,05 |
| Ross Stores, Inc.                     | 12 000 | 2 554  | 0,24 |
|                                       |        | 28 551 | 2,68 |

## SERVICES FINANCIERS

|                                         |     |   |      |
|-----------------------------------------|-----|---|------|
| Stichting                               |     |   |      |
| Administratiekantoor T.K.H. Holding (d) | 608 | 0 | 0,00 |

## TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION

|              |        |        |      |
|--------------|--------|--------|------|
| Apple, Inc.  | 47 000 | 13 600 | 1,27 |
| NVIDIA Corp. | 67 000 | 13 406 | 1,26 |
|              |        | 27 006 | 2,53 |
|              |        | 55 557 | 5,21 |

## TITRES PRIVILÉGIÉS

|                             |     |    |      |
|-----------------------------|-----|----|------|
| Nationwide Building Society |     |    |      |
| 10,250 %                    | 521 | 89 | 0,01 |

|  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |  |  |
|--|-------------------------------------|--|--|
|--|-------------------------------------|--|--|

## INSTRUMENTS À COURT TERME

| BILLETS DE TRÉSORERIE                        |        |       |      |
|----------------------------------------------|--------|-------|------|
| Alimentation Couche-Tard, Inc.               |        |       |      |
| 4,010 % éch. 17/07/2026                      | \$ 900 | 898   | 0,08 |
| Autoliv, Inc.                                |        |       |      |
| 4,070 % éch. 25/08/2026                      | 1 300  | 1 292 | 0,12 |
| Boston Properties LP                         |        |       |      |
| 4,050 % éch. 26/08/2026                      | 2 100  | 2 086 | 0,20 |
| CBRE Services, Inc.                          |        |       |      |
| 4,030 % éch. 15/07/2026                      | 2 200  | 2 196 | 0,21 |
| Constellation Energy Corp.                   |        |       |      |
| 4,060 % éch. 07/07/2026                      | 7 650  | 7 643 | 0,72 |
| Eaton Corp.                                  |        |       |      |
| 4,020 % éch. 08/07/2026                      | 6 000  | 5 995 | 0,56 |
| Fidelity National Information Services, Inc. |        |       |      |
| 4,000 % éch. 07/07/2026                      | 4 000  | 3 997 | 0,38 |
| 4,000 % éch. 09/07/2026                      | 2 350  | 2 348 | 0,22 |
| 4,020 % éch. 07/07/2026                      | 1 700  | 1 699 | 0,16 |
| Global Payments Inc.                         |        |       |      |
| 4,220 % éch. 02/07/2026                      | 8 050  | 8 048 | 0,76 |
| HCA, Inc.                                    |        |       |      |
| 4,220 % éch. 23/07/2026                      | 750    | 748   | 0,07 |
| 4,300 % éch. 10/09/2026                      | 3 400  | 3 370 | 0,32 |
| 4,350 % éch. 09/09/2026                      | 1 700  | 1 685 | 0,16 |
| JTI Financial Services North America LLC     |        |       |      |
| 4,100 % éch. 01/07/2026                      | 1 300  | 1 300 | 0,12 |
| Keurig Dr Pepper, Inc.                       |        |       |      |
| 4,300 % éch. 06/07/2026                      | 350    | 350   | 0,03 |
| 4,350 % éch. 17/07/2026                      | 2 750  | 2 745 | 0,26 |
| 4,400 % éch. 29/07/2026                      | 500    | 498   | 0,05 |
| 4,410 % éch. 24/08/2026                      | 500    | 497   | 0,05 |
| National Bank of Kuwait SAKP                 |        |       |      |
| 4,070 % éch. 18/09/2026                      | 250    | 248   | 0,02 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.        |        |       |      |
| 4,000 % éch. 22/07/2026                      | 250    | 249   | 0,02 |
| ONE Gas, Inc.                                |        |       |      |
| 4,030 % éch. 10/07/2026                      | 900    | 899   | 0,09 |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                  | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                               | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| Rogers Communications<br>4,250 % éch. 06/08/2026               | \$ 7 000                            | \$ 6 971                         | 0,65                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT<br/>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>                          |           |                                  |                           | <b>FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE</b>                                           |         |                                  |                           |
| Tampa Electric Co.<br>4,030 % éch. 13/07/2026                  | 1 000                               | 999                              | 0,09                      | PIMCO Funds: Global Investors<br>Series plc - Fonds PIMCO Asia<br>High Yield Bond Fund (h)   | 385 356   | \$ 4 701                         | 0,44                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO<br>US Dollar Short Maturity UCITS<br>ETF (h) | 543 400 | \$ 54 601                        | 5,12                      |
| Telus Corp.<br>4,270 % éch. 05/08/2026                         | 250                                 | 249                              | 0,02                      | PIMCO Funds: Global Investors<br>Series plc - Fonds Asia<br>Strategic Interest Bond Fund (h) | 1 197 507 | 13 472                           | 1,27                      | Total des Fonds d'investissement                                          |         | \$ 105 398                       | 9,89                      |
| 4,300 % éch. 19/08/2026                                        | 250                                 | 248                              | 0,02                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds<br>PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (h)        | 3 271 478 | 32 624                           | 3,06                      |                                                                           |         |                                  |                           |
| Triton Container International Ltd.<br>4,310 % éch. 07/07/2026 | 900                                 | 899                              | 0,08                      |                                                                                              |           | 50 797                           | 4,77                      |                                                                           |         |                                  |                           |
| 4,310 % éch. 09/07/2026                                        | 950                                 | 949                              | 0,09                      |                                                                                              |           |                                  |                           |                                                                           |         |                                  |                           |
| 4,330 % éch. 08/07/2026                                        | 900                                 | 899                              | 0,08                      |                                                                                              |           |                                  |                           |                                                                           |         |                                  |                           |
| Total des Instruments à court terme                            |                                     | 60 005                           | 5,63                      |                                                                                              |           |                                  |                           |                                                                           |         |                                  |                           |
| Total des Valeurs mobilières                                   |                                     | \$ 1 387 207                     | 130,18                    |                                                                                              |           |                                  |                           |                                                                           |         |                                  |                           |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                               | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| FICC                                  | 3,640 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 124 300              | Billet du Trésor américain 3,500 % échéance<br>15/03/2029 | \$ (126 786)        | \$ 124 300                                     | \$ 124 313                                                                     | 11,66                  |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                           | \$ (126 786)        | \$ 124 300                                     | \$ 124 313                                                                     | 11,66                  |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NEGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                   | Long  | 12/2026              | 373                   | \$ (83)                                 | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2026              | 96                    | (107)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois mars                            | Long  | 06/2027              | 120                   | 179                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Long  | 09/2026              | 1                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 54                    | (33)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 119                   | (183)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Long  | 09/2026              | 11                    | 29                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026              | 458                   | (47)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 47                    | (94)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 899                   | (138)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 927                   | 216                                     | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 1 119                 | 809                                     | 0,07                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026              | 2 132                 | (2 745)                                 | (0,26)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026              | 7                     | (19)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 84                    | 284                                     | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 81                    | 174                                     | 0,02                   |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ (2 189)                              | (0,21)                 |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NEGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime   | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|---------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | \$ 108,250         | 02/07/2026           | 18                    | \$ (3)  | \$ 0            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 02/07/2026           | 35                    | (6)     | 0               | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 02/07/2026           | 18                    | (3)     | (1)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500            | 02/07/2026           | 35                    | (6)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000            | 10/07/2026           | 13                    | (2)     | (1)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750            | 10/07/2026           | 13                    | (2)     | 0               | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750            | 17/07/2026           | 20                    | (5)     | (2)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250            | 17/07/2026           | 19                    | (3)     | (4)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250            | 17/07/2026           | 20                    | (4)     | (4)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000            | 17/07/2026           | 19                    | (4)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,000            | 24/07/2026           | 16                    | (5)     | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,500            | 24/07/2026           | 30                    | (9)     | (4)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 109,500            | 24/07/2026           | 21                    | (5)     | (8)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026     | 111,000            | 24/07/2026           | 67                    | (16)    | (7)             | 0,00                   |
|                                                                                                           |                    |                      |                       | \$ (73) | \$ (34)         | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                                |                    |                      |                       |         | \$ (2 223)      | (0,21)                 |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 450                           | \$ 3                              | 0,00                |
| Ford Motor Credit Co. LLC       | 5,000                | 20/06/2027      | 500                              | (4)                               | 0,00                |
| Lloyds Banking Group PLC        | 1,000                | 20/12/2030      | € 1 100                          | 9                                 | 0,00                |
| Oracle Corp.                    | 1,000                | 20/06/2030      | \$600                            | (22)                              | 0,00                |
|                                 |                      |                 |                                  | \$ (14)                           | 0,00                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | (5,000) %           | 20/12/2028      | \$ 9 967                         | \$ (87)                           | (0,01)              |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000 %              | 20/06/2031      | \$ 7 000                         | \$ 4                              | 0,00                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | € 5 600                          | 5                                 | 0,00                |
|                                            |                      |                 |                                  | \$ 9                              | 0,00                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 37 340          | \$ (396)                          | (0,04)              |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,930     | 06/01/2035      | 200               | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      | 390               | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/03/2028      | ¥ 15 610 000      | (184)                             | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2028      | 10 124 000        | (37)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,700     | 19/09/2028      | \$ 53 900         | 2 476                             | 0,23                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 21/12/2052      | 24 900            | 4 668                             | 0,44                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,842     | 19/09/2053      | 200               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,874     | 19/09/2053      | 8 800             | 638                               | 0,06                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,999     | 03/07/2053      | 10 500            | 3 408                             | 0,32                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 12/02/2030      | 9 900             | 886                               | 0,08                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,000     | 10/03/2030      | 4 900             | 355                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,060     | 27/10/2053      | 6 200             | 2 111                             | 0,20                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2055      | 10 100            | 198                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,430     | 27/02/2033      | 1 900             | (50)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/12/2054      | 3 100             | 426                               | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,545     | 31/10/2030      | 1 900             | 30                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 800               | 32                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,564     | 31/01/2033      | 1 100             | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,582     | 31/10/2030      | 18 100            | 259                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,592     | 31/10/2030      | 39 400            | 545                               | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,601     | 31/10/2030      | 3 700             | 50                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,623     | 31/10/2030      | 3 600             | 45                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,664     | 31/10/2030      | 2 400             | 25                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,677     | 31/10/2030      | 1 900             | 19                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,679     | 15/02/2036      | 430               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,691     | 31/10/2030      | 2 580             | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,739     | 31/10/2030      | 2 800             | 20                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027      | 161 500           | (1 590)                           | (0,15)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2031      | 7 630             | 87                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 37 200            | 331                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 6 390             | 245                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,755     | 15/02/2036      | 2 300             | 46                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,800     | 14/07/2044      | 850               | 36                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,842     | 04/03/2030      | 300               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,870     | 05/03/2035      | 400               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,874     | 05/03/2035      | 400               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,884     | 25/03/2035      | 800               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,890     | 03/03/2035      | 500               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,899     | 11/03/2035      | 600               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,905     | 12/03/2035      | 600               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,908     | 04/03/2035      | 700               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,960     | 22/05/2036      | 1 600             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      | 600               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      | 110               | 4                                 | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 %   | 30/11/2030      | \$ 3 600          | \$ 3                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 26/02/2035      | 550               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 15/02/2036      | 600               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/06/2056      | 16 100            | (160)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,002     | 28/05/2036      | 3 000             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,010     | 15/11/2053      | 200               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 15/11/2053      | 200               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,052     | 15/02/2056      | 300               | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,082     | 15/11/2053      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 11,566    | 04/01/2027      | BRL 78 580        | (648)                             | (0,06)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,175    | 02/01/2029      | 30 790            | (146)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,268    | 02/01/2029      | 48 400            | (158)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,354    | 02/01/2029      | 213 000           | (955)                             | (0,09)              |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 8,500     | 28/04/2028      | COP 25 111 100    | 348                               | 0,03                |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 8,750     | 18/09/2030      | 15 846 800        | 239                               | 0,02                |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 9,650     | 17/12/2030      | 5 083 200         | (31)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 9,655     | 24/01/2035      | 270 000           | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 9,725     | 17/12/2030      | 2 478 400         | (13)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 9,788     | 17/12/2030      | 4 956 300         | (23)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 9,820     | 24/01/2035      | 4 106 200         | (12)                              | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 18/09/2034      | AUD 52 380        | (860)                             | (0,08)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 18/06/2035      | 56 700            | (971)                             | (0,09)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,335     | 01/07/2036      | CZK 3 050         | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,375     | 01/07/2036      | 3 050             | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,485     | 02/12/2035      | 2 600             | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,510     | 17/06/2036      | 3 900             | 1                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,523     | 01/12/2035      | 23 600            | 10                                | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,668     | 16/06/2036      | 5 000             | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,700     | 23/03/2036      | 600               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,415     | 09/07/2035      | € 15 500          | (249)                             | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,500     | 16/09/2031      | 9 700             | (137)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,750     | 16/09/2036      | 13 300            | 21                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,000     | 16/09/2056      | 11 000            | 158                               | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,625     | 01/07/2036      | PLN 550           | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,665     | 01/07/2036      | 550               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,685     | 02/12/2035      | 460               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,723     | 01/12/2035      | 4 220             | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,800     | 17/06/2036      | 700               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,960     | 16/06/2036      | 900               | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | WIBOR PLN à 6 mois            | 5,200     | 23/03/2036      | 100               | 1                                 | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ 11 238                         | 1,06                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ 11 146                         | 1,05                |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 1 636                            | \$ 17  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 864                              | 6      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 3 565                            | 170    | 338          | 0,03                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 193 | \$ 338       | 0,03                |

## SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,784 %         | 08/09/2026        | 4 600                            | \$ 13    | \$ 13        | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,470           | 04/06/2035        | 2 700                            | 242      | 207          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,470           | 04/06/2035        | 2 700                            | 242      | 219          | 0,02                |
| BPS          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,786           | 06/08/2026        | 4 600                            | 13       | 6            | 0,00                |
| DUB          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757           | 18/09/2026        | 57 700                           | 47       | 216          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,111           | 28/05/2027        | 22 900                           | 75       | 74           | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,663           | 04/09/2026        | 1 000                            | 2        | 2            | 0,00                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757           | 18/09/2026        | 90 800                           | 70       | 339          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,110           | 28/05/2027        | 3 200                            | 10       | 10           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,800           | 12/07/2034        | 8 500                            | 734      | 467          | 0,04                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,800           | 12/07/2034        | 8 500                            | 735      | 825          | 0,08                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,819           | 06/08/2026        | 2 500                            | 7        | 4            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 2 190 | \$ 2 382     | 0,22                |

## OPTIONS VENDUES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 1 636                            | \$ (6)   | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 864                              | (2)      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 7 130                            | (170)    | (282)        | (0,03)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 375,000     | 10/11/2026        | 1 228                            | (20)     | (11)         | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (198) | \$ (293)     | (0,03)              |

## SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004 %         | 08/07/2026        | 1 600                            | \$ (4) | \$ (4)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 1 600                            | (4)    | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (8) | \$ (4)       | 0,00                |

## OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                           | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/08/2056 | \$ 95,422       | 06/08/2026        | 3 300                            | \$ (6)  | \$ (2)       | 0,00                |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/09/2056 | 99,422          | 08/09/2026        | 6 800                            | (13)    | (14)         | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/09/2056 | 100,188         | 04/09/2026        | 1 500                            | (2)     | (1)          | 0,00                |
| SAL          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/08/2056 | 95,516          | 06/08/2026        | 5 800                            | (13)    | (3)          | 0,00                |
|              |                                                                                                                       |                 |                   |                                  | \$ (34) | \$ (20)      | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 %              | 17/11/2059      | \$ 1 339                         | \$ (6)                 | \$ 7                             | \$ 1         | 0,00                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 61                               | 0                      | 0                                | 0            | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 913                              | (2)                    | 3                                | 1            | 0,00                |
| UAG          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 183                              | (5)                    | 5                                | 0            | 0,00                |
|              |                             |                      |                 |                                  | \$ (13)                | \$ 15                            | \$ 2         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                  | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | À payer            | Apple, Inc.            | 47 000                       | 4,580 %       | \$ 13 895         | 13/07/2026      | \$ 0                   | \$ 328                           | \$ 328       | 0,03                |
|              | À payer            | Booking Holdings, Inc. | 83 000                       | 4,580         | 13 578            | 13/07/2026      | 0                      | (1 183)                          | (1 183)      | (0,11)              |
|              | À payer            | MercadoLibre, Inc.     | 6 600                        | 4,580         | 10 626            | 13/07/2026      | 0                      | (551)                            | (551)        | (0,05)              |
|              | À payer            | Nvidia Corp.           | 67 000                       | 4,580         | 13 726            | 13/07/2026      | 0                      | 354                              | 354          | 0,03                |
|              | À payer            | Ross Stores, Inc.      | 12 000                       | 4,580         | 2 869             | 13/07/2026      | 0                      | 322                              | 322          | 0,03                |
|              |                    |                        |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (730)                         | \$ (730)     | (0,07)              |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 383               | \$ 274             | \$ 9                  | \$ 0                                    | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 016             | 150                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 7 171             | 4 235              | 156                   | 0                                       | 156                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | \$              | 99                | CAD 141            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 637             | NZD 6 438          | 25                    | 0                                       | 25                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 141               | \$ 99              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 6 438             | 3 641              | 0                     | (25)                                    | (25)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 104               | 20                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 1 505             | 152                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 11                | 9                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| BOA          | 07/2026           | \$              | 850               | CNH 5 748          | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 135               | ¥ 21 522           | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 100               | NOK 925            | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 96                | PLN 363            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 532             | \$ 515             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 357               | ZAR 6 467          | 36                    | 0                                       | 36                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             | 11 759 155        | \$ 3 145           | 0                     | (207)                                   | (207)               | (0,02) |
|              | 09/2026           | KZT             | 65 988            | 131                | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 975             | 111                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 69                | INR 6 562          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| BPS          | 09/2026           |                 | 158               | PEN 538            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 2 696             | \$ 521             | 2                     | (2)                                     | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 720               | 915                | 23                    | 0                                       | 23                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 4 497             | 665                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CZK             | 624               | 30                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 3 975             | 4 534              | 0                     | (11)                                    | (11)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 424               | 569                | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 98 579 363        | 5 501              | 4                     | (3)                                     | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 2 524             | 856                | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 180 567           | 1 880              | 0                     | (28)                                    | (28)                | 0,00   |
| BRC          | 07/2026           | KRW             | 423 771           | 278                | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 25 458            | 776                | 10                    | (1)                                     | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 133               | BRL 673            | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 124             | £ 835              | 0                     | (16)                                    | (16)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 5 447             | INR 516 612        | 12                    | (10)                                    | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 458               | ¥ 72 800           | 0                     | (10)                                    | (10)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 315             | KRW 2 017 069      | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 349               | TWD 11 001         | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 39 900            | \$ 2 432           | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 349               | 117                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| BSH          | 09/2026           | IDR             | 10 305 547        | 567                | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 23 622            | 728                | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 3 349             | IDR 59 284 208     | 4                     | (67)                                    | (63)                | (0,01) |
|              | 09/2026           |                 | 416               | INR 39 486         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 140               | THB 4 579          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 353               | IDR 6 435 816      | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | COP             | 37 484 640        | \$ 9 873           | 0                     | (933)                                   | (933)               | (0,09) |
|              | 07/2026           | ILS             | 4 254             | 1 437              | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 10 417            | 6 160              | 235                   | 0                                       | 235                 | 0,02   |
|              | 07/2026           | TRY             | 67 978            | 1 422              | 0                     | (18)                                    | (18)                | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           | \$              | 540               | BRL 2 795          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 10 889            | COP 37 484 640     | 0                     | (82)                                    | (82)                | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 8 278             | TRY 394 246        | 40                    | 0                                       | 40                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 197 057           | \$ 12 132          | 128                   | 0                                       | 128                 | 0,01   |
|              | 08/2026           | \$              | 177               | ZAR 3 116          | 12                    | 0                                       | 12                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             | 37 484 640        | \$ 10 752          | 68                    | 0                                       | 68                  | 0,01   |
|              | 07/2026           | €               | 1 070             | 1 244              | 21                    | 0                                       | 21                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 2 426             | ¥ 385 780          | 0                     | (53)                                    | (53)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 5 299             | NZD 9 378          | 36                    | 0                                       | 36                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 9 378             | \$ 5 305           | 0                     | (36)                                    | (36)                | 0,00   |
| CBK          | 09/2026           | \$              | 1 118             | BRL 5 735          | 0                     | (27)                                    | (27)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 2 814             | \$ 969             | 24                    | 0                                       | 24                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 120 506           | 1 277              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 1 848             | 200                | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 858               | € 736              | 0                     | (17)                                    | (17)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 764               | HUF 233 615        | 0                     | (14)                                    | (14)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 048             | IDR 18 801 362     | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 244             | INR 120 506        | 29                    | 0                                       | 29                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 138               | KRW 209 092        | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 620             | PEN 8 902          | 0                     | (11)                                    | (11)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 711               | PLN 2 599          | 0                     | (20)                                    | (20)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 125               | TWD 3 940          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 3 793             | \$ 1 312           | 37                    | 0                                       | 37                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 287               | ILS 851            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 37 716 864        | \$ 2 089           | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | INR             | 12 555            | 131                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | KZT             | 137 794           | 273                | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | PEN             | 12 104            | 3 516              | 1                     | (24)                                    | (23)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 39 192            | 1 193              | 9                     | (3)                                     | 6                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 692               | IDR 12 346 193     | 0                     | (8)                                     | (8)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 306               | MXN 5 481          | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 09/2026           | \$ 8            | PEN 28            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 10 328      | \$ 3 013          | 7                  | (11)                  | (4)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | 18 430          | 5 384             | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 1 041        | IDR 18 933 034    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 674         | \$ 32             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 2 518 816   | 141               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 47 423      | 502               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 4 555       | 1 347             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 335          | INR 32 326        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 247             | NOK 2 297         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 711             | PLN 2 636         | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 91 633      | \$ 5 661          | 79                 | 0                     | 79                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | PEN 9 331       | 2 761             | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 24 397 246  | 1 354             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 425          | IDR 7 716 053     | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 502             | INR 47 745        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 22 055          | MXN 384 933       | 0                  | (164)                 | (164)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 2               | PEN 7             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN 25 472      | \$ 7 383          | 4                  | (58)                  | (54)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 02/2027           | 47 728          | 13 731            | 0                  | (145)                 | (145)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CNH 4 474       | 661               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 17 049        | 22 927            | 298                | 0                     | 298                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | INR 47 045      | 499               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 947 333     | 12 035            | 54                 | 0                     | 54                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | PEN 2 414       | 714               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 20 162      | 15 804            | 216                | 0                     | 216                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 1 745        | CNH 11 867        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 579             | HUF 178 994       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 493             | INR 47 045        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 082           | ¥ 171 951         | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 822           | PLN 10 366        | 0                  | (64)                  | (64)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 113             | SEK 1 100         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 130 540     | \$ 7 910          | 0                  | (42)                  | (42)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 11 841      | 1 745             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 602       | 560               | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 2 093       | 619               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 1 098       | 113               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 12 035       | ¥ 1 942 238       | 0                  | (54)                  | (54)                                    | (0,01)              |
| GLM          | 09/2026           | 241             | INR 23 083        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 249             | MXN 4 392         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 113 367     | \$ 22 019         | 117                | 0                     | 117                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW 405 414     | 263               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 20 642       | BRL 111 287       | 891                | (32)                  | 859                                     | 0,08                |
|              | 07/2026           | 9 558           | CAD 13 602        | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 004           | IDR 17 999 855    | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 263             | KRW 405 356       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 13 582      | \$ 9 558          | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 330          | INR 31 615        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 18 105 264  | \$ 1 004          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 1 387       | 79                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 132 456     | 4 105             | 92                 | 0                     | 92                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$ 1 982        | IDR 35 584 616    | 4                  | (13)                  | (9)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 339           | INR 128 734       | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 959             | MXN 16 812        | 1                  | (4)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | 22 015          | BRL 115 839       | 0                  | (117)                 | (117)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | AUD 1 659       | \$ 1 183          | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 250         | 320               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 9 931       | 3 325             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | INR 6 905       | 73                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 125 276     | 81                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 5 380       | 544               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 144        | £ 853             | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 306           | HUF 705 230       | 0                  | (41)                  | (41)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 153             | IDR 2 754 685     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 73              | INR 6 905         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 120             | KRW 185 027       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 127           | PLN 7 760         | 0                  | (63)                  | (63)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 552             | THB 18 454        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 6 236       | \$ 2 142          | 47                 | 0                     | 47                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 544          | NOK 5 382         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 2 769 993   | \$ 153            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 7 762       | 81                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 4 947       | 281               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 87 692      | 2 698             | 48                 | (6)                   | 42                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 713          | INR 67 943        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 147           | MXN 20 024        | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | MXN 43 193      | \$ 2 448          | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 1 055       | 728               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 6 552       | 8 314             | 199                | (7)                   | 192                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | € 8 426         | 9 759             | 125                | 0                     | 125                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR 247 561     | 14                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 47 611      | 504               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | NOK             | 1 735             | \$ 175             | \$ 0                  | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 769             | AUD 3 948          | 8                     | (42)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 163             | € 1 868            | 4                     | (31)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 777               | INR 74 927         | 13                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 262             | ¥ 359 469          | 0                     | (51)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 589               | NOK 5 459          | 0                     | (37)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 69                | SEK 672            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 671               | \$ 69              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 723               | AUD 1 048          | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 175               | NOK 1 736          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 16 470            | \$ 493             | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 110             | INR 201 869        | 10                    | (3)                                     | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | €               | 7                 | \$ 8               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 3                 | € 3                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 680             | £ 3 533            | 9                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 934               | IDR 16 661 037     | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 786               | INR 75 623         | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 013             | TRY 47 682         | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 16 754 475        | \$ 934             | 6                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 09/2026           | \$              | 424               | IDR 7 537 626      | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 356               | 6 389 353          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 035             | INR 99 162         | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 002             | NZD 1 772          | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 820               | INR 78 526         | 7                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 19 147 063        | \$ 1 061           | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 21 603            | 43                 | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 47 574            | 1 473              | 32                    | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 09/2026           | \$              | 1 080             | IDR 19 386 799     | 2                     | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 851               | \$ 587             | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 7 628             | 1 128              | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 117 501           | 137 070            | 2 730                 | 0                                       | 0,26                |
|              | 07/2026           | SGD             | 30                | 23                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 9 298             | CHF 7 522          | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 142 675           | € 125 428          | 728                   | 0                                       | 0,07                |
|              | 07/2026           |                 | 5 892             | ¥ 936 052          | 0                     | (133)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 15 601            | SGD 20 203         | 19                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 7 495             | \$ 9 298           | 0                     | (27)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 125 428           | 142 868            | 0                     | (726)                                   | (0,07)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 20 158            | 15 601             | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 587               | AUD 851            | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           |                 | 23                | SGD 30             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 13 982            | \$ 10 139          | 285                   | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$              | 88                | CAD 124            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 20 866            | £ 15 786           | 85                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD             | 124               | \$ 88              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 2 927             | 3 342              | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | £               | 15 786            | 20 866             | 0                     | (85)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 723               | PLN 2 643          | 0                     | (20)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 5 269 584         | \$ 1 412           | 0                     | (90)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 085             | 119                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 3 040             | 93                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | HUF             | 101 650           | € 282              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 7 398           | \$ (3 927)            | \$ 3 471                                | 0,33                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$              | 28                | € 24               | \$ 0                  | \$ (1)                                  | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 10 710            | 9 193              | 0                     | (200)                                   | (0,02)              |
| BSH          | 07/2026           |                 | 10 302            | 8 836              | 0                     | (199)                                   | (0,02)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 115               | 99                 | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | 8 652             | \$ 9 867           | 0                     | (24)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 9 880             | € 8 652            | 24                    | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | €               | 9 614             | \$ 10 929          | 7                     | (69)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 151               | € 131              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 10 470            | 9 205              | 69                    | 0                                       | 0,01                |
| SOG          | 07/2026           | €               | 9 205             | \$ 10 471          | 0                     | (53)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 10 718            | € 9 188            | 0                     | (214)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           |                 | 10 485            | 9 205              | 53                    | 0                                       | 0,01                |
|              |                   |                 |                   | \$ 153             | \$ (764)              | \$ (611)                                | (0,06)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 274 129      | £ 204 190         | \$ 0               | \$ (3 119)            | \$ (3 119)                              | (0,29)              |
| BPS          | 07/2026           | £ 186 321       | \$ 245 725        | 3                  | (1 572)               | (1 569)                                 | (0,15)              |
|              | 07/2026           | \$ 298 401      | £ 222 690         | 0                  | (2 836)               | (2 836)                                 | (0,27)              |
|              | 08/2026           | 245 497         | 186 156           | 1 573              | 0                     | 1 573                                   | 0,15                |
| FAR          | 07/2026           | £ 1 226         | \$ 1 622          | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14 880       | £ 11 065          | 0                  | (194)                 | (194)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 1 622           | 1 226             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 302 020         | 225 076           | 0                  | (3 287)               | (3 287)                                 | (0,31)              |
| MBC          | 07/2026           | £ 5             | \$ 6              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 624        | £ 5 004           | 25                 | (7)                   | 18                                      | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 43 528        | \$ 57 285         | 0                  | (488)                 | (488)                                   | (0,05)              |
|              | 08/2026           | \$ 57 283       | £ 43 528          | 489                | 0                     | 489                                     | 0,05                |
| SCX          | 07/2026           | £ 216 182       | \$ 286 139        | 0                  | (789)                 | (789)                                   | (0,07)              |
|              | 08/2026           | \$ 286 127      | £ 216 182         | 794                | 0                     | 794                                     | 0,08                |
| SOG          | 07/2026           | £ 216 528       | \$ 286 036        | 0                  | (1 351)               | (1 351)                                 | (0,13)              |
|              | 08/2026           | \$ 286 028      | £ 216 528         | 1 352              | 0                     | 1 352                                   | 0,13                |
| SSB          | 07/2026           | £ 2 229         | \$ 2 947          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2 947        | £ 2 229           | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 253           | \$ (13 660)           | \$ (9 407)                              | (0,88)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (4 872) (0,46)

#### DESCRIPTION

#### AUTRES ACTIFS FINANCIERS

Credit Suisse AG AT1 Claim

\$ 7 900 \$ 2 785 0,26

Total des Autres actifs financiers

\$ 2 785 0,26

#### TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

#### AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN

Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA  
2,000 % éch. 01/07/2056

46 900 \$ (37 461) (3,51)

Total des Titres vendus à découvert

\$ (37 461) (3,51)

Total des Investissements

\$ 1 586 280 148,86

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (520 627) (48,86)

Actif net

\$ 1 065 653 100,00

#### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à rémunération en nature.

(d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(e) Titre à coupon zéro.

(f) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(g) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(h) Affilié au Fonds.

(i) Titre convertible conditionnel.

(j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Chick-fil-A, Inc.         | 4,800 % | 21/07/2031      | 23/04/2026   | \$ 1 700 | \$ 1 682     | 0,16                |

(k) Un titre d'une juste valeur globale de 202 \$ (31 décembre 2025 : 1 319 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 18 823 \$ (31 décembre 2025 : 16 378 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 12 570 \$ (31 décembre 2025 : 1 670 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 55 557                                                                         | \$ 1 305 702                                         | \$ 25 948                                         | \$ 1 387 207        |
| Fonds d'investissement                        | 105 398                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 105 398             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 124 300                                              | 0                                                 | 124 300             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (56)                                                                              | 4 107                                                | 0                                                 | 4 051               |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 2 785                                                | 0                                                 | 2 785               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (37 461)                                             | 0                                                 | (37 461)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 160 899</b>                                                                 | <b>\$ 1 399 433</b>                                  | <b>\$ 25 948</b>                                  | <b>\$ 1 586 280</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 91                                                                             | \$ 1 026 027                                         | \$ 9 325                                          | \$ 1 035 443        |
| Fonds d'investissement                        | 87 159                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 87 159              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 225 700                                              | 0                                                 | 225 700             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 640                                                                               | 32 957                                               | 0                                                 | 33 597              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 2 331                                                | 0                                                 | 2 331               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (37 923)                                             | 0                                                 | (37 923)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 87 890</b>                                                                  | <b>\$ 1 249 092</b>                                  | <b>\$ 9 325</b>                                   | <b>\$ 1 346 307</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                           | (0,250) %      | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (176)          | \$ (201)                                 | (0,02)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (201)</b>                          | <b>(0,02)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (2 953)                                                 | \$ 4 060                | \$ 1 107                          | \$ 6 394                                                   | \$ (7 430)              | \$ (1 036)                        |
| BOA          | 290                                                        | 280                     | 570                               | 461                                                        | 0                       | 461                               |
| BPS          | (3 835)                                                    | 3 970                   | 135                               | (115)                                                      | 0                       | (115)                             |
| BRC          | (541)                                                      | 390                     | (151)                             | 7 657                                                      | (8 140)                 | (483)                             |
| BSH          | (258)                                                      | 280                     | 22                                | (378)                                                      | 0                       | (378)                             |
| CBK          | 10                                                         | 0                       | 10                                | (453)                                                      | 680                     | 227                               |
| DUB          | 35                                                         | 0                       | 35                                | (220)                                                      | 0                       | (220)                             |
| FAR          | 229                                                        | (290)                   | (61)                              | (580)                                                      | 560                     | (20)                              |
| GLM          | 955                                                        | (1 130)                 | (175)                             | (108)                                                      | 120                     | 12                                |
| GST          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 7                                                          | 0                       | 7                                 |
| JPM          | (3 278)                                                    | 3 590                   | 312                               | (58)                                                       | 20                      | (38)                              |
| MBC          | 207                                                        | (300)                   | (93)                              | (50)                                                       | 0                       | (50)                              |
| MYC          | 1 645                                                      | (260)                   | 1 385                             | 1 361                                                      | 10                      | 1 371                             |
| MYI          | 9                                                          | (50)                    | (41)                              | (14)                                                       | (50)                    | (64)                              |
| NSL          | 15                                                         | 0                       | 15                                | 13                                                         | 0                       | 13                                |
| SAL          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| SCX          | 55                                                         | 0                       | 55                                | 296                                                        | (260)                   | 36                                |
| SOG          | 2 389                                                      | (2 470)                 | (81)                              | 5 910                                                      | (6 200)                 | (290)                             |
| SSB          | 276                                                        | (300)                   | (24)                              | 570                                                        | (420)                   | 150                               |
| UAG          | (121)                                                      | 0                       | (121)                             | (255)                                                      | 0                       | (255)                             |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 19,66            | 15,65                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 35,14            | 33,33                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,46             | 0,03                 |
| Fonds d'investissement                                           | 4,20             | 4,13                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 4,95             | 10,68                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,06             | 0,07                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,71             | 0,82                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,62             | 1,22                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,11             | 0,11                 |
| Autres actifs                                                    | 34,09            | 33,96                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,79             | 0,73                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 25,22            | 17,35                |
| Obligations et billets municipaux                                                                        | 0,76             | 0,93                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 56,41            | 57,15                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 8,97             | 11,78                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 3,29             | 4,69                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 11,65            | 11,35                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 12,24            | 12,68                |
| Actions ordinaires                                                                                       | 5,21             | 0,00                 |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,01             | 0,01                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 5,63             | 0,09                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 9,89             | 9,83                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 11,66            | 25,45                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | (0,21)           | 0,11                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | (0,01)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,01)           | (0,02)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 1,06             | 1,40                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,03             | 0,03                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,22             | 0,21                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | (0,03)           | (0,03)               |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Options sur titres                                                                                       | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O              | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | (0,07)           | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,33             | (0,37)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,94)           | 2,47                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,26             | 0,26                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (3,51)           | (4,28)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (48,86)          | (51,81)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE EN % DE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                                                  |                                     |                                          |                           | <b>INDUSTRIE</b>                                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>                                     |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>5,398 % éch. 08/11/2030             | \$                                  | 20                                       | 0,37                      | Ball Corp.<br>2,875 % éch. 15/08/2030                                                | \$                                  | 16                               | 0,28                      | 5,500 % éch. 01/08/2053                                                                   | \$                                  | 79                               | 1,49                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                                       |                                     |                                          |                           | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                      |                                     | 53                               | 1,01                      | 6,000 % éch. 01/10/2054                                                                   |                                     | 306                              | 5,85                      |
| <b>BANQUE ET FINANCE</b>                                                   |                                     |                                          |                           | Discovery Global Holdings, Inc.<br>4,054 % éch. 15/03/2029                           |                                     | 28                               | 0,52                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA<br>3,500 % éch. 01/07/2056 |                                     | 120                              | 2,03                      |
| American Tower Corp.<br>1,450 % éch. 15/09/2026                            |                                     | 36                                       | 0,67                      | Elevance Health, Inc.<br>2,550 % éch. 15/03/2031                                     |                                     | 28                               | 0,47                      | 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                   |                                     | 150                              | 2,74                      |
| Bank of America Corp.<br>4,623 % éch. 09/05/2029                           |                                     | 30                                       | 0,56                      | Ford Motor Co.<br>6,100 % éch. 19/08/2032                                            |                                     | 10                               | 0,19                      | 5,500 % éch. 01/08/2056                                                                   |                                     | 50                               | 0,93                      |
| CA Immobilien Anlagen AG<br>3,500 % éch. 07/07/2029 (a)                    | €                                   | 10                                       | 0,20                      | Givaudan Finance Europe BV<br>2,875 % éch. 09/09/2029                                | €                                   | 100                              | 2,11                      |                                                                                           |                                     | 2 015                            | 37,54                     |
| CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF<br>3,500 % éch. 22/09/2032 |                                     | 100                                      | 2,09                      | HCA, Inc.<br>3,625 % éch. 15/03/2032                                                 | \$                                  | 28                               | 0,48                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                    |                                     |                                  |                           |
| Commerzbank AG<br>3,625 % éch. 14/01/2032                                  |                                     | 100                                      | 2,14                      | Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>3,750 % éch. 01/05/2029                       |                                     | 18                               | 0,32                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)<br>1,375 % éch. 15/07/2033 (e) |                                     | 357                              | 6,39                      |
| Cooperative Rabobank UA<br>4,875 % éch. 01/11/2030                         | £                                   | 100                                      | 2,48                      | Latvenergo A/S<br>3,612 % éch. 13/11/2030                                            | €                                   | 100                              | 2,12                      | Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/11/2034 (e)                                |                                     | 248                              | 4,57                      |
| Corebridge Financial, Inc.<br>3,850 % éch. 05/04/2029                      | \$                                  | 18                                       | 0,34                      | MSCI, Inc.<br>3,625 % éch. 01/09/2030                                                | \$                                  | 22                               | 0,39                      |                                                                                           |                                     | 588                              | 10,96                     |
| Equitable Financial Life Global Funding<br>1,300 % éch. 12/07/2026         |                                     | 28                                       | 0,52                      | Norsk Hydro ASA<br>3,625 % éch. 23/01/2032                                           | €                                   | 100                              | 2,14                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                        |                                     |                                  |                           |
| Banque européenne d'investissement<br>2,375 % éch. 24/05/2027              |                                     | 67                                       | 1,23                      | NXP BV<br>2,500 % éch. 11/05/2031                                                    | \$                                  | 50                               | 0,84                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES</b>                                     |                                     |                                  |                           |
| HSBC Holdings PLC<br>5,750 % éch. 20/12/2027                               | £                                   | 16                                       | 0,39                      | S&P Global, Inc.<br>4,750 % éch. 01/08/2028                                          |                                     | 48                               | 0,89                      | Bumper NL BV<br>2,925 % éch. 21/03/2036                                                   | €                                   | 74                               | 1,59                      |
| Hudson Pacific Properties LP<br>5,950 % éch. 15/02/2028                    | \$                                  | 10                                       | 0,19                      | South West Water Finance PLC<br>5,250 % éch. 15/09/2031                              | £                                   | 100                              | 2,46                      | <b>AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                 |                                     |                                  |                           |
| JPMorgan Chase & Co.<br>2,947 % éch. 24/02/2028                            |                                     | 52                                       | 0,95                      | Xylem, Inc.<br>1,950 % éch. 30/01/2028                                               | \$                                  | 30                               | 0,54                      | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.<br>4,941 % éch. 11/04/2045                       | \$                                  | 159                              | 2,96                      |
| Kilroy Realty LP<br>2,650 % éch. 15/11/2033                                |                                     | 20                                       | 0,30                      |                                                                                      |                                     | 792                              | 14,76                     | St. Paul's CLO DAC<br>2,954 % éch. 15/01/2032                                             | €                                   | 4                                | 0,10                      |
| Manulife Financial Corp.<br>3,703 % éch. 16/03/2032                        |                                     | 26                                       | 0,47                      | <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     | 164                              | 3,06                      |
| Morgan Stanley<br>6,407 % éch. 01/11/2029                                  |                                     | 25                                       | 0,48                      | AES Corp.<br>5,450 % éch. 01/06/2028                                                 |                                     | 20                               | 0,37                      |                                                                                           |                                     | 249                              | 4,65                      |
| NatWest Group PLC<br>4,067 % éch. 06/09/2028                               | €                                   | 100                                      | 2,16                      | Clearway Energy Operating LLC<br>3,750 % éch. 15/02/2031                             |                                     | 14                               | 0,24                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                                              |                                     |                                  |                           |
| PPI Public Property Invest AB<br>3,250 % éch. 21/04/2029                   |                                     | 100                                      | 2,12                      | Duke Energy Florida LLC<br>2,500 % éch. 01/12/2029                                   |                                     | 54                               | 0,95                      | TES colombien<br>11,000 % éch. 22/08/2029                                                 | COP                                 | 36 000                           | 0,19                      |
| Prologis International Funding S.A.<br>0,875 % éch. 09/07/2029             |                                     | 125                                      | 2,50                      | Eurogrid GmbH<br>3,075 % éch. 18/10/2027                                             | €                                   | 100                              | 2,14                      | 11,750 % éch. 24/01/2035                                                                  |                                     | 35 000                           | 0,19                      |
| SBA Communications Corp.<br>3,875 % éch. 15/02/2027                        | \$                                  | 18                                       | 0,34                      | New York State Electric & Gas Corp.<br>5,650 % éch. 15/08/2028                       | \$                                  | 30                               | 0,57                      | 12,750 % éch. 28/11/2040                                                                  |                                     | 37 000                           | 0,21                      |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>6,500 % éch. 15/10/2030                   |                                     | 10                                       | 0,19                      | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>1,900 % éch. 15/06/2028                     |                                     | 54                               | 0,95                      | 13,250 % éch. 09/02/2033                                                                  |                                     | 32 000                           | 0,19                      |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>5,500 % éch. 09/03/2028                 |                                     | 200                                      | 3,78                      | Verizon Communications, Inc.<br>1,500 % éch. 18/09/2030                              |                                     | 25                               | 0,41                      | Obligation internationale du gouvernement japonais<br>3,700 % éch. 20/03/2056             | ¥                                   | 10 000                           | 1,10                      |
| Toronto-Dominion Bank<br>5,264 % éch. 11/12/2026                           |                                     | 20                                       | 0,37                      |                                                                                      |                                     | 303                              | 5,63                      | Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>5,400 % éch. 12/08/2034             | PEN                                 | 300                              | 1,60                      |
| Volkswagen Bank GmbH<br>3,625 % éch. 26/11/2028                            | €                                   | 100                                      | 2,14                      | Total des Obligations et billets privés                                              |                                     | 2 523                            | 47,00                     | 6,900 % éch. 12/08/2037                                                                   |                                     | 100                              | 0,56                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                             |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 12/08/2031                                                                   |                                     | 81                               | 0,50                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>4,000 % éch. 01/07/2053 |                                     | 81                               | 1,42                      | Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,375 % éch. 22/03/2031              | €                                   | 30                               | 0,67                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           | 5,000 % éch. 01/05/2053 - 01/10/2053                                                 |                                     | 1 252                            | 23,08                     | Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>7,000 % éch. 28/02/2031         | ZAR                                 | 1 800                            | 1,98                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 31/01/2030                                                                   |                                     | 900                              | 1,02                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 31/03/2032                                                                   |                                     | 100                              | 0,11                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 31/01/2040                                                                   |                                     | 300                              | 0,35                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                           |                                     | 465                              | 8,67                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,673 % éch.<br>04/08/2026 (a)(b)(c)                                                      | \$                                  | 100                              | 1,86                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | Total des Instruments à court terme                                                       |                                     | 100                              | 1,86                      |
|                                                                            |                                     |                                          |                           |                                                                                      |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                                                              | \$                                  | 5 960                            | 111,05                    |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                     | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                     | Long  | 12/2026              | 2                     | \$ 0                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                            | Long  | 09/2026              | 1                     | (1)                                     | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois mars              | Long  | 06/2027              | 1                     | 1                                       | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                           | Court | 09/2026              | 6                     | (3)                                     | (0,06)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre       | Court | 09/2026              | 1                     | (2)                                     | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                         | Court | 09/2026              | 3                     | 0                                       | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre  | Long  | 09/2026              | 6                     | 0                                       | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre  | Long  | 09/2026              | 9                     | 1                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 8                     | 6                                       | 0,10                   |



| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 6                  | \$ (14)                                 | (0,23)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 2                  | (7)                                     | (0,12)                 |
|                                                                                               |       |                   |                    | \$ (19)                                 | (0,35)                 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | \$ (19)                                 | (0,35)                 |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 150             | \$ (4)                                  | (0,08)              |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/03/2028      | ¥ 75 000          | (1)                                     | (0,02)              |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/06/2030      | 25 000            | 1                                       | 0,01                |
| À recevoir                       | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 18/06/2035      | 10 000            | 2                                       | 0,03                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 16/09/2028      | 59 000            | 0                                       | 0,00                |
| À payer                          | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 19/03/2055      | 2 500             | (1)                                     | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2055      | \$ 30             | 1                                       | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055      | 50                | (1)                                     | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,582     | 31/10/2030      | 100               | 1                                       | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,592     | 31/10/2030      | 300               | 4                                       | 0,08                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,602     | 31/10/2030      | 100               | 1                                       | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,606     | 31/10/2030      | 100               | 1                                       | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,687     | 31/10/2030      | 100               | 1                                       | 0,02                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,722     | 31/10/2030      | 100               | 1                                       | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 200               | 1                                       | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2031      | 85                | 1                                       | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 200               | 2                                       | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 285               | 9                                       | 0,20                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2035      | 72                | 2                                       | 0,03                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2045      | 20                | 1                                       | 0,01                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,800     | 14/07/2044      | 10                | 0                                       | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 80                | (1)                                     | (0,01)              |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,002     | 28/05/2036      | 100               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 10,768    | 04/01/2027      | BRL 500           | (6)                                     | (0,11)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,175    | 02/01/2029      | 100               | (1)                                     | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,268    | 02/01/2029      | 300               | (1)                                     | (0,02)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an                   | 13,354    | 02/01/2029      | 1 000             | (4)                                     | (0,08)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/09/2034      | AUD 350           | (5)                                     | (0,10)              |
| À payer                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/06/2035      | 225               | (6)                                     | (0,13)              |
| À payer                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,415     | 09/07/2035      | € 100             | (2)                                     | (0,03)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031      | 200               | (3)                                     | (0,05)              |
| À payer <sup>(1)</sup>           | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 10                | 0                                       | 0,00                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>        | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 50                | 1                                       | 0,02                |
|                                  |                                   |           |                 |                   | \$ (6)                                  | (0,11)              |
|                                  |                                   |           |                 |                   | \$ (6)                                  | (0,11)              |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## OPTIONS ACHETÉES

## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 26                               | \$ 1 | \$ 2         | 0,05                |

## SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| DUB          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757 %         | 18/09/2026        | 400                              | \$ 0  | \$ 2         | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,111           | 28/05/2027        | 100                              | 0     | 0            | 0,01                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,757           | 18/09/2026        | 600                              | 1     | 2            | 0,04                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,800           | 12/07/2034        | 100                              | 9     | 5            | 0,10                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,800           | 12/07/2034        | 100                              | 9     | 11           | 0,17                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 19 | \$ 20        | 0,35                |

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund (suite)

### OPTIONS VENDUES

### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 52                               | \$ (1) | \$ (2)       | (0,04)              |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 375,000     | 10/11/2026        | 6                                | 0      | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (1) | \$ (2)       | (0,04)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | KRW             | 965               | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 7                 | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | ¥ 212              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10                | NOK 90             | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 3                 | ZAR 47             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 82 258            | \$ 22              | 0                     | (2)                                     | (0,03)              |
|              | 09/2026           | \$              | 1                 | INR 91             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 7                 | \$ 9               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 337 970           | 19                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 960               | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$              | 23                | INR 2 137          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | ¥ 718              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19                | KRW 29 746         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 216               | \$ 13              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 56 457            | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 130               | 4                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 18                | IDR 319 486        | 0                     | 0                                       | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 2                 | INR 208            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 0                 | THB 0              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 3                 | IDR 56 841         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | NZD             | 89                | \$ 53              | 3                     | 3                                       | 0,04                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 1 067             | 66                 | 1                     | 1                                       | 0,01                |
| BSH          | 08/2026           | \$              | 1                 | ZAR 18             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 24                | ¥ 3 804            | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 50                | NZD 89             | 0                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | NZD             | 89                | \$ 50              | 0                     | 0                                       | (0,01)              |
| CBK          | 09/2026           | COP             | 17 091            | 4                  | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | \$              | 118               | BRL 604            | 0                     | (4)                                     | (0,05)              |
|              | 07/2026           | INR             | 972               | \$ 10              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 45                | 5                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 3                 | € 3                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | HUF 1 444          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | IDR 90 842         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10                | INR 972            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | PLN 20             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 289 868           | \$ 16              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 09/2026           | THB             | 457               | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4                 | IDR 76 561         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2                 | MXN 42             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 11                | IDR 199 834        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 263               | \$ 3               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 16                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2                 | INR 179            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | PLN 20             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 496               | \$ 31              | 0                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | IDR             | 163 681           | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 09/2026           | PEN             | 508               | 148                | 0                     | 0                                       | (0,01)              |
|              | 09/2026           | \$              | 3                 | IDR 47 895         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3                 | INR 264            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 233               | \$ 313             | 5                     | 5                                       | 0,08                |
|              | 07/2026           | INR             | 256               | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 13 094            | 81                 | 0                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 99                | 78                 | 1                     | 1                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 3                 | INR 256            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1                 | ¥ 88               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 18                | PLN 65             | 0                     | 0                                       | (0,01)              |
| GLM          | 07/2026           |                 | 3                 | SEK 27             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 707               | \$ 43              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 27                | 3                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 81                | ¥ 13 059           | 0                     | 0                                       | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 1                 | INR 126            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2                 | MXN 34             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 9 265             | \$ 6               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 50                | CAD 71             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6                 | KRW 9 263          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 71                | \$ 50              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2                 | INR 166            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 411               | \$ 13              | 0                     | 0                                       | 0,01                |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |         |      |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------|------|
| JPM                                                | 09/2026           | \$              | 12                | IDR 220 732        | \$ 0                  | \$ 0                                    | \$ 0                | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           |                 | 7                 | INR 680            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | AUD             | 40                | \$ 28              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,01    |      |
|                                                    | 07/2026           | INR             | 429               | 5                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | KRW             | 2 863             | 2                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | NOK             | 21                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 16                | £ 12               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 14                | HUF 4 361          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 1                 | IDR 15 749         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 5                 | INR 429            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 2                 | KRW 2 863          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 6                 | PLN 23             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           |                 | 2                 | NOK 21             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | IDR             | 15 837            | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 212               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 9                 | INR 824            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| MBC                                                | 09/2026           |                 | 114               | MXN 1 988          | 0                     | (1)                                     | (1)                 | (0,02)  |      |
|                                                    | 12/2026           | MXN             | 268               | \$ 15              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | AUD             | 9                 | 7                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | CHF             | 18                | 23                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,01    |      |
|                                                    | 07/2026           | INR             | 264               | 3                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | KRW             | 16 593            | 11                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | NOK             | 46                | 5                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 12                | AUD 17             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 4                 | INR 415            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 33                | ¥ 5 244            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | (0,01)  |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 2                 | SEK 17             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           | AUD             | 9                 | \$ 6               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           | SEK             | 16                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 1                 | NOK 7              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 963               | \$ 30              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,01    |      |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 11                | INR 1 075          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| MYI                                                | 07/2026           |                 | 13                | AUD 18             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| NSL                                                | 07/2026           |                 | 4                 | INR 419            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| SCX                                                | 09/2026           |                 | 3                 | IDR 46 746         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 2                 | 36 500             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| SOG                                                | 07/2026           |                 | 6                 | INR 549            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           |                 | 4                 | 413                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | IDR             | 122 053           | \$ 7               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 146               | 5                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 7                 | IDR 120 235        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | €               | 1 159             | \$ 1 352           | 27                    | 0                                       | 27                  | 0,49    |      |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 10                | AUD 14             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 1 315             | € 1 156            | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,13    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 58                | ¥ 9 229            | 0                     | (1)                                     | (1)                 | (0,02)  |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 77                | SGD 99             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| SSB                                                | 08/2026           | AUD             | 14                | \$ 10              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           | €               | 1 156             | 1 316              | 0                     | (8)                                     | (8)                 | (0,12)  |      |
|                                                    | 08/2026           | SGD             | 99                | 77                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 73                | 53                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,03    |      |
|                                                    | 07/2026           | ¥               | 6 200             | 39                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,01    |      |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 0                 | CAD 1              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           |                 | 292               | £ 221              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,02    |      |
|                                                    | 08/2026           | CAD             | 1                 | \$ 0               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           | COP             | 12 595            | 3                  | 0                     | 0                                       | 0                   | (0,01)  |      |
|                                                    | 08/2026           | £               | 221               | 292                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | (0,02)  |      |
| UAG                                                | 07/2026           | \$              | 5                 | PLN 20             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
| WST                                                | 09/2026           | COP             | 37 320            | \$ 10              | 0                     | (1)                                     | (1)                 | (0,01)  |      |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 63                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 11/2026           | HUF             | 360               | € 1                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 31                | CHF 25             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    | 08/2026           | CHF             | 25                | \$ 31              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00    |      |
|                                                    |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 51                                   | \$ (23)             | \$ 28   | 0,53 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       |                                         | \$ 48               | 0,89    |      |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       |                                         | \$ 5 983            | 111,48  |      |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       |                                         | \$ (616)            | (11,48) |      |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       |                                         | \$ 5 367            | 100,00  |      |

## NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 588 \$ (31 décembre 2025 : 250 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 30 juin 2026.

## Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund (suite)

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2025 : 866 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 139 \$ (31 décembre 2025 : 131 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur    |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 5 801                                             | \$ 159                                            | \$ 5 960        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (4)                                                                               | 27                                                   | 0                                                 | 23              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ (4)</b>                                                                     | <b>\$ 5 828</b>                                      | <b>\$ 159</b>                                     | <b>\$ 5 983</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur    |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 6 270                                             | \$ 184                                            | \$ 6 454        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 8                                                                                 | (27)                                                 | 0                                                 | (19)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 8</b>                                                                       | <b>\$ 6 243</b>                                      | <b>\$ 184</b>                                     | <b>\$ 6 435</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                                             | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                                                      | 3,730 %        | 16/06/2026        | 07/07/2026      | \$ (591)         | \$ (592)                                                            | (11,03)             |
| <b>Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (592)</b>                                                     | <b>(11,03)</b>      |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| BOA          | \$ (3)                                                     | \$ 0                    | \$ (3)                            | \$ S/O                                                     | \$ S/O                  | \$ S/O                            |
| BRC          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| BSH          | (6)                                                        | 0                       | (6)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| DUB          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| FAR          | 6                                                          | 0                       | 6                                 | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |
| MBC          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 0                                                          | 0                       | 0                                 |
| MYC          | 18                                                         | 0                       | 18                                | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| SCX          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| SOG          | 26                                                         | 0                       | 26                                | (20)                                                       | 0                       | (20)                              |
| SSB          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| UAG          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 49,97            | 47,62                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 42,35            | 38,18                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,12             | 0,17                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,46             | 0,20                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,14             | 0,56                 |
| Autres actifs                                                    | 5,96             | 13,27                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                  | 0,37             | 0,38                 |
| Obligations et billets privés                                    | 47,00            | 52,69                |
| Agences du gouvernement américain                                | 37,54            | 41,48                |
| Obligations du Trésor américain                                  | 10,96            | 11,16                |
| Titres adossés à des actifs                                      | 4,65             | 6,16                 |
| Émissions souveraines                                            | 8,67             | 8,14                 |
| Instruments à court terme                                        | 1,86             | 1,89                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                    | (0,35)           | 0,19                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                          | (0,11)           | (0,43)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         |                  |                      |
| Options achetées                                                 |                  |                      |
| Options de change                                                | 0,05             | 0,04                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                      | 0,35             | 0,31                 |
| Options vendues                                                  |                  |                      |
| Options de change                                                | (0,04)           | (0,04)               |
| Contrats de change à terme                                       | 0,53             | (0,64)               |
| Contrats de change à terme couverts                              | S/O              | 0,22                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                           | (11,48)          | (21,55)              |
| Actif net                                                        | 100,00           | 100,00               |

## Tableau des investissements Fonds MAARS Multi-Strategy Fund

| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>               |                                     |                                  |                           | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>  |                                     |                                  |                           | <b>Jabil, Inc.</b>                       |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>    |                                     |                                  |                           | Ginnie Mae, TBA                           |                                     |                                  |                           | 4,150 % éch. 06/07/2026                  | \$ 300                              | \$ 300                           | 0,78                      |
| <b>BANQUE ET FINANCE</b>                |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/06/2040                   | \$ 100                              | \$ 101                           | 0,26                      | Jones Lang LaSalle Finance BV            |                                     |                                  |                           |
| AerCap Ireland Capital DAC              |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>        |                                     |                                  |                           | 4,130 % éch. 09/07/2026                  | 300                                 | 30                               | 0,78                      |
| 6,450 % éch. 15/04/2027                 | \$ 150                              | \$ 152                           | 0,40                      | <b>AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b> |                                     |                                  |                           | McCormick & Co. Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| Aries Capital DAC                       |                                     |                                  |                           | Aqueduct European CLO DAC                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 02/07/2026                  | 300                                 | 300                              | 0,78                      |
| 0,000 % éch. 10/06/2033 (b)             | 1 778                               | 1 704                            | 4,45                      | 3,511 % éch. 15/07/2039 (a)               | € 300                               | 343                              | 0,89                      | Triton Container International Ltd.      |                                     |                                  |                           |
| Cooperatieve Rabobank UA                |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 02/07/2026                  | 300                                 | 300                              | 0,78                      |
| 4,048 % éch. 09/06/2028                 | 200                                 | 200                              | 0,52                      | 3,523 % éch. 25/07/2037 (a)               | 300                                 | 343                              | 0,90                      |                                          |                                     | 2 093                            | 5,46                      |
| First Abu Dhabi Bank PJSC               |                                     |                                  |                           | Marble Point CLO Ltd.                     |                                     |                                  |                           | <b>BILLETS À COURT TERME</b>             |                                     |                                  |                           |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                 | 200                                 | 200                              | 0,52                      | 4,667 % éch. 16/11/2034                   | \$ 250                              | 250                              | 0,65                      | Federal Home Loan Bank                   |                                     |                                  |                           |
| Goldman Sachs Group, Inc.               |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                          |                                     |                                  |                           | 3,630 % éch. 26/08/2026 (b)(c)           | 900                                 | 895                              | 2,34                      |
| 1,542 % éch. 10/09/2027                 | 200                                 | 199                              | 0,52                      | 3,513 % éch. 15/04/2037                   | € 300                               | 343                              | 0,90                      | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>          |                                     |                                  |                           |
| HSBC Holdings PLC                       |                                     |                                  |                           | Tikehau U.S. CLO Ltd.                     |                                     |                                  |                           | 3,673 % éch. 27/08/2026 (b)(c)           | 1 100                               | 1 094                            | 2,85                      |
| 4,755 % éch. 09/06/2028                 | 200                                 | 200                              | 0,52                      | 4,767 % éch. 18/01/2035                   | \$ 250                              | 250                              | 0,65                      | 3,677 % éch. 11/08/2026 (b)(c)           | 3 100                               | 3 087                            | 8,06                      |
| KeyCorp                                 |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | 3,745 % éch. 17/09/2026 (b)(c)           | 3 000                               | 2 976                            | 7,77                      |
| 2,250 % éch. 06/04/2027                 | 200                                 | 197                              | 0,51                      | <b>ACTIONS</b>                            |                                     |                                  |                           | 3,765 % éch. 17/09/2026 (b)(c)           | 1 100                               | 1 091                            | 2,84                      |
| Mizuho Financial Group, Inc.            |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                 |                                     |                                  |                           | 3,767 % éch. 24/09/2026 (b)(c)           | 400                                 | 397                              | 1,04                      |
| 4,486 % éch. 13/07/2030 (a)             | 400                                 | 400                              | 1,05                      | <b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>      |                                     |                                  |                           |                                          |                                     | 8 645                            | 22,56                     |
| Santander Holdings USA, Inc.            |                                     |                                  |                           | Apple, Inc.                               | 1 968                               | 570                              | 1,49                      | Total des Instruments à court terme      |                                     | 11 633                           | 30,36                     |
| 3,244 % éch. 05/10/2026                 | 200                                 | 199                              | 0,52                      | NVIDIA Corp.                              | 2 801                               | 560                              | 1,46                      |                                          |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     | 3 451                            | 9,01                      |                                           |                                     | 1 130                            | 2,95                      | Total des Valeurs mobilières             |                                     | \$18 646                         | 48,67                     |
| <b>INDUSTRIE</b>                        |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                           |                                     |                                  |                           |
| Glencore Funding LLC                    |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 27/03/2027                 | 200                                 | 200                              | 0,52                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>          |                                     |                                  |                           | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |                                     |                                  |                           |
| NTT Finance Corp.                       |                                     |                                  |                           | <b>BILLETS DE TRÉSORERIE</b>              |                                     |                                  |                           | PIMCO Select Funds plc -                 |                                     |                                  |                           |
| 4,465 % éch. 20/06/2029 (a)             | 200                                 | 200                              | 0,52                      | AMETEK, Inc.                              |                                     |                                  |                           | Fonds PIMCO US Dollar                    |                                     |                                  |                           |
| 5,104 % éch. 02/07/2027                 | 200                                 | 201                              | 0,53                      | 4,100 % éch. 10/08/2026                   | \$ 300                              | 298                              | 0,78                      | Short-Term Floating NAV                  |                                     |                                  |                           |
| Penske Truck Leasing Co. LP             |                                     |                                  |                           | Campbell Soup Co.                         |                                     |                                  |                           | Fund (d)                                 | 170 468                             | 1 700                            | 4,44                      |
| 3,400 % éch. 15/11/2026                 | 202                                 | 201                              | 0,53                      | 4,270 % éch. 30/09/2026                   | 300                                 | 297                              | 0,78                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     | 802                              | 2,10                      | Entergy Corp.                             |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO             |                                     |                                  |                           |
| Total des Obligations et billets privés |                                     | 4 253                            | 11,11                     | 4,060 % éch. 12/08/2026                   | 300                                 | 298                              | 0,78                      | US Dollar Short Maturity                 |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | UCITS ETF (d)                            | 19 900                              | 2 000                            | 5,22                      |
|                                         |                                     |                                  |                           |                                           |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement         |                                     | \$3 700                          | 9,66                      |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                              | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BPS                                   | 3,690 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 6 200                | Titres du Trésor américain protégés<br>contre l'inflation 1,875 %<br>échéance 15/07/2035 | \$ (6 296)          | \$ 6 200                                       | \$ 6 201                                                                       | 16,19                  |
|                                       | 3,700           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 7 200                   | Ginnie Mae 4,000 % éch. 20/01/2049                                                       | (7 842)             | 7 200                                          | 7 201                                                                          | 18,80                  |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                                          | \$ (14 138)         | \$ 13 400                                      | \$ 13 402                                                                      | 34,99                  |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur CORRA à 3 mois décembre                                  | Long  | 03/2027              | 2                     | \$ 0                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                | Court | 12/2027              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois mars                                    | Court | 03/2027              | 3                     | (2)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars                                       | Court | 06/2027              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                  | Court | 12/2027              | 21                    | (1)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois septembre                    | Court | 12/2027              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre      | Long  | 09/2026              | 8                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 2                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index juillet                              | Court | 07/2026              | 6                     | 3                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index septembre                               | Court | 09/2026              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini NASDAQ 100 Index septembre                 | Long  | 09/2026              | 1                     | 16                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index septembre               | Court | 09/2026              | 1                     | (4)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre                    | Long  | 09/2026              | 3                     | 15                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice STOXX 50 septembre                                | Court | 09/2026              | 2                     | (1)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Euro STOXX Bank Index septembre                   | Long  | 09/2026              | 15                    | 3                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre    | Long  | 09/2026              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre    | Court | 09/2026              | 1                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                  | Long  | 09/2026              | 54                    | (8)                                     | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index septembre                          | Long  | 09/2026              | 3                     | 1                                       | 0,00                   |



| Description                                                                            | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index juillet                  | Long  | 07/2026           | 78                 | \$ 8                                    | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE Taiwan Index juillet                     | Long  | 07/2026           | 3                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index septembre                      | Court | 09/2026           | 5                  | 15                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index septembre                      | Long  | 09/2026           | 3                  | (7)                                     | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Hang Seng China Enterprises Index juillet     | Long  | 07/2026           | 1                  | (3)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Hang Seng China Enterprises Index juillet     | Court | 07/2026           | 12                 | 13                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index juillet                  | Long  | 07/2026           | 26                 | (5)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Nikkei 225 Index septembre                    | Long  | 09/2026           | 1                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index juillet                          | Long  | 07/2026           | 4                  | 3                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P/Toronto Stock Exchange 60 Index septembre | Long  | 09/2026           | 4                  | (4)                                     | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index septembre                       | Court | 09/2026           | 6                  | 10                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026           | 95                 | (17)                                    | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 16                 | (17)                                    | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Volatility S&P 500 Index juillet              | Court | 07/2026           | 10                 | 15                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice VSTOXX Mini Index juillet                     | Court | 07/2026           | 8                  | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index septembre                         | Long  | 09/2026           | 10                 | (4)                                     | (0,01)                 |
|                                                                                        |       |                   |                    | <b>\$ 27</b>                            | <b>0,07</b>            |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé             |       |                   |                    | <b>\$ 27</b>                            | <b>0,07</b>            |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans             | 1,000 %              | 20/06/2031      | \$ 2 190                         | \$ 7                                    | 0,02                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans             | 5,000                | 20/06/2031      | 515                              | 1                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                | 20/06/2031      | 4 800                            | 1                                       | 0,01                   |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans   | 5,000                | 20/06/2031      | € 180                            | 1                                       | 0,00                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 2 700                            | 1                                       | 0,00                   |
|                                            |                      |                 |                                  | <b>\$ 11</b>                            | <b>0,03</b>            |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer <sup>(3)</sup>               | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 16/09/2028      | £ 448             | \$ 0                                    | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031      | 8 700             | (94)                                    | (0,25)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>               | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036      | 9 503             | 161                                     | 0,42                   |
| À payer <sup>(3)</sup>               | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056      | 3 257             | 79                                      | 0,21                   |
| À payer                              | SHIR ILS composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031      | ILS 3 900         | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,250     | 16/09/2031      | INR 104 800       | (18)                                    | (0,05)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>               | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2036      | ¥ 3 175 100       | (54)                                    | (0,14)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,750     | 16/09/2056      | 110 000           | 2                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 16/09/2031      | THB 24 600        | (8)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 16/09/2028      | \$ 1 453          | 2                                       | 0,01                   |
| À payer <sup>(3)</sup>               | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 16/09/2031      | 8 900             | 15                                      | 0,04                   |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/06/2036      | 8 608             | (10)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 13 745            | (60)                                    | (0,16)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 16/09/2056      | 500               | (4)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,038     | 22/06/2036      | 1 500             | (2)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,071     | 26/06/2036      | 1 500             | (6)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,188     | 22/06/2036      | 1 500             | (21)                                    | (0,05)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                   | 12,975    | 02/01/2031      | BRL 11 200        | (13)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir                           | CDI BRL à un an                   | 14,020    | 02/01/2031      | 2 200             | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | CDI BRL à un an                   | 14,684    | 02/01/2031      | 2 000             | (6)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 16/09/2028      | CAD 505           | (2)                                     | (0,01)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>               | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 16/09/2031      | 300               | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 16/09/2036      | 1 220             | (4)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 16/09/2056      | 212               | (1)                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>               | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 16/09/2031      | CNY 13 700        | 8                                       | 0,02                   |
| À recevoir                           | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,500    | 17/06/2031      | COP 1 695 500     | (9)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir                           | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,730    | 17/06/2031      | 1 807 700         | (46)                                    | (0,12)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | KORIBOR KRW à 3 mois              | 3,500     | 16/09/2031      | KRW 1 040 900     | (2)                                     | (0,01)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>               | KORIBOR KRW à 3 mois              | 3,500     | 16/09/2036      | 3 612 500         | 8                                       | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | KLIBOR MYR à 3 mois               | 3,500     | 16/09/2031      | MYR 5 400         | (3)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | TAIBOR TWD à 3 mois               | 2,250     | 16/09/2031      | TWD 27 200        | (7)                                     | (0,02)                 |
| À recevoir                           | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,522     | 29/01/2031      | ZAR 4 500         | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                           | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,673     | 14/04/2031      | 3 700             | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 16/09/2028      | AUD 4 373         | (8)                                     | (0,02)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>               | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2036      | 12 050            | 127                                     | 0,33                   |
| À payer <sup>(3)</sup>               | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2031      | CLP 1 227 800     | 2                                       | 0,01                   |
| À recevoir                           | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,250     | 17/06/2031      | 487 900           | (12)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | PRIBOR CZK à 6 mois               | 3,920     | 09/02/2031      | CZK 10 100        | (2)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                           | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,000     | 17/06/2036      | 5 300             | (1)                                     | 0,00                   |

## Tableau des investissements Fonds MAARS Multi-Strategy Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,250 %   | 16/09/2028      | € 1 773           | \$ (6)                            | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500     | 16/09/2031      | 19 700            | (169)                             | (0,44)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      | 5 899             | (93)                              | (0,24)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      | 600               | (18)                              | (0,05)              |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | HIBOR HKD à 6 mois      | 2,750     | 16/09/2031      | HKD 7 700         | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | BBR HUF à 6 mois        | 5,750     | 17/06/2031      | HUF 263 700       | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois      | 3,750     | 17/06/2031      | PLN 13 600        | (77)                              | (0,20)              |
| À payer                                            | WIBOR PLN à 6 mois      | 4,065     | 24/11/2030      | 600               | 4                                 | 0,01                |
| À payer <sup>(2)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours     | 7,750     | 10/09/2031      | MXN 68 500        | (21)                              | (0,05)              |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      | 74 100            | 3                                 | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,080     | 11/06/2031      | 5 500             | 6                                 | 0,02                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours     | 8,250     | 03/09/2036      | 2 300             | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CPURNSA                 | 2,598     | 10/04/2034      | \$ 400            | (1)                               | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   | \$ (361)                          | (0,94)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   | \$ (350)                          | (0,91)              |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 20 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,595 %         | 21/05/2036        | 1 610                            | \$ 208 | \$ 222       | 0,59                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 20 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,595           | 21/05/2036        | 1 610                            | 208    | 187          | 0,49                |
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 3,098           | 21/05/2036        | 650                              | 110    | 115          | 0,30                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 3,098           | 21/05/2036        | 650                              | 110    | 103          | 0,27                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 636 | \$ 627       | 1,65                |

#### OPTIONS VENDUES

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| CBK          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,992 %         | 08/07/2026        | 1 500                            | \$ (3)  | \$ (3)       | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,122           | 08/07/2026        | 1 500                            | (9)     | (14)         | (0,03)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,122           | 08/07/2026        | 1 500                            | (9)     | (1)          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,252           | 08/07/2026        | 1 500                            | (3)     | 0            | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,940           | 02/07/2026        | 1 500                            | (4)     | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,070           | 02/07/2026        | 1 500                            | (9)     | (6)          | (0,02)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,070           | 02/07/2026        | 1 500                            | (9)     | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,200           | 02/07/2026        | 1 500                            | (4)     | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (50) | \$ (24)      | (0,06)              |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                              | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer            | Indice Brazil Stock Exchange Index | 32                           | 0,000 %       | BRL 5 558         | 12/08/2026      | \$ 0                   | \$ (7)                            | \$ (7)       | (0,02)              |
|              | À recevoir         | Indice SET 50 Index                | 8 400                        | 0,000         | THB 8 528         | 29/09/2026      | 0                      | 8                                 | 8            | 0,02                |
| JPM          | À recevoir         | Indice JPQIPRL7 Index              | 258 781                      | 3,724         | \$ 26 067         | 07/04/2027      | 0                      | (184)                             | (184)        | (0,48)              |
|              | À payer            | Indice JPQIPRS7 Index              | 220 150                      | 3,922         | 22 742            | 07/04/2027      | 0                      | 8                                 | 8            | 0,02                |
| MEI          | À recevoir         | Indice KOSPI2 Index                | 250 000                      | 0,000         | KRW 381 114       | 10/09/2026      | 0                      | (23)                              | (23)         | (0,06)              |
|              |                    |                                    |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (198)                          | \$ (198)     | (0,52)              |

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer            | Apple, Inc.  | 1 968                        | 4,520 %       | \$ 573            | 10/07/2026      | \$ 0                   | \$ 5                             | \$ 5         | 0,01                |
|              | À payer            | Nvidia Corp. | 2 801                        | 4,520         | 575               | 10/07/2026      | 0                      | 15                               | 15           | 0,04                |
|              |                    |              |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ 20                            | \$ 20        | 0,05                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 48                | \$ 34              | \$ 1                  | \$ 0                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 77                | 45                 | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 46                | 36                 | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 18 643            | 570                | 8                     | 0                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 20                | CAD 28             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 116               | NZD 205            | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 28                | \$ 20              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 205               | 116                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | KRW             | 443 316           | 293                | 6                     | 6                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | BRL             | 6 824             | 1 313              | 0                     | (5)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | COP             | 567 511           | 164                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 87                | 116                | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 180 561           | 10                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 4 800             | 51                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 65 184            | 43                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN             | 246               | 73                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 107               | 28                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 398               | CLP 367 120        | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 74                | COP 270 319        | 5                     | 5                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 37                | € 32               | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           |                 | 100               | INR 9 461          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 37                | ¥ 5 831            | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 30                | KRW 45 952         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 36                | NOK 334            | 0                     | (2)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 892               | TWD 28 210         | 0                     | (7)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | CAD             | 92                | \$ 65              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 313             | BRL 6 877          | 5                     | 5                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           |                 | 17                | HKD 137            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 61                | ILS 181            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP             | 367 120           | \$ 398             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 181 928           | 1 912              | 3                     | 3                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | NOK             | 1 427             | 150                | 6                     | 6                                      | 0,02                |
|              | 09/2026           | NZD             | 420               | 238                | 0                     | (2)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | PHP             | 10 385            | 168                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | SGD             | 330               | 259                | 2                     | 2                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 261               | COP 928 902        | 4                     | 4                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 320               | INR 30 440         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 27                | MXN 480            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 2 214             | \$ 430             | 2                     | 2                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 97                | 70                 | 2                     | 2                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CLP             | 8 965             | 10                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 503             | 222                | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 610 521           | 170                | 0                     | (7)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | CZK             | 276               | 13                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 256               | 339                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 715 211           | 40                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 14 438            | 153                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 598 403           | 392                | 5                     | 5                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | PEN             | 157               | 46                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PHP             | 617               | 10                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 136               | 105                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 1 957             | 60                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD             | 3 348             | 106                | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 316               | BRL 1 632          | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 115               | COP 415 126        | 6                     | 6                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 46                | HUF 14 027         | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 620             | IDR 28 997 813     | 1                     | (7)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 200               | INR 19 236         | 3                     | 3                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 559               | ¥ 90 078           | 0                     | (5)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 180               | KRW 273 945        | 0                     | (3)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 46                | PEN 157            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 500               | PHP 30 390         | 0                     | (5)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 89                | ZAR 1 459          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 104 814           | \$ 30              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 3 720             | 1 268              | 18                    | 18                                     | 0,05                |
|              | 09/2026           | AUD             | 1 106             | 760                | 0                     | (5)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | CAD             | 609               | 430                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | CHF             | 766               | 970                | 13                    | 12                                     | 0,03                |
|              | 09/2026           | CLP             | 285 107           | 309                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 2 458 313         | 701                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | CZK             | 8 332             | 390                | 0                     | (3)                                    | (0,01)              |

# Tableau des investissements Fonds MAARS Multi-Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 09/2026           | €               | \$                | 375                | 430                   | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | £               |                   | 1 425              | 1 886                 | 0                                       | (0,01)              |
|              | 09/2026           | HUF             |                   | 106 373            | 338                   | 0                                       | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 738 042            | 41                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ¥               |                   | 262 577            | 1 640                 | 14                                      | 0,04                |
|              | 09/2026           | NOK             |                   | 8 745              | 890                   | 8                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | NZD             |                   | 1 580              | 901                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | SEK             |                   | 8 542              | 880                   | 0                                       | (0,02)              |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 39 769             | 1 222                 | 17                                      | 0,04                |
|              | 09/2026           | \$              | COP               | 139                | 486 866               | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | HUF               | 87                 | 26 836                | 0                                       | (1)                 |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 6                  | 106 436               | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | NOK               | 169                | 1 600                 | 0                                       | (8)                 |
|              | 09/2026           |                 | SEK               | 118                | 1 100                 | 0                                       | (4)                 |
|              | 09/2026           | ZAR             | \$                | 6 245              | 377                   | 0                                       | (2)                 |
|              | 12/2026           | \$              | IDR               | 41                 | 743 062               | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | CNH             | \$                | 1 214              | 180                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             |                   | 291                | 101                   | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | MYR             |                   | 3 140              | 769                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             |                   | 111                | 66                    | 2                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             |                   | 2 661              | 2 069                 | 11                                      | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$              | IDR               | 10                 | 180 545               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | NOK               | 127                | 1 205                 | 0                                       | (5)                 |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 91                 | 342                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | TRY               | 1 690              | 80 173                | 14                                      | 0,04                |
|              | 07/2026           |                 | ZAR               | 179                | 2 905                 | 0                                       | (2)                 |
|              | 09/2026           | CZK             | \$                | 3 676              | 172                   | 0                                       | (1)                 |
|              | 09/2026           | HUF             |                   | 249 811            | 800                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 181 513            | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ¥               |                   | 69 944             | 440                   | 7                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | MYR             |                   | 869                | 211                   | 0                                       | (2)                 |
|              | 09/2026           | THB             |                   | 6 710              | 205                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | CHF               | 1 500              | 1 201                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | COP               | 52                 | 182 586               | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | €                 | 573                | 500                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | IDR               | 4                  | 76 833                | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 09/2026           |                 | MYR               | 100                | 406                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | BRL               | 45                 | 232                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | ¥                 | 173                | 27 439                | 0                                       | (4)                 |
|              | 07/2026           |                 | NZD               | 201                | 356                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | \$                | 356                | 201                   | 0                                       | (1)                 |
|              | 09/2026           | €               |                   | 300                | 342                   | 0                                       | (3)                 |
|              | 09/2026           | \$              | BRL               | 1 476              | 7 572                 | 0                                       | (36)                |
|              | 09/2026           |                 | COP               | 548                | 2 002 376             | 24                                      | 0,06                |
| CBK          | 12/2026           |                 | CLP               | 246                | 221 930               | 0                                       | (5)                 |
|              | 07/2026           | CAD             | \$                | 280                | 200                   | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             |                   | 176                | 26                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             |                   | 828 402            | 239                   | 1                                       | (1)                 |
|              | 07/2026           | CZK             |                   | 6 331              | 304                   | 6                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | £               |                   | 81                 | 109                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             |                   | 231 354            | 152                   | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | PEN             |                   | 1 562              | 459                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             |                   | 3 188              | 343                   | 14                                      | 0,04                |
|              | 07/2026           | TWD             |                   | 1 199              | 38                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | BRL               | 861                | 4 426                 | 0                                       | (6)                 |
|              | 07/2026           |                 | COP               | 380                | 1 320 989             | 3                                       | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | €                 | 27                 | 23                    | 0                                       | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | £                 | 36                 | 27                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | HUF               | 1 054              | 322 337               | 0                                       | (20)                |
|              | 07/2026           |                 | KRW               | 98                 | 149 749               | 0                                       | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | NOK               | 70                 | 680                   | 0                                       | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | PEN               | 300                | 1 027                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | PLN               | 40                 | 145                   | 0                                       | (1)                 |
|              | 07/2026           |                 | SEK               | 46                 | 425                   | 0                                       | (2)                 |
|              | 07/2026           |                 | TWD               | 124                | 3 929                 | 0                                       | (1)                 |
|              | 08/2026           | CLP             | \$                | 64 411             | 70                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             |                   | 33 437             | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             |                   | 834                | 287                   | 7                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | PEN             |                   | 2 055              | 600                   | 0                                       | (2)                 |
|              | 08/2026           | \$              | ILS               | 124                | 363                   | 0                                       | (2)                 |
|              | 09/2026           | CLP             | \$                | 334 716            | 365                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             |                   | 2 144 924          | 596                   | 1                                       | (17)                |
|              | 09/2026           | IDR             |                   | 8 837 860          | 492                   | 2                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | MXN             |                   | 2 069              | 118                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             |                   | 2 855              | 841                   | 6                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | PHP             |                   | 619                | 10                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | COP               | 676                | 2 365 958             | 0                                       | (2)                 |
|              | 09/2026           |                 | INR               | 60                 | 5 801                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | PEN               | 1 172              | 4 020                 | 3                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | PHP               | 917                | 56 508                | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | ZAR               | 110                | 1 836                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | IDR               | 175                | 3 182 779             | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir |            | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | CNH             | 1 509     | \$                | 223        | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 299       |                   | 14         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 11        |                   | 4          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 86        |                   | 67         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 108       | IDR               | 1 932 471  | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 89        | NOK               | 830        | 0                  | (5)                   | (5)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 42        | PLN               | 156        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 63        | ZAR               | 1 013      | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | HUF             | 28 464    | \$                | 90         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 1 479     |                   | 45         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 156       | COP               | 568 568    | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           |                 | 636       | IDR               | 11 437 023 | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 135       | ILS               | 399        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 75        | INR               | 7 103      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 176       | PEN               | 601        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 32        | SEK               | 300        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 246       | \$                | 309        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 495     |                   | 221        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 437       |                   | 588        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | ¥               | 257 203   |                   | 1 590      | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,02                |
| FAR          | 07/2026           | KRW             | 227 341   |                   | 150        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 2 674     |                   | 2 096      | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,07                |
|              | 07/2026           | THB             | 6 923     |                   | 210        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 77        | BRL               | 396        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 634     | CNH               | 11 111     | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 4         | ¥                 | 637        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 115       | PLN               | 425        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 390       | SEK               | 3 784      | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 161       | ZAR               | 2 657      | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 11 087    | \$                | 1 634      | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | SEK             | 3 777     |                   | 390        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 590     | ¥                 | 256 530    | 0                  | (7)                   | (7)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | CHF             | 213       | \$                | 270        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | COP             | 1 193 922 |                   | 342        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 499       |                   | 5          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MYR             | 1 110     |                   | 273        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 540       |                   | 159        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 400       | ILS               | 1 191      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 40        | MXN               | 688        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 242     | PEN               | 4 245      | 3                  | (4)                   | (1)                                     | 0,00                |
| GLM          | 09/2026           |                 | 253       | PHP               | 15 411     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 1 200     | THB               | 39 945     | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,03                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 153     | \$                | 222        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CLP             | 8 952     |                   | 10         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR             | 3 763     |                   | 927        | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | PEN             | 287       |                   | 84         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 69        | BRL               | 356        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 922     | CAD               | 2 736      | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 197       | CLP               | 181 703    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 99        | CNH               | 671        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19        | IDR               | 342 696    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19        | MYR               | 79         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 84        | PEN               | 287        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10        | PHP               | 617        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 63        | PLN               | 233        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 110     | TWD               | 35 117     | 0                  | (10)                  | (10)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 67        | ZAR               | 1 114      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL             | 253       | \$                | 49         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 2 732     |                   | 1 922      | 0                  | (6)                   | (6)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | BRL             | 6 338     |                   | 1 200      | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
| IND          | 09/2026           | CLP             | 296 654   |                   | 326        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | IDR             | 344 703   |                   | 19         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 363       |                   | 4          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 107     |                   | 64         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PHP             | 619       |                   | 10         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 15 829    |                   | 488        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | \$              | 222       | BRL               | 1 170      | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 127       | CHF               | 100        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 225       | CLP               | 200 335    | 0                  | (8)                   | (8)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | 1 326     | COP               | 4 731 286  | 26                 | (3)                   | 23                                      | 0,06                |
|              | 09/2026           |                 | 107       | IDR               | 1 910 964  | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 261       | INR               | 24 810     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 110       | MYR               | 446        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 217       | PEN               | 739        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 20        | PHP               | 1 200      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 2 000     | SGD               | 2 578      | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,01                |
|              | 12/2026           |                 | 278       | COP               | 1 082 848  | 25                 | 0                     | 25                                      | 0,06                |
|              | 07/2026           |                 | 1 789     | TWD               | 56 484     | 0                  | (18)                  | (18)                                    | (0,05)              |
|              | 09/2026           | CLP             | 678 432   | \$                | 759        | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,06                |
|              | 09/2026           | \$              | 173       | IDR               | 3 088 578  | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 66        | INR               | 6 256      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds MAARS Multi-Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 206               | \$ 147             | \$ 4                  | \$ 0                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 202             | 859                | 11                    | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | CHF             | 178               | 224                | 4                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CLP             | 181 703           | 200                | 3                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 320             | 490                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK             | 9 214             | 436                | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS             | 2 612             | 900                | 24                    | 0                                       | 0,06                |
|              | 07/2026           | INR             | 14 452            | 153                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 6 382             | 645                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PHP             | 1 227             | 20                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 375               | 39                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 2 997             | 90                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 432               | BRL 2 239          | 1                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 57                | CZK 1 180          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 102               | € 89               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 36                | £ 27               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 607               | HUF 185 200        | 0                     | (14)                                    | (0,03)              |
|              | 07/2026           |                 | 153               | INR 14 452         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 39                | THB 1 305          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 381               | TWD 12 072         | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 65                | HKD 507            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 152               | ILS 447            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 645               | NOK 6 384          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CHF             | 393               | \$ 500             | 8                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | IDR             | 8 340 347         | 455                | 0                     | (7)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | THB             | 8 884             | 271                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | TRY             | 39 737            | 800                | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | \$              | 74                | CLP 68 144         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3 015             | INR 287 965        | 7                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           |                 | 180               | ¥ 28 700           | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 220               | MXN 3 823          | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 316               | PEN 1 080          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 100               | PHP 6 040          | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 100               | THB 3 238          | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 12/2026           | MXN             | 5 008             | \$ 284             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 134               | 95                 | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 338               | 242                | 4                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 811             | 2 291              | 47                    | 0                                       | 0,12                |
|              | 07/2026           | CZK             | 6 322             | 303                | 5                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | DKK             | 85                | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 473               | 546                | 5                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ILS             | 127               | 45                 | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 593 471           | 392                | 8                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 058             | 207                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 89                | 52                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 90                | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 449             | 1 130              | 9                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 101               | AUD 147            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 40                | CHF 31             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 15                | € 13               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 227               | HUF 69 313         | 0                     | (4)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 92                | IDR 1 648 421      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 195               | ¥ 31 022           | 0                     | (4)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 501               | NOK 4 722          | 0                     | (25)                                    | (0,06)              |
|              | 07/2026           |                 | 237               | SEK 2 311          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 147               | \$ 101             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 540               | 181                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK             | 2 307             | 237                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 13                | DKK 85             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 207               | NOK 2 059          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PLN             | 2 558             | \$ 690             | 12                    | (2)                                     | 0,02                |
|              | 09/2026           | SEK             | 2 354             | 250                | 6                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | THB             | 2 065             | 63                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 116               | € 100              | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 245               | HUF 74 218         | 0                     | (7)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | 350               | ILS 1 022          | 0                     | (6)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | 100               | SGD 127            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 180               | ZAR 2 973          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | £               | 99                | \$ 133             | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 87                | 30                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 280               | 30                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 104               | 60                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 85                | AUD 121            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17                | DKK 110            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 226               | ¥ 36 100           | 0                     | (4)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 107               | NOK 1 020          | 0                     | (4)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | NOK             | 695               | \$ 70              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 67                | CHF 54             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 157               | ¥ 25 400           | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | AUD             | 450               | \$ 310             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | CAD             | 439               | 310                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CHF             | 249               | 310                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| NSL          | 09/2026           | €               | 271               | \$ 310             | \$ 0                  | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | £               | 235               | 310                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | ¥               | 49 825            | 310                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | NOK             | 3 081             | 310                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | NZD             | 548               | 310                | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | SEK             | 4 592             | 480                | 6                     | (2)                                     | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 25                | MXN 443            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 165               | ZAR 2 687          | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 18                | IDR 317 213        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 655               | TRY 30 805         | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| RBC          | 09/2026           | IDR             | 318 992           | \$ 18              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 14                | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL          | 07/2026           |                 | 12                | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 16                | 20                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | CLP             | 367 120           | 410                | 12                    | 0                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | NZD             | 141               | 82                 | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SEK             | 3 130             | 333                | 10                    | 0                                       | 0,03                |
|              | 09/2026           | \$              | 339               | COP 1 206 742      | 5                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 927               | \$ 661             | 7                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH             | 124               | 18                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 581               | 665                | 2                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 39                | 23                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 93                | ¥ 14 800           | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 61                | HKD 479            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 08/2026           |                 | 380               | PEN 1 304          | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | AUD             | 200               | \$ 140             | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | CAD             | 1 118             | 800                | 10                    | 0                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | CZK             | 2 194             | 105                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | €               | 700               | 813                | 10                    | 0                                       | 0,03                |
|              | 09/2026           | SGD             | 509               | 398                | 3                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 200             | CAD 1 697          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 282               | IDR 5 100 279      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 240               | SEK 2 239          | 0                     | (8)                                     | (0,02)              |
|              | 12/2026           | CLP             | 26 327            | \$ 29              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 27                | 20                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 88                | 110                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 2 441             | 361                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 678               | 791                | 16                    | 0                                       | 0,04                |
|              | 07/2026           | PEN             | 444               | 131                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 72                | 56                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 82                | AUD 119            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 256             | € 1 104            | 6                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 59                | HUF 18 319         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 490             | INR 141 316        | 6                     | (5)                                     | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           |                 | 323               | ¥ 51 329           | 0                     | (7)                                     | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 130               | PEN 444            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5 501             | SGD 7 124          | 7                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 08/2026           | AUD             | 119               | \$ 82              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 1 104             | 1 258              | 0                     | (6)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 7 108             | 5 501              | 0                     | (7)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | BRL             | 1 268             | 240                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | CHF             | 137               | 170                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 336 342           | 91                 | 0                     | (5)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | ILS             | 534               | 179                | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
| UAG          | 09/2026           | KRW             | 130 429           | 86                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 5 684             | 174                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 268               | CNH 1 801          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 134               | £ 100              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 197               | ¥ 31 400           | 0                     | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 100               | KRW 150 520        | 0                     | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 76                | MXN 1 317          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 194               | PEN 660            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 132 778           | \$ 87              | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 179               | BRL 909            | 0                     | (3)                                     | (0,01)              |
| UAG          | 07/2026           |                 | 18                | CAD 25             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 198             | £ 906              | 5                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 496               | TWD 15 676         | 0                     | (4)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CAD             | 25                | \$ 18              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 471               | 538                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 906               | 1 198              | 0                     | (5)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | CAD             | 1 126             | 810                | 14                    | 0                                       | 0,04                |
|              | 09/2026           | CLP             | 165 031           | 183                | 4                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | INR             | 18 720            | 197                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ¥               | 17 508            | 110                | 2                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 09/2026           | TWD             | 60 099            | 1 885              | 4                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 56                | BRL 289            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 428               | COP 1 505 929      | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 32                | IDR 576 196        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 350               | INR 33 591         | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 09/2026           |                 | 24                | PHP 1 435          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 167               | \$ 118             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 294               | 370                | 6                     | 0                                       | 0,01                |

## Tableau des investissements Fonds MAARS Multi-Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| WST          | 07/2026           | \$ 43           | PLN 156           | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 2 011 987   | \$ 566            | 0                  | (8)                   | (8)                                     | (0,02)              |
|              | 09/2026           | THB 20 299      | 625               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,03                |
|              | 09/2026           | \$ 366          | COP 1 358 590     | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,05                |
|              | 07/2026           | 3 220           | CHF 2 599         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | CHF 2 590       | \$ 3 220          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 835             | \$ (501)              | \$ 334                                  | 0,87                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       |                                         |                     |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Z en AUD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 66          | \$ 45             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 81           | AUD 113           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 45              | 66                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | 2               | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2               | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | AUD 66          | \$ 46             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | \$ 63           | AUD 89            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 46              | 66                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2               | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 9               | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 64          | \$ 45             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | \$ 83           | AUD 116           | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 45              | 64                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 109         | \$ 76             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | \$ 76           | AUD 109           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 63          | \$ 43             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 0            | AUD 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | 43              | 63                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19              | 27                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1               | \$ (8)                | \$ (7)                                  | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$ 3            | CHF 2             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 80              | 63                | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 83              | 65                | 0                  | (3)                   | (3)                                     | (0,01)              |
| JPM          | 07/2026           | CHF 2           | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 92           | CHF 72            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | CHF 74          | \$ 92             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 92           | CHF 74            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | 26              | 20                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | CHF 74          | \$ 92             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 92           | CHF 74            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 0               | \$ (9)                | \$ (9)                                  | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 2            | € 2               | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 84              | 72                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
| BSH          | 07/2026           | 79              | 68                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 88              | 100               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 08/2026           | \$ 101          | € 88              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 92            | \$ 104            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 67           | € 58              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           | 104             | 92                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 92            | \$ 104            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 84           | € 72              | 0                  | (2)                   | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 105             | 92                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2               | \$ (7)                | \$ (5)                                  | (0,02)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$ 77           | £ 57              | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | £ 70            | \$ 93             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 88           | £ 66              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 93              | 70                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | £ 9             | \$ 11             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 4            | £ 3               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 11              | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           | 84              | 62                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £ 18            | \$ 23             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 23           | £ 18              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | £ 82            | \$ 108            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 2            | £ 2               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 108             | 82                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | £ 85            | \$ 112            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 83           | £ 62              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | 112             | 85                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SSB                                                | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 1            | £ 1               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG                                                | 07/2026           | 34              | 26                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 2               | \$ (6)                | \$ (4)                                  | (0,01)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 734                                  | 1,92                |

#### TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                               |                            |                     |
| 5,500 % éch. 01/06/2040 (e)                                    | \$ 100                        | \$(101)                    | (0,26)              |
| 5,500 % éch. 01/07/2056                                        | 200                           | (201)                      | (0,53)              |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                        | 600                           | (602)                      | (1,57)              |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 5,000 % éch. 01/07/2041                                        | 100                           | (100)                      | (0,26)              |
| 5,500 % éch. 01/07/2056                                        | 1 700                         | (1 706)                    | (4,45)              |
| 5,500 % éch. 01/09/2056                                        | 1 800                         | (1 802)                    | (4,71)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | \$ (4 512)                 | (11,78)             |
| Total des Investissements                                      |                               | \$ 31 645                  | 82,62               |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | \$ 6 657                   | 17,38               |
| Actif net                                                      |                               | \$ 38 302                  | 100,00              |

#### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre vendu avant l'émission.  
 (b) Titre à coupon zéro.  
 (c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.  
 (d) Affilié au Fonds.  
 (e) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

Un montant en numéraire de 2 503 \$ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 1 130                                                                          | \$ 14 783                                            | \$ 2 733                                          | \$ 18 646    |
| Fonds d'investissement                        | 3 700                                                                             | 0                                                    | 0                                                 | 3 700        |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 13 400                                               | 0                                                 | 13 400       |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 45                                                                                | 366                                                  | 0                                                 | 411          |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (4 512)                                              | 0                                                 | (4 512)      |
| Totaux                                        | \$ 4 875                                                                          | \$ 24 037                                            | \$ 2 733                                          | \$ 31 645    |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

## Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026<sup>(1)</sup> :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(2)</sup> |
| AZD          | \$ 15                                                      | \$ 0                    | \$ 15                             |
| BOA          | 440                                                        | 0                       | 440                               |
| BPS          | 20                                                         | 0                       | 20                                |
| BRC          | 248                                                        | 0                       | 248                               |
| BSH          | (27)                                                       | 0                       | (27)                              |
| CBK          | (21)                                                       | 0                       | (21)                              |
| DUB          | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| FAR          | 53                                                         | 0                       | 53                                |
| GLM          | 35                                                         | 0                       | 35                                |
| IND          | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| JPM          | (149)                                                      | 0                       | (149)                             |
| MBC          | 47                                                         | 0                       | 47                                |
| MEI          | (23)                                                       | 0                       | (23)                              |
| MYI          | (9)                                                        | 0                       | (9)                               |
| NSL          | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| RYL          | 29                                                         | 0                       | 29                                |
| SCX          | 29                                                         | 0                       | 29                                |
| SOG          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               |
| SSB          | 20                                                         | 0                       | 20                                |
| UAG          | 28                                                         | 0                       | 28                                |

<sup>(1)</sup> Le Fonds MAARS Multi-Strategy Fund a été lancé le 12 mai 2026.

<sup>(2)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026<sup>(1)</sup> en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 22,79            |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 10,24            |
| Fonds d'investissement                                           | 6,55             |
| Contrats de mise en pension                                      | 23,74            |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,18             |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,76             |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 2,66             |
| Autres actifs                                                    | 33,08            |
| Total des actifs                                                 | 100,00           |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

<sup>(1)</sup> Le Fonds MAARS Multi-Strategy Fund a été lancé le 12 mai 2026.

## 30 juin 2026

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                           | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-valeur) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|---------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À recevoir         | Energy Transfer LP              | 508 918                      | 4,220 %       | \$ 9 756          | 14/10/2026      | \$ 0                   | \$ (60)                           | \$ (60)      | (0,03)              |
|              | À recevoir         | Energy Transfer LP              | 179 849                      | 4,220         | 3 448             | 06/01/2027      | 0                      | (21)                              | (21)         | (0,01)              |
|              | À recevoir         | Enterprise Products Partners LP | 234 141                      | 4,220         | 8 614             | 06/01/2027      | 0                      | (37)                              | (37)         | (0,02)              |
|              | À recevoir         | Western Midstream Partners LP   | 44 285                       | 4,220         | 1 898             | 06/01/2027      | 0                      | 33                                | 33           | 0,01                |
| CBK          | À recevoir         | Energy Transfer LP              | 91 032                       | 4,220         | 1 745             | 14/10/2026      | 0                      | (11)                              | (11)         | 0,00                |
| GST          | À recevoir         | Sunoco LP                       | 283 660                      | 4,220         | 18 379            | 19/08/2026      | 0                      | 705                               | 705          | 0,30                |
|              | À recevoir         | MPLX LP                         | 344 953                      | 4,220         | 18 852            | 04/11/2026      | 0                      | 513                               | 513          | 0,22                |
| MYI          | À recevoir         | Enterprise Products Partners LP | 216 932                      | 3,770         | 7 981             | 14/10/2026      | 0                      | (32)                              | (32)         | (0,01)              |
|              | À recevoir         | Western Midstream Partners LP   | 322 120                      | 4,220         | 13 809            | 14/10/2026      | 0                      | 238                               | 238          | 0,10                |
|              | À recevoir         | Plains All American Pipeline LP | 463 424                      | 4,220         | 10 395            | 06/01/2027      | 0                      | (114)                             | (114)        | (0,05)              |
|              | À recevoir         | Energy Transfer LP              | 338 484                      | 4,220         | 6 452             | 17/02/2027      | 0                      | 20                                | 20           | 0,01                |
|              | À recevoir         | Genesis Energy LP               | 326 379                      | 4,220         | 4 589             | 17/02/2027      | 0                      | 35                                | 35           | 0,02                |
|              | À recevoir         | Enterprise Products Partners LP | 18 804                       | 4,220         | 692               | 20/05/2027      | 0                      | (3)                               | (3)          | 0,00                |
|              |                    |                                 |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ 1 266                          | \$ 1 266     | 0,54                |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (suite)

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |        | Devise à recevoir |        | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|--------|-------------------|--------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 140    | CAD               | 199    | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 199    | \$                | 140    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | \$              | 13 469 | CAD               | 19 166 | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,02                |
|              | 08/2026           | CAD             | 19 139 | \$                | 13 469 | 0                  | (41)                  | (41)                                    | (0,02)              |
| MBC          | 07/2026           | \$              | 696    | CAD               | 963    | 0                  | (17)                  | (17)                                    | (0,01)              |
| MYI          | 07/2026           | £               | 2      | \$                | 3      | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | €               | 125    |                   | 146    | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 142    | €                 | 125    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 125    | \$                | 142    | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 20 664 |                   | 14 986 | 421                | 0                     | 421                                     | 0,18                |
|              | 07/2026           | \$              | 124    | CAD               | 175    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 175    | \$                | 124    | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |        |                   |        | \$ 465             | \$ (59)               | \$ 406                                  | 0,17                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et Institutions en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| BOA          | 07/2026           | €               | 495               | \$                 | 577                   | \$ 10                                   | 0,01                |        |
| BPS          | 07/2026           | \$              | 39 941            | €                  | 34 296                | 3                                       | (0,31)              |        |
| CBK          | 07/2026           | €               | 4 476             | \$                 | 5 219                 | 101                                     | 0,04                |        |
| FAR          | 07/2026           |                 | 31 259            |                    | 35 651                | 0                                       | (0,04)              |        |
|              | 08/2026           | \$              | 35 699            | €                  | 31 259                | 87                                      | 0,04                |        |
| MBC          | 07/2026           | €               | 32 980            | \$                 | 37 475                | 5                                       | (0,10)              |        |
|              | 07/2026           | \$              | 2 705             | €                  | 2 331                 | 0                                       | (0,02)              |        |
|              | 08/2026           |                 | 36 054            |                    | 31 699                | 238                                     | 0,10                |        |
| SCX          | 07/2026           |                 | 35 234            |                    | 30 285                | 0                                       | (0,26)              |        |
| SOG          | 07/2026           | €               | 31 489            | \$                 | 35 819                | 0                                       | (0,08)              |        |
|              | 07/2026           | \$              | 39 416            | €                  | 33 789                | 0                                       | (0,33)              |        |
|              | 08/2026           |                 | 35 868            |                    | 31 489                | 183                                     | 0,08                |        |
|              |                   |                 |                   | \$                 | 627                   | \$ (2 677)                              | \$ (2 050)          | (0,87) |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |       | Devise à recevoir |       | Plus-value latente |    | (Moins-value) latente |      | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------|-------------------|-------|--------------------|----|-----------------------|------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | \$              | 1 267 | £                 | 943   | \$                 | 0  | \$                    | (14) | \$                                      | (14)                | (0,01) |
| BOA          | 07/2026           |                 | 16    |                   | 12    |                    | 0  |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
| BPS          | 07/2026           | £               | 948   | \$                | 1 253 |                    | 1  |                       | (7)  |                                         | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 549 | £                 | 1 157 |                    | 0  |                       | (14) |                                         | (14)                | (0,01) |
|              | 08/2026           |                 | 1 136 |                   | 862   |                    | 7  |                       | 0    |                                         | 7                   | 0,01   |
| BRC          | 07/2026           | £               | 41    | \$                | 55    |                    | 0  |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
| FAR          | 07/2026           | \$              | 69    | £                 | 51    |                    | 0  |                       | (1)  |                                         | (1)                 | 0,00   |
| JPM          | 07/2026           |                 | 1 481 |                   | 1 104 |                    | 0  |                       | (16) |                                         | (16)                | (0,01) |
| MBC          | 07/2026           | £               | 56    | \$                | 75    |                    | 1  |                       | 0    |                                         | 1                   | 0,00   |
| NSL          | 07/2026           |                 | 214   |                   | 282   |                    | 0  |                       | (2)  |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 282   | £                 | 214   |                    | 2  |                       | 0    |                                         | 2                   | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           | £               | 991   | \$                | 1 312 |                    | 0  |                       | (4)  |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 310 | £                 | 989   |                    | 4  |                       | 0    |                                         | 4                   | 0,00   |
| SOG          | 07/2026           | £               | 977   | \$                | 1 291 |                    | 0  |                       | (6)  |                                         | (6)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 291 | £                 | 977   |                    | 6  |                       | 0    |                                         | 6                   | 0,00   |
| SSB          | 07/2026           | £               | 39    | \$                | 51    |                    | 0  |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 51    | £                 | 39    |                    | 0  |                       | 0    |                                         | 0                   | 0,00   |
|              |                   |                 |       |                   |       | \$                 | 21 | \$                    | (64) | \$                                      | (43)                | (0,02) |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (567) (0,24)

Total des Investissements

\$ 229 743 97,92

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 4 873 2,08

Actif net

\$ 234 616 100,00

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Affilié au Fonds.



(e) Des titres d'une juste valeur globale de 813 \$ (31 décembre 2025 : 1 117 \$) et un montant en numéraire de 2 850 \$ (31 décembre 2025 : 440 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 84 643                                                                         | \$ 122 513                                           | \$ 0                                              | \$ 207 156        |
| Fonds d'investissement                        | 23 154                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 23 154            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | (567)                                                | 0                                                 | (567)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 107 797</b>                                                                 | <b>\$ 121 946</b>                                    | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 229 743</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 54 145                                                                         | \$ 98 294                                            | \$ 0                                              | \$ 152 439        |
| Fonds d'investissement                        | 16 610                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 16 610            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 432                                                  | 0                                                 | 432               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 70 755</b>                                                                  | <b>\$ 98 726</b>                                     | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 169 481</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (14)                                                    | \$ 0                    | \$ (14)                           | \$ 29                                                      | \$ 0                    | \$ 29                             |
| BOA          | (75)                                                       | 52                      | (23)                              | (88)                                                       | 394                     | 306                               |
| BPS          | (744)                                                      | 920                     | 176                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| CBK          | 90                                                         | 0                       | 90                                | 314                                                        | (370)                   | (56)                              |
| FAR          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | 12                                                         | 0                       | 12                                |
| GLM          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| GST          | 1 218                                                      | (1 490)                 | (272)                             | (90)                                                       | 723                     | 633                               |
| JPM          | (162)                                                      | 260                     | 98                                | (99)                                                       | 440                     | 341                               |
| MBC          | (49)                                                       | 0                       | (49)                              | 14                                                         | 0                       | 14                                |
| MYI          | 144                                                        | 720                     | 864                               | (92)                                                       | (40)                    | (132)                             |
| SCX          | (610)                                                      | 761                     | 151                               | 9                                                          | 0                       | 9                                 |
| SOG          | (783)                                                      | 950                     | 167                               | 418                                                        | (300)                   | 118                               |
| SSB          | 421                                                        | (270)                   | 151                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|--------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 56,88            | 77,04                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 29,43            | 1,68                 |
| Fonds d'investissement                                       | 9,65             | 8,58                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                     | 1,11             | 0,58                 |
| Autres actifs                                                | 2,93             | 12,12                |
| <b>Total des actifs</b>                                      | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Bermudes                                 | S/O              | 0,22                 |
| Canada                                   | 7,86             | 7,55                 |
| États-Unis                               | 28,64            | 26,23                |
| Instruments à court terme                | 51,79            | 56,29                |
| Fonds d'investissement                   | 9,87             | 9,84                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote |                  |                      |
| Swaps de rendement total sur indices     | (0,06)           | (0,06)               |
| Swaps de rendement total sur titres      | 0,54             | (0,16)               |
| Contrats de change à terme               | 0,17             | (0,18)               |
| Contrats de change à terme couverts      | (0,89)           | 0,66                 |
| Autres actifs et passifs à court terme   | 2,08             | (0,39)               |
| Actif net                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES              |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |                             |                                     |                                  |                           |
| FPS Finance Co. LLC             |                                     |                                  |                           | 2,458 % éch. 25/11/2047 -                | \$ 21 519                           | \$ 2 452                         | 0,08                      | 4,890 % éch. 01/05/2032 (g) | \$ 5 925                            | \$ 5 988                         | 0,20                      |
| 6,590 % éch. 26/05/2028         | \$ 500                              | \$ 500                           | 0,02                      | 25/06/2048 (a)                           | 5 267                               | 484                              | 0,02                      | 4,890 % éch. 01/11/2034     | 1 176                               | 1 190                            | 0,04                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS   |                                     |                                  |                           | 2,472 % éch. 25/10/2054 (a)              |                                     |                                  |                           | 4,935 % éch. 01/11/2029 (g) | 7 140                               | 7 212                            | 0,25                      |
| BANQUE ET FINANCE               |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 25/12/2027 -                |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 01/03/2032     | 1 141                               | 1 156                            | 0,04                      |
| SLM Student Loan Trust          |                                     |                                  |                           | 25/10/2052 (a)                           | 131 925                             | 19 190                           | 0,65                      | 4,960 % éch. 01/03/2036     | 6 090                               | 6 153                            | 0,21                      |
| 2,951 % éch. 15/12/2033         | € 375                               | 406                              | 0,02                      | 2,508 % éch. 25/04/2043 (a)              | 1 138                               | 68                               | 0,00                      | 4,978 % éch. 25/01/2055     | 8 303                               | 8 391                            | 0,29                      |
| INDUSTRIE                       |                                     |                                  |                           | 2,524 % éch. 25/08/2033                  | 144                                 | 133                              | 0,00                      | 4,980 % éch. 01/12/2034     | 1 561                               | 1 595                            | 0,05                      |
| Beignet Investor LLC            |                                     |                                  |                           | 2,558 % éch. 25/05/2030 (a)              | 430                                 | 11                               | 0,00                      | 4,990 % éch. 01/03/2031 -   |                                     |                                  |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049         | \$ 22 230                           | 22 689                           | 0,77                      | 2,591 % éch. 25/08/2033                  | 43                                  | 41                               | 0,00                      | 01/12/2036                  | 17 308                              | 17 483                           | 0,60                      |
| Times Square Hotel Trust        |                                     |                                  |                           | 2,638 % éch. 25/12/2026                  | 549                                 | 544                              | 0,02                      | 5,000 % éch. 25/04/2034 -   |                                     |                                  |                           |
| 8,528 % éch. 01/08/2026         | 6                                   | 6                                | 0,00                      | 2,788 % éch. 25/01/2041 (a)              | 352                                 | 35                               | 0,00                      | 25/09/2053 (a)              | 62 170                              | 13 222                           | 0,45                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,858 % éch. 25/09/2040 -                |                                     |                                  |                           | 5,040 % éch. 01/05/2035 (g) | 2 420                               | 2 467                            | 0,08                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 25/09/2042 (a)                           | 1 401                               | 137                              | 0,00                      | 5,070 % éch. 01/03/2032 (g) | 2 666                               | 2 717                            | 0,09                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 25/11/2027 -                |                                     |                                  |                           | 5,078 % éch. 25/06/2054 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 25/10/2052 (a)                           | 213 990                             | 36 184                           | 1,23                      | 25/12/2054                  | 19 596                              | 19 857                           | 0,68                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/02/2057 -                |                                     |                                  |                           | 5,090 % éch. 01/01/2032     | 1 261                               | 1 289                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 01/07/2060 (g)                           | 16 485                              | 14 210                           | 0,48                      | 5,120 % éch. 01/05/2035 (g) | 2 900                               | 2 985                            | 0,10                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 01/05/2058                  | 2 533                               | 2 189                            | 0,07                      | 5,140 % éch. 01/02/2035 (g) | 1 902                               | 1 963                            | 0,07                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,058 % éch. 25/12/2032 (a)              | 230                                 | 21                               | 0,00                      | 5,150 % éch. 01/05/2035 (g) | 3 250                               | 3 357                            | 0,11                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,140 % éch. 01/07/2029                  | 1 006                               | 970                              | 0,03                      | 5,164 % éch. 01/09/2044     | 3 065                               | 3 080                            | 0,11                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,358 % éch. 25/10/2034 (a)              | 236                                 | 7                                | 0,00                      | 5,178 % éch. 25/06/2055     | 12 855                              | 13 076                           | 0,45                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,458 % éch. 25/10/2042 (a)              | 287                                 | 39                               | 0,00                      | 5,200 % éch. 01/10/2030 (g) | 1 973                               | 2 021                            | 0,07                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,472 % éch. 25/09/2054 (a)              | 11 681                              | 932                              | 0,03                      | 5,225 % éch. 01/03/2032 (g) | 1 905                               | 1 957                            | 0,07                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 25/02/2028 -                |                                     |                                  |                           | 5,240 % éch. 01/01/2034 (g) | 2 407                               | 2 485                            | 0,08                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 25/04/2053 (a)                           | 28 415                              | 4 557                            | 0,16                      | 5,270 % éch. 01/08/2032 (g) | 3 807                               | 3 920                            | 0,13                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,510 % éch. 01/03/2029                  | 1 041                               | 1 019                            | 0,03                      | 5,270 % éch. 01/09/2039     | 1 499                               | 1 555                            | 0,05                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,858 % éch. 25/11/2033 (a)              | 22                                  | 2                                | 0,00                      | 5,340 % éch. 01/01/2031     | 1 250                               | 1 290                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,870 % éch. 01/07/2027                  | 1 600                               | 1 581                            | 0,05                      | 5,350 % éch. 01/12/2029     | 1 171                               | 1 203                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 25/04/2032 - 25/06/2050 (a) | 14 002                              | 2 109                            | 0,07                      | 5,360 % éch. 01/08/2031 (g) | 3 500                               | 3 613                            | 0,12                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 25/05/2050                  | 2 253                               | 1 857                            | 0,06                      | 5,370 % éch. 01/06/2035     | 990                                 | 1 025                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,027 % éch. 25/05/2051 (a)              | 1 994                               | 293                              | 0,01                      | 5,380 % éch. 01/10/2031 (g) | 1 987                               | 2 057                            | 0,07                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,042 % éch. 25/09/2050                  | 1 323                               | 1 231                            | 0,04                      | 5,400 % éch. 01/08/2030 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,140 % éch. 01/04/2028                  | 669                                 | 666                              | 0,02                      | 01/05/2032                  | 2 161                               | 2 235                            | 0,08                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,214 % éch. 25/07/2046                  | 67                                  | 66                               | 0,00                      | 5,400 % éch. 01/11/2032 (g) | 1 850                               | 1 917                            | 0,07                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,270 % éch. 01/11/2032                  | 2 710                               | 2 666                            | 0,09                      | 5,410 % éch. 01/04/2029 (g) | 2 217                               | 2 265                            | 0,08                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,280 % éch. 01/11/2032                  | 2 140                               | 2 106                            | 0,07                      | 5,420 % éch. 01/02/2030 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,300 % éch. 01/05/2028                  | 720                                 | 717                              | 0,02                      | 01/06/2031                  | 2 756                               | 2 822                            | 0,10                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,300 % éch. 01/12/2032 (g)              | 46 900                              | 46 077                           | 1,57                      | 5,440 % éch. 01/10/2031     | 1 204                               | 1 247                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 01/12/2032                  | 1 000                               | 987                              | 0,03                      | 5,500 % éch. 25/06/2035 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,357 % éch. 01/02/2028 (g)              | 1 806                               | 1 801                            | 0,06                      | 25/05/2036 (a)              | 1 111                               | 183                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,390 % éch. 01/03/2031                  | 6 100                               | 6 052                            | 0,21                      | 5,510 % éch. 01/05/2035     | 1 715                               | 1 808                            | 0,06                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,420 % éch. 01/03/2029 (g)              | 9 280                               | 9 272                            | 0,32                      | 5,570 % éch. 01/01/2030 (g) | 3 577                               | 3 704                            | 0,13                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,428 % éch. 25/06/2055                  | 7 465                               | 7 443                            | 0,25                      | 5,620 % éch. 01/06/2041     | 427                                 | 439                              | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 25/12/2047                  | 304                                 | 304                              | 0,01                      | 5,650 % éch. 01/05/2038     | 690                                 | 725                              | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,430 % éch. 01/10/2030 - 01/02/2032     | 6 705                               | 6 683                            | 0,23                      | 5,750 % éch. 25/07/2035     | 329                                 | 337                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,449 % éch. 25/01/2051                  | 625                                 | 628                              | 0,02                      | 5,810 % éch. 01/06/2031     | 4 300                               | 4 403                            | 0,15                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,450 % éch. 01/01/2030 (g)              | 3 058                               | 3 051                            | 0,10                      | 5,890 % éch. 01/09/2046     | 647                                 | 686                              | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,480 % éch. 01/05/2030                  | 1 310                               | 1 310                            | 0,04                      | 6,000 % éch. 25/04/2032 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,490 % éch. 01/11/2029 (g)              | 6 390                               | 6 395                            | 0,22                      | 25/09/2054 (a)              | 8 523                               | 1 780                            | 0,06                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,490 % éch. 01/04/2033                  | 299                                 | 297                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/05/2035 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 25/06/2029 -                |                                     |                                  |                           | 25/11/2043                  | 5 299                               | 5 356                            | 0,18                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 25/09/2053 (a)                           | 20 714                              | 4 610                            | 0,16                      | 6,010 % éch. 01/08/2049     | 251                                 | 261                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/11/2032 - 01/04/2059     | 7 519                               | 7 353                            | 0,25                      | 6,140 % éch. 01/12/2048     | 182                                 | 189                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,580 % éch. 01/08/2033                  | 1 000                               | 1 002                            | 0,03                      | 6,500 % éch. 25/12/2034 (a) | 639                                 | 67                               | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,598 % éch. 25/08/2054                  | 230                                 | 231                              | 0,01                      | 7,500 % éch. 25/04/2042     | 86                                  | 83                               | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,610 % éch. 01/09/2029                  | 985                                 | 990                              | 0,03                      | Freddie Mac                 |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,620 % éch. 01/01/2032                  | 1 500                               | 1 505                            | 0,05                      | 0,000 % éch. 01/02/2035 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,628 % éch. 25/01/2054 - 25/07/2055     | 13 110                              | 13 158                           | 0,45                      | 15/08/2057 (b)(d)           | 4 988                               | 3 680                            | 0,13                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,678 % éch. 25/02/2055 - 25/12/2055     | 2 616                               | 2 626                            | 0,09                      | 0,000 % éch. 15/12/2043     | 947                                 | 644                              | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,680 % éch. 01/07/2030                  | 6 796                               | 6 811                            | 0,23                      | 0,228 % éch. 15/10/2032     | 30                                  | 24                               | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 01/08/2030 - 01/05/2035     | 5 774                               | 5 805                            | 0,20                      | 0,439 % éch. 15/05/2033 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,728 % éch. 25/11/2054 - 25/04/2056     | 41 292                              | 41 407                           | 1,41                      | 15/05/2043                  | 1 283                               | 1 074                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,740 % éch. 01/04/2030 (g)              | 5 500                               | 5 518                            | 0,19                      | 0,453 % éch. 15/09/2042     | 915                                 | 549                              | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 01/12/2030                  | 3 018                               | 3 042                            | 0,10                      | 0,793 % éch. 15/08/2040 (a) | 768                                 | 16                               | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,770 % éch. 01/05/2032 (g)              | 2 140                               | 2 154                            | 0,07                      | 0,951 % éch. 15/03/2043     | 4 670                               | 2 806                            | 0,10                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,778 % éch. 25/08/2055                  | 4 445                               | 4 493                            | 0,15                      | 1,212 % éch. 15/07/2043     | 11                                  | 7                                | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,815 % éch. 01/03/2031 (g)              | 2 710                               | 2 730                            | 0,09                      | 1,293 % éch. 15/04/2042 (a) | 1 104                               | 46                               | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,820 % éch. 01/09/2035                  | 3 925                               | 3 978                            | 0,14                      | 1,500 % éch. 15/03/2028     | 2 621                               | 2 572                            | 0,09                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,828 % éch. 25/12/2053 - 25/11/2055     | 48 26                               | 48 26                            | 1,64                      | 1,589 % éch. 15/03/2050 (a) | 2 592                               | 112                              | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          | 47 915                              | 2                                | 0,14                      | 1,672 % éch. 15/03/2050 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,830 % éch. 01/04/2032                  | 4 033                               | 4 071                            | 0,14                      | 25/09/2054 (a)              | 70 924                              | 3 335                            | 0,11                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,840 % éch. 01/08/2035                  | 500                                 | 507                              | 0,02                      | 1,685 % éch. 15/05/2041     | 361                                 | 278                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,860 % éch. 01/05/2035                  | 900                                 | 915                              | 0,03                      | 1,772 % éch. 25/11/2054 (a) | 9 821                               | 500                              | 0,02                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,870 % éch. 01/05/2035                  | 500                                 | 508                              | 0,02                      | 1,955 % éch. 15/01/2038 (a) | 102                                 | 5                                | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,878 % éch. 25/11/2052 - 25/02/2055     | 11 282                              | 11 309                           | 0,39                      | 2,000 % éch. 25/11/2050 -   |                                     |                                  |                           |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 25/06/2052 (a)              | 39 543                              | 4 650                            | 0,16                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 2,143 % éch. 15/02/2041 (a) | 178                                 | 11                               | 0,00                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 2,154 % éch. 15/02/2038 (a) | 14 308                              | 1 168                            | 0,04                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 2,161 % éch. 15/07/2042 (a) | 3 980                               | 403                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 2,179 % éch. 15/10/2040 (a) | 3 346                               | 281                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 2,181 % éch. 15/10/2040 (a) | 4 803                               | 394                              | 0,01                      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 2,183 % éch. 15/09/2043 (a) | 549                                 | 48                               | 0,00                      |

## Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 2.243 % éch. 15/07/2041 - 15/12/2041 (a) | \$ 1 740                            | \$ 141                           | 0,01                      | 5.000 % éch. 15/08/2035 - 25/08/2055 (a)    | \$ 91 238                           | \$20 220                         | 0,69                      | 4.559 % éch. 20/11/2055 - 20/09/2073                           | \$ 15 359                           | \$ 15 582                        | 0,53                      |
| 2.253 % éch. 15/08/2047 (a)              | 1 915                               | 201                              | 0,01                      | 5.000 % éch. 01/03/2049 (g)                 | 1 853                               | 1 863                            | 0,06                      | 4.569 % éch. 20/08/2073                                        | 8 002                               | 8 130                            | 0,28                      |
| 2.283 % éch. 15/04/2047 (a)              | 1 601                               | 140                              | 0,01                      | 5.028 % éch. 25/02/2055 - 25/03/2055        | 4 284                               | 4 332                            | 0,15                      | 4.659 % éch. 20/08/2055 - 20/12/2073                           | 8 904                               | 8 980                            | 0,31                      |
| 2.293 % éch. 15/10/2041 - 15/05/2046 (a) | 20 426                              | 1 911                            | 0,07                      | 5.207 % éch. 15/09/2032                     | 131                                 | 133                              | 0,00                      | 4.673 % éch. 20/03/2058                                        | 18 547                              | 18 711                           | 0,64                      |
| 2.308 % éch. 25/11/2049 - 25/06/2050 (a) | 19 573                              | 2 040                            | 0,07                      | 5.360 % éch. 01/03/2034 (g)                 | 3 045                               | 3 159                            | 0,11                      | 4.709 % éch. 20/06/2073                                        | 567                                 | 581                              | 0,02                      |
| 2.343 % éch. 15/08/2041 - 15/09/2044 (a) | 5 268                               | 531                              | 0,02                      | 5.500 % éch. 25/05/2054 (a)                 | 25 077                              | 4 619                            | 0,16                      | 4.729 % éch. 20/08/2073                                        | 4 196                               | 4 286                            | 0,15                      |
| 2.345 % éch. 15/12/2046 (a)              | 3 459                               | 302                              | 0,01                      | 6.500 % éch. 01/07/2054 (g)                 | 2 790                               | 2 874                            | 0,10                      | 4.809 % éch. 20/03/2072                                        | 4 734                               | 4 835                            | 0,17                      |
| 2.358 % éch. 25/06/2050 - 25/08/2050 (a) | 12 428                              | 1 338                            | 0,05                      | 6.500 % éch. 01/08/2055                     | 1 734                               | 1 825                            | 0,06                      | 4.898 % éch. 20/04/2067                                        | 258                                 | 260                              | 0,01                      |
| 2.372 % éch. 25/10/2054 (a)              | 4 580                               | 345                              | 0,01                      | Ginnie Mae                                  |                                     |                                  |                           | 4.961 % éch. 20/01/2071                                        | 1 148                               | 1 173                            | 0,04                      |
| 2.393 % éch. 15/02/2044 (a)              | 88                                  | 5                                | 0,00                      | 0.000 % éch. 20/08/2033 - 16/06/2043 (b)(d) | 811                                 | 716                              | 0,02                      | 5.000 % éch. 20/06/2040 - 20/11/2048                           | 2 140                               | 2 158                            | 0,07                      |
| 2.408 % éch. 25/05/2050 (a)              | 2 097                               | 229                              | 0,01                      | 1.093 % éch. 20/04/2043 (a)                 | 4 127                               | 235                              | 0,01                      | 5.000 % éch. 20/09/2040 (a)                                    | 213                                 | 2                                | 0,00                      |
| 2.443 % éch. 15/10/2032 - 15/10/2048 (a) | 9 298                               | 1 032                            | 0,04                      | 1.098 % éch. 20/11/2046 (a)                 | 4 421                               | 334                              | 0,01                      | 5.047 % éch. 20/09/2067                                        | 811                                 | 816                              | 0,03                      |
| 2.493 % éch. 15/03/2048 - 15/06/2048 (a) | 2 358                               | 287                              | 0,01                      | 1.126 % éch. 20/06/2043 (a)                 | 873                                 | 38                               | 0,00                      | 5.500 % éch. 16/11/2039                                        | 3 182                               | 3 239                            | 0,11                      |
| 2.500 % éch. 15/11/2027 - 15/10/2052 (a) | 113 818                             | 15 525                           | 0,53                      | 1.171 % éch. 20/10/2046 (a)                 | 2 521                               | 122                              | 0,00                      | 6.000 % éch. 20/02/2047                                        | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| 2.543 % éch. 15/09/2042 (a)              | 500                                 | 41                               | 0,00                      | 1.178 % éch. 20/06/2046 (a)                 | 2 977                               | 121                              | 0,00                      | Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           |
| 2.593 % éch. 15/10/2036 (a)              | 635                                 | 47                               | 0,00                      | 1.187 % éch. 20/01/2047 (a)                 | 2 904                               | 156                              | 0,01                      | 2.000 % éch. 01/07/2056                                        | 11 850                              | 9 710                            | 0,33                      |
| 2.763 % éch. 15/11/2037 (a)              | 147                                 | 10                               | 0,00                      | 1.189 % éch. 20/11/2046 (a)                 | 2 846                               | 155                              | 0,01                      | 2.500 % éch. 01/07/2056                                        | 28 800                              | 24 595                           | 0,84                      |
| 2.783 % éch. 15/01/2042 (a)              | 3 958                               | 467                              | 0,02                      | 1.198 % éch. 20/05/2047 - 20/08/2047 (a)    | 6 684                               | 306                              | 0,01                      | 3.500 % éch. 01/08/2056                                        | 8 000                               | 7 183                            | 0,24                      |
| 2.842 % éch. 25/06/2054                  | 785                                 | 764                              | 0,03                      | 1.204 % éch. 20/07/2046 (a)                 | 2 721                               | 152                              | 0,01                      | 4.000 % éch. 01/07/2056                                        | 77 300                              | 71 868                           | 2,45                      |
| 2.856 % éch. 25/12/2036                  | 5 617                               | 4 552                            | 0,16                      | 1.237 % éch. 20/05/2040 (a)                 | 2 622                               | 114                              | 0,00                      | 4.500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 196 120                             | 188 340                          | 6,41                      |
| 2.893 % éch. 15/11/2041 (a)              | 28                                  | 1                                | 0,00                      | 1.338 % éch. 20/07/2041 (a)                 | 814                                 | 42                               | 0,00                      | 5.000 % éch. 01/07/2056                                        | 66 500                              | 65 571                           | 2,23                      |
| 2.920 % éch. 01/09/2036                  | 1 242                               | 1 048                            | 0,04                      | 1.511 % éch. 20/06/2042 (a)                 | 894                                 | 38                               | 0,00                      | 5.500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 52 000                              | 52 227                           | 1,78                      |
| 2.993 % éch. 15/10/2036 - 15/12/2042 (a) | 1 209                               | 138                              | 0,00                      | 1.561 % éch. 20/06/2042 (a)                 | 821                                 | 32                               | 0,00                      | 6.000 % éch. 01/09/2056                                        | 7 000                               | 7 130                            | 0,24                      |
| 3.000 % éch. 15/03/2027 - 15/10/2052 (a) | 151 303                             | 23 554                           | 0,80                      | 1.796 % éch. 20/09/2043 (a)                 | 640                                 | 10                               | 0,00                      | 6.500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 76 800                              | 79 545                           | 2,71                      |
| 3.004 % éch. 25/07/2054                  | 5 735                               | 5 559                            | 0,19                      | 1.966 % éch. 20/09/2045 (a)                 | 1 452                               | 115                              | 0,00                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           |
| 3.023 % éch. 15/09/2039 (a)              | 1 702                               | 159                              | 0,01                      | 2.000 % éch. 20/02/2051 (a)                 | 2 945                               | 311                              | 0,01                      | 2.500 % éch. 01/01/2033 - 01/09/2051                           | 2 030                               | 1 799                            | 0,06                      |
| 3.072 % éch. 15/10/2042                  | 483                                 | 368                              | 0,01                      | 2.302 % éch. 16/04/2040 - 16/08/2042 (a)    | 1 571                               | 119                              | 0,00                      | 2.500 % éch. 01/09/2051 (g)                                    | 11 945                              | 10 207                           | 0,35                      |
| 3.076 % éch. 15/12/2027 (a)              | 42                                  | 1                                | 0,00                      | 2.346 % éch. 20/01/2035 - 20/08/2049 (a)    | 6 610                               | 488                              | 0,02                      | 3.000 % éch. 01/01/2038 - 01/04/2052                           | 21 423                              | 18 960                           | 0,65                      |
| 3.143 % éch. 15/03/2038 (a)              | 216                                 | 15                               | 0,00                      | 2.446 % éch. 20/03/2035 - 20/09/2048 (a)    | 1 360                               | 169                              | 0,01                      | 3.000 % éch. 01/02/2040 - 01/07/2050 (g)                       | 23 464                              | 21 053                           | 0,72                      |
| 3.500 % éch. 15/03/2029 - 15/10/2052 (a) | 90 362                              | 15 442                           | 0,53                      | 2.496 % éch. 20/07/2044 (a)                 | 2 278                               | 329                              | 0,01                      | 3.500 % éch. 01/02/2030 - 01/06/2051                           | 16 421                              | 15 333                           | 0,52                      |
| 3.500 % éch. 01/01/2038 - 01/12/2046     | 693                                 | 648                              | 0,02                      | 2.500 % éch. 20/09/2027 (a)                 | 312                                 | 2                                | 0,00                      | 3.500 % éch. 01/11/2034 - 01/04/2050 (g)                       | 13 682                              | 12 724                           | 0,43                      |
| 4.000 % éch. 15/10/2041 - 25/08/2050 (a) | 19 392                              | 4 396                            | 0,15                      | 2.500 % éch. 20/09/2051                     | 197                                 | 169                              | 0,01                      | 4.000 % éch. 01/02/2037 - 01/08/2049                           | 21 987                              | 21 027                           | 0,72                      |
| 4.000 % éch. 01/03/2046 - 25/08/2056     | 30 770                              | 29 531                           | 1,01                      | 2.702 % éch. 16/02/2040 (a)                 | 1 038                               | 62                               | 0,00                      | 4.000 % éch. 01/05/2045 - 01/01/2049 (g)                       | 10 241                              | 9 705                            | 0,33                      |
| 4.107 % éch. 15/08/2057                  | 4 131                               | 4 001                            | 1,04                      | 2.946 % éch. 20/05/2041 (a)                 | 475                                 | 26                               | 0,00                      | 4.500 % éch. 01/12/2038 - 01/09/2050                           | 2 498                               | 2 454                            | 0,08                      |
| 4.142 % éch. 25/09/2049                  | 1 342                               | 1 326                            | 0,05                      | 3.000 % éch. 20/12/2047 - 20/07/2052 (g)    | 27 673                              | 24 652                           | 0,84                      | 4.500 % éch. 01/01/2038 - 01/09/2050                           | 10 241                              | 9 705                            | 0,33                      |
| 4.190 % éch. 01/05/2030 (g)              | 2 500                               | 2 473                            | 0,08                      | 3.000 % éch. 20/02/2048 - 20/04/2052        | 155 862                             | 138 599                          | 4,72                      | 4.500 % éch. 01/12/2038 - 01/09/2050                           | 2 498                               | 2 454                            | 0,08                      |
| 4.193 % éch. 15/12/2031 (a)              | 25                                  | 2                                | 0,00                      | 3.000 % éch. 20/12/2049 (a)                 | 5 531                               | 899                              | 0,03                      | 4.500 % éch. 01/07/2053 - 01/12/2054 (g)                       | 16 944                              | 16 319                           | 0,56                      |
| 4.228 % éch. 25/10/2034                  | 8 699                               | 8 506                            | 0,29                      | 3.250 % éch. 20/01/2047                     | 399                                 | 351                              | 0,01                      | 5.000 % éch. 01/06/2048 - 01/03/2056                           | 37 150                              | 36 837                           | 1,25                      |
| 4.428 % éch. 25/10/2052                  | 9 794                               | 9 763                            | 0,33                      | 3.500 % éch. 20/03/2042 - 20/01/2069        | 8 682                               | 7 585                            | 0,26                      | 5.000 % éch. 01/02/2054 - 01/02/2056 (g)                       | 22 759                              | 22 573                           | 0,77                      |
| 4.498 % éch. 25/12/2055                  | 1 894                               | 1 899                            | 0,07                      | 3.578 % éch. 20/11/2048                     | 534                                 | 386                              | 0,01                      | 5.500 % éch. 01/01/2038 - 01/01/2056                           | 61 816                              | 62 875                           | 2,14                      |
| 4.500 % éch. 15/11/2040 - 01/02/2048     | 1 189                               | 1 123                            | 0,04                      | 3.909 % éch. 20/01/2068 - 20/09/2073        | 640                                 | 639                              | 0,02                      | 5.500 % éch. 01/07/2053 - 01/09/2055 (g)                       | 73 215                              | 73 892                           | 2,52                      |
| 4.500 % éch. 15/01/2041 - 25/08/2055 (a) | 22 397                              | 5 318                            | 0,18                      | 4.000 % éch. 15/04/2047 - 15/08/2048        | 1 885                               | 1 802                            | 0,06                      | 6.000 % éch. 01/09/2040 - 01/01/2056                           | 154 099                             | 159 159                          | 5,42                      |
| 4.528 % éch. 25/10/2053 - 25/11/2054     | 3 651                               | 3 673                            | 0,13                      | 4.241 % éch. 20/06/2069                     | 148                                 | 147                              | 0,01                      | 6.000 % éch. 01/09/2053 - 01/11/2055 (g)                       | 226 124                             | 235 595                          | 8,02                      |
| 4.549 % éch. 15/04/2049 - 15/12/2050     | 914                                 | 916                              | 0,03                      | 4.261 % éch. 20/06/2069 - 20/11/2069        | 702                                 | 301                              | 0,01                      | 6.500 % éch. 01/05/2045 - 01/09/2055                           | 53 183                              | 55 989                           | 1,91                      |
| 4.598 % éch. 25/05/2034 - 25/08/2054     | 6 521                               | 6 567                            | 0,22                      | 4.275 % éch. 20/07/2064 - 20/04/2072        | 16 732                              | 16 784                           | 0,57                      | 6.500 % éch. 01/05/2045 - 01/09/2055                           | 53 183                              | 55 989                           | 1,91                      |
| 4.608 % éch. 25/02/2055                  | 21 051                              | 21 229                           | 0,72                      | 4.339 % éch. 20/01/2073                     | 4 855                               | 4 888                            | 0,17                      | 6.500 % éch. 01/05/2045 - 01/09/2055                           | 53 183                              | 55 989                           | 1,91                      |
| 4.628 % éch. 25/02/2055 - 25/03/2055     | 26 545                              | 26 715                           | 0,91                      | 4.359 % éch. 20/11/2075 - 20/01/2076        | 14 898                              | 15 023                           | 0,51                      | 7.000 % éch. 01/06/2054 - 01/07/2054                           | 321                                 | 341                              | 0,01                      |
| 4.649 % éch. 15/08/2048                  | 1 032                               | 1 041                            | 0,04                      | 4.361 % éch. 20/05/2069                     | 436                                 | 436                              | 0,02                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |
| 4.660 % éch. 25/01/2031 - 01/01/2037     | 2 662                               | 2 668                            | 0,09                      | 4.409 % éch. 20/09/2055 - 20/02/2076        | 12 266                              | 12 397                           | 0,42                      | 2.000 % éch. 01/08/2056                                        | 12 200                              | 9 741                            | 0,33                      |
| 4.678 % éch. 25/08/2055 - 25/11/2055     | 2 978                               | 3 001                            | 0,10                      | 4.411 % éch. 20/02/2070                     | 198                                 | 198                              | 0,01                      | 4.000 % éch. 01/07/2056 - 01/09/2056                           | 279 900                             | 261 638                          | 8,90                      |
| 4.728 % éch. 25/10/2054 - 25/11/2054     | 12 781                              | 12 801                           | 0,44                      | 4.449 % éch. 20/04/2075                     | 4 228                               | 4 276                            | 0,15                      | 4.500 % éch. 01/08/2041                                        | 19 400                              | 19 157                           | 0,65                      |
| 4.748 % éch. 25/08/2054                  | 422                                 | 426                              | 0,01                      | 4.459 % éch. 20/04/2054 - 20/07/2074        | 20 608                              | 20 690                           | 0,71                      | 5.000 % éch. 01/07/2041 - 01/08/2056                           | 790 200                             | 775 824                          | 26,41                     |
| 4.778 % éch. 25/12/2054 - 25/08/2055     | 62 545                              | 63 208                           | 2,15                      | 4.500 % éch. 20/07/2040 - 20/02/2049        | 1 900                               | 1 849                            | 0,06                      | 5.500 % éch. 01/08/2056                                        | 3 250                               | 3 256                            | 0,11                      |
| 4.828 % éch. 25/04/2054 - 25/08/2055     | 2 162                               | 2 181                            | 0,07                      | 4.500 % éch. 20/05/2043 - 20/09/2047 (a)    | 2 079                               | 365                              | 0,01                      | 6.000 % éch. 01/08/2056 - 01/09/2056                           | 187 825                             | 191 320                          | 6,52                      |
| 4.878 % éch. 25/11/2052                  | 8 075                               | 8 088                            | 0,28                      | 4.509 % éch. 20/07/2073 - 20/07/2074        | 96 954                              | 98 319                           | 3,35                      | 6.500 % éch. 01/07/2056                                        | 82 550                              | 85 400                           | 2,91                      |
| 4.928 % éch. 25/11/2054 - 25/05/2055     | 34 313                              | 34 400                           | 1,17                      | 4.539 % éch. 20/01/2074 - 20/08/2074        | 7 697                               | 7 829                            | 0,27                      |                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4.978 % éch. 25/08/2054                  | 810                                 | 817                              | 0,03                      |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                          |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                          |                                     |                                  |                           |
| Obligations du Trésor américain                                                                 |                                     |                                  |                           | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                               |                                     |                                  |                           | JPMorgan Resecuritization Trust                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,875 % éch. 15/08/2045                                                                         | \$                                  | 1 330                            | \$                        | 3,549 % éch. 25/04/2035                                                                         | \$                                  | 174                              | \$                        | 4,500 % éch. 26/04/2037                                                                         | \$                                  | 931                              | \$                        |
| Billets du Trésor américain                                                                     |                                     |                                  |                           | 4,381 % éch. 20/11/2035                                                                         | 2 186                               | 2 053                            | 0,07                      | 6,305 % éch. 26/09/2037                                                                         | 1 022                               | 775                              | 0,03                      |
| 4,250 % éch. 15/08/2035                                                                         |                                     | 2 163                            | 2 136                     | 4,434 % éch. 20/04/2036                                                                         | 29                                  | 28                               | 0,00                      | Jubilee Place BV                                                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                 |                                     |                                  | 0,07                      | 5,076 % éch. 20/04/2036                                                                         | 378                                 | 338                              | 0,01                      | 3,127 % éch. 18/09/2062                                                                         | €                                   | 3 924                            | 4 492                     |
|                                                                                                 |                                     |                                  | <b>3 456</b>              | 5,750 % éch. 25/07/2037                                                                         | 676                                 | 304                              | 0,01                      | Kinbane DAC                                                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                 |                                     |                                  | <b>0,12</b>               | 6,500 % éch. 25/11/2037                                                                         | 2 234                               | 654                              | 0,02                      | 3,378 % éch. 24/08/2075                                                                         | 2 023                               | 2 317                            | 0,08                      |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/12/2037                                                                         | 5 078                               | 1 826                            | 0,06                      | 3,379 % éch. 24/01/2063                                                                         | 1 969                               | 2 255                            | 0,08                      |
| <b>TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           |
| 1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust                                           |                                     |                                  |                           | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                                     |                                     |                                  |                           | La Trobe Financial Capital Markets Trust                                                        |                                     |                                  |                           |
| 5,690 % éch. 13/10/2037                                                                         |                                     | 2 000                            | 1 691                     | 2,992 % éch. 25/07/2057                                                                         | 1 000                               | 859                              | 0,03                      | 5,000 % éch. 15/08/2057                                                                         | AUD                                 | 4 717                            | 3 267                     |
| AFG Trust                                                                                       |                                     |                                  | 0,06                      | 3,919 % éch. 25/09/2057                                                                         | 6 500                               | 6 104                            | 0,21                      | 5,050 % éch. 15/05/2057                                                                         | 122                                 | 84                               | 0,00                      |
| 5,012 % éch. 10/10/2057                                                                         | AUD                                 | 2 992                            | 2 073                     | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust                                            |                                     |                                  |                           | 5,167 % éch. 13/11/2057                                                                         | 3 500                               | 2 425                            | 0,08                      |
| 5,262 % éch. 10/10/2057                                                                         |                                     | 10 000                           | 6 910                     | 5,500 % éch. 25/10/2021                                                                         | 15                                  | 14                               | 0,00                      | 5,507 % éch. 13/11/2057                                                                         | 5 000                               | 3 466                            | 0,12                      |
| American Home Mortgage Assets Trust                                                             |                                     |                                  |                           | Dilosk RMBS DAC                                                                                 |                                     |                                  |                           | Lehman Mortgage Trust                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 3,888 % éch. 25/03/2047                                                                         | \$                                  | 1 548                            | 1 411                     | 2,733 % éch. 25/10/2064                                                                         | €                                   | 1 000                            | 1 142                     | 6,000 % éch. 25/12/2036                                                                         | \$                                  | 1 207                            | 979                       |
| American Home Mortgage Investment Trust                                                         |                                     |                                  | 0,05                      | 2,845 % éch. 25/01/2063                                                                         | 787                                 | 900                              | 0,03                      | Lehman XS Trust                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,343 % éch. 25/11/2045                                                                         |                                     | 3 085                            | 2 835                     | 3,080 % éch. 24/09/2060                                                                         | 2 395                               | 2 740                            | 0,09                      | 4,243 % éch. 25/06/2047                                                                         | 3 765                               | 3 645                            | 0,12                      |
| 5,883 % éch. 25/09/2035                                                                         |                                     | 475                              | 253                       | Domi BV                                                                                         |                                     |                                  |                           | Liberty Trust                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 25/03/2047                                                                         |                                     | 972                              | 561                       | 2,914 % éch. 16/04/2057                                                                         | 5 073                               | 5 807                            | 0,20                      | 5,012 % éch. 10/10/2058                                                                         | AUD                                 | 3 820                            | 2 646                     |
| Angel Oak Mortgage Trust                                                                        |                                     |                                  | 0,02                      | 3,081 % éch. 15/06/2056                                                                         | 7 122                               | 8 143                            | 0,28                      | 5,312 % éch. 10/10/2058                                                                         | 10 000                              | 6 918                            | 0,24                      |
| 2,336 % éch. 25/04/2066                                                                         |                                     | 3 638                            | 2 701                     | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                                           |                                     |                                  |                           | London Wall Mortgage Capital PLC                                                                |                                     |                                  |                           |
| Atlas Funding PLC                                                                               |                                     |                                  | 0,09                      | 3,944 % éch. 19/10/2036                                                                         | \$                                  | 3 619                            | 3 379                     | 4,738 % éch. 15/05/2057                                                                         | £                                   | 917                              | 1 220                     |
| 4,586 % éch. 20/09/2061                                                                         | £                                   | 1 985                            | 2 638                     | Dutch Property Finance BV                                                                       |                                     |                                  |                           | Lugo Funding DAC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| Avon Finance PLC                                                                                |                                     |                                  | 0,09                      | 3,063 % éch. 28/04/2062                                                                         | €                                   | 9 504                            | 10 888                    | 3,195 % éch. 26/05/2066                                                                         | €                                   | 5 227                            | 5 969                     |
| 4,646 % éch. 28/12/2049                                                                         |                                     | 1 124                            | 1 492                     | Edenbrook Mortgage Funding PLC                                                                  |                                     |                                  |                           | MASTR Asset Securitization Trust                                                                |                                     |                                  |                           |
| Banc of America Funding Trust                                                                   |                                     |                                  | 0,05                      | 4,616 % éch. 22/03/2057                                                                         | £                                   | 944                              | 1 254                     | 6,000 % éch. 25/10/2036                                                                         | \$                                  | 512                              | 411                       |
| 6,263 % éch. 25/10/2036                                                                         | \$                                  | 1 223                            | 1 095                     | Elstree PLC                                                                                     |                                     |                                  |                           | MASTR Reperforming Loan Trust                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Barclays Commercial Mortgage Securities Trust                                                   |                                     |                                  | 0,04                      | 4,454 % éch. 21/01/2065                                                                         | 3 016                               | 4 001                            | 0,14                      | 7,000 % éch. 25/07/2035                                                                         | 1 030                               | 637                              | 0,02                      |
| 3,966 % éch. 10/08/2033                                                                         |                                     | 11 110                           | 10 385                    | EMF-UK PLC                                                                                      |                                     |                                  |                           | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                                                          |                                     |                                  |                           |
| Barley Hill PLC                                                                                 |                                     |                                  | 0,35                      | 5,166 % éch. 13/03/2046                                                                         | 1 075                               | 1 433                            | 0,05                      | 6,250 % éch. 25/08/2036                                                                         | 3 901                               | 1 357                            | 0,05                      |
| 6,284 % éch. 27/08/2058                                                                         | £                                   | 2 953                            | 3 923                     | Eurosail PLC                                                                                    |                                     |                                  |                           | Merriem Square Residential DAC                                                                  |                                     |                                  |                           |
| BCAP LLC Trust                                                                                  |                                     |                                  | 0,13                      | 2,641 % éch. 13/03/2045                                                                         | €                                   | 165                              | 187                       | 3,378 % éch. 24/03/2081                                                                         | €                                   | 8 335                            | 9 560                     |
| 4,043 % éch. 25/04/2037                                                                         | \$                                  | 1 071                            | 1 036                     | 2,801 % éch. 10/09/2044                                                                         | 512                                 | 585                              | 0,02                      | Mill City Mortgage Loan Trust                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                                                        |                                     |                                  | 0,04                      | 4,416 % éch. 13/06/2045                                                                         | £                                   | 1 673                            | 2 060                     | 3,250 % éch. 25/01/2061                                                                         | \$                                  | 1 739                            | 1 489                     |
| 4,888 % éch. 25/01/2035                                                                         |                                     | 900                              | 869                       | 4,866 % éch. 13/06/2045                                                                         | 309                                 | 398                              | 0,01                      | 3,810 % éch. 25/11/2058                                                                         | 1 900                               | 1 616                            | 0,05                      |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust                                                             |                                     |                                  | 0,03                      | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust                                             |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,143 % éch. 25/01/2037                                                                         |                                     | 6 405                            | 6 100                     | 5,004 % éch. 25/07/2035                                                                         | \$                                  | 110                              | 104                       | 5,500 % éch. 25/11/2035                                                                         |                                     | 858                              | 495                       |
| Blackwattle RMBS Trust                                                                          |                                     |                                  | 0,21                      | FirstMac Mortgage Funding Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/10/2037                                                                         | 6 071                               | 2 565                            | 0,09                      |
| 5,050 % éch. 12/02/2058 (c)                                                                     | AUD                                 | 4 450                            | 3 083                     | 5,380 % éch. 11/05/2058                                                                         | AUD                                 | 20 000                           | 13 872                    | Mortimer Mix PLC                                                                                |                                     |                                  |                           |
| Bletchley Park Funding PLC                                                                      |                                     |                                  | 0,10                      | Frontier Mortgage Funding PLC                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,579 % éch. 22/09/2067                                                                         | £                                   | 3 387                            | 4 498                     |
| 4,604 % éch. 27/07/2070                                                                         | £                                   | 1 183                            | 1 573                     | 4,732 % éch. 20/12/2066                                                                         | £                                   | 1 000                            | 1 327                     | Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust                                            |                                     |                                  |                           |
| Braccan Mortgage Funding PLC                                                                    |                                     |                                  | 0,05                      | 5,082 % éch. 20/12/2066                                                                         | 1 000                               | 1 329                            | 0,05                      | 4,321 % éch. 25/10/2035                                                                         | \$                                  | 480                              | 439                       |
| 4,587 % éch. 15/02/2067                                                                         |                                     | 8 135                            | 10 804                    | 5,482 % éch. 20/12/2066                                                                         | 1 000                               | 1 328                            | 0,05                      | 6,017 % éch. 25/06/2037                                                                         | 938                                 | 842                              | 0,03                      |
| Chase Mortgage Finance Trust                                                                    |                                     |                                  | 0,37                      | 6,232 % éch. 20/12/2066                                                                         | 1 000                               | 1 323                            | 0,04                      | Nomura Resecuritization Trust                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,350 % éch. 25/03/2037                                                                         | \$                                  | 33                               | 30                        | Grifonas Finance PLC                                                                            |                                     |                                  |                           | 2,491 % éch. 26/11/2036                                                                         | 1 629                               | 1 456                            | 0,05                      |
| ChaseFlex Trust                                                                                 |                                     |                                  | 0,00                      | 2,419 % éch. 28/08/2039                                                                         | €                                   | 392                              | 443                       | Olympus Trust                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,443 % éch. 25/05/2037                                                                         |                                     | 968                              | 940                       | GS Mortgage Securities Corp. Trust                                                              |                                     |                                  |                           | 4,999 % éch. 12/11/2057                                                                         | AUD                                 | 956                              | 662                       |
| Citigroup Commercial Mortgage Trust                                                             |                                     |                                  | 0,03                      | 5,102 % éch. 26/04/2037                                                                         | \$                                  | 7 355                            | 1 712                     | Pierpoint BTL PLC                                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,242 % éch. 10/11/2051                                                                         |                                     | 4 037                            | 4 022                     | 5,123 % éch. 15/07/2031                                                                         | 600                                 | 186                              | 0,01                      | 4,586 % éch. 21/09/2061                                                                         | £                                   | 944                              | 1 254                     |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                             |                                     |                                  | 0,14                      | 5,373 % éch. 15/07/2031                                                                         | 2 000                               | 383                              | 0,01                      | Polaris PLC                                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 5,666 % éch. 25/08/2035                                                                         |                                     | 3                                | 3                         | GS Mortgage-Backed Securities Trust                                                             |                                     |                                  |                           | 4,464 % éch. 27/06/2070                                                                         |                                     | 7 400                            | 9 801                     |
| 6,000 % éch. 25/12/2035                                                                         |                                     | 626                              | 623                       | 3,133 % éch. 24/11/2067                                                                         | €                                   | 3 900                            | 4 471                     | 4,555 % éch. 26/02/2068                                                                         |                                     | 17 712                           | 23 510                    |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust                                                             |                                     |                                  | 0,00                      | 3,750 % éch. 25/10/2057                                                                         | \$                                  | 841                              | 824                       | Project Cashmere                                                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,313 % éch. 25/01/2037                                                                         |                                     | 1 099                            | 923                       | GSMPS Mortgage Loan Trust                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 30/12/2057 (c)                                                                     | AUD                                 | 104 100                          | 71 885                    |
| 6,000 % éch. 25/11/2036                                                                         |                                     | 667                              | 617                       | 4,163 % éch. 25/04/2036                                                                         |                                     | 244                              | 214                       | 5,713 % éch. 30/12/2057 (c)                                                                     |                                     | 3 500                            | 2 419                     |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                              |                                     |                                  | 0,02                      | 7,052 % éch. 20/10/2032                                                                         |                                     | 810                              | 763                       | 5,863 % éch. 30/12/2057 (c)                                                                     |                                     | 2 400                            | 1 659                     |
| 4,083 % éch. 25/02/2047                                                                         |                                     | 217                              | 202                       | HarbourView Mortgage Loan Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | 6,163 % éch. 30/12/2057 (c)                                                                     |                                     | 1 300                            | 899                       |
| 4,083 % éch. 25/09/2047                                                                         |                                     | 6                                | 5                         | 4,134 % éch. 19/01/2038                                                                         | 2 830                               | 2 561                            | 0,09                      | 6,563 % éch. 30/12/2057 (c)                                                                     |                                     | 1 000                            | 691                       |
| 4,174 % éch. 20/03/2046                                                                         |                                     | 379                              | 361                       | Harbour PLC                                                                                     |                                     |                                  |                           | Residential Accredited Loans, Inc. Trust                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,174 % éch. 20/05/2046                                                                         |                                     | 1 421                            | 1 295                     | 4,797 % éch. 28/10/2054                                                                         | £                                   | 8 028                            | 10 689                    | 4,063 % éch. 25/08/2036                                                                         | \$                                  | 590                              | 467                       |
| 4,403 % éch. 25/11/2035                                                                         |                                     | 3 400                            | 3 169                     | Hawksmoor Mortgage Funding PLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 5,576 % éch. 25/12/2035                                                                         |                                     | 1 094                            | 396                       |
| 4,463 % éch. 25/09/2035                                                                         |                                     | 2 099                            | 1 968                     | 4,587 % éch. 25/02/2057                                                                         |                                     | 3 400                            | 4 518                     | 6,000 % éch. 25/01/2037                                                                         |                                     | 129                              | 107                       |
| 4,684 % éch. 25/06/2046                                                                         |                                     | 1 764                            | 1 695                     | Household Capital RMBS                                                                          |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 25/01/2037                                                                         |                                     | 727                              | 605                       |
| 4,744 % éch. 25/12/2035                                                                         |                                     | 885                              | 813                       | 6,231 % éch. 21/07/2087                                                                         | AUD                                 | 1 530                            | 1 057                     | Residential Asset Securitization Trust                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 25/06/2035                                                                         |                                     | 106                              | 84                        | HSI Asset Securitization Corp. Trust                                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/12/2036                                                                         |                                     | 3 002                            | 772                       |
| 5,500 % éch. 25/07/2035                                                                         |                                     | 1 582                            | 1 002                     | 4,723 % éch. 25/07/2035                                                                         | \$                                  | 704                              | 668                       | Resimac Premier Trust                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 25/10/2035                                                                         |                                     | 913                              | 620                       | IndyMac Mortgage Loan Trust                                                                     |                                     |                                  |                           | 5,093 % éch. 11/02/2058                                                                         | AUD                                 | 900                              | 624                       |
| 5,500 % éch. 25/11/2035                                                                         |                                     | 1 552                            | 769                       | 3,718 % éch. 25/12/2035                                                                         |                                     | 2 813                            | 1 460                     | 5,423 % éch. 11/02/2058                                                                         |                                     | 9 600                            | 6 652                     |
| 5,500 % éch. 25/12/2035                                                                         |                                     | 184                              | 120                       | 4,161 % éch. 25/12/2035                                                                         |                                     | 272                              | 182                       | RMAC Securities PLC                                                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 25/05/2036                                                                         |                                     | 3 123                            | 1 638                     | 4,163 % éch. 25/10/2036                                                                         |                                     | 2 501                            | 2 298                     | 4,036 % éch. 12/06/2044                                                                         | £                                   | 226                              | 295                       |
| 6,000 % éch. 25/02/2037                                                                         |                                     | 1 374                            | 469                       | JPMorgan Alternative Loan Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | Sapphire Trust Central Finance                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 25/05/2036                                                                         |                                     | 239                              | 115                       | 4,083 % éch. 25/11/2036                                                                         |                                     | 2 796                            | 2 464                     | 4,999 % éch. 12/12/2067                                                                         | AUD                                 | 4 207                            | 2 914                     |
| 6,250 % éch. 25/09/2037                                                                         |                                     | 458                              | 271                       | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust                                             |                                     |                                  |                           | 5,131 % éch. 12/03/2068                                                                         |                                     | 1 800                            | 1 247                     |
|                                                                                                 |                                     |                                  | 0,01                      | 4,802 % éch. 05/07/2033                                                                         |                                     | 1 531                            | 1 483                     | 5,299 % éch. 12/12/2067                                                                         |                                     | 10 000                           | 6 909                     |
|                                                                                                 |                                     |                                  |                           | 5,350 % éch. 05/07/2033                                                                         |                                     | 1 950                            | 907                       | 5,570 % éch. 14/01/2066                                                                         |                                     | 392                              | 272                       |



# Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                            | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                                    |    |        |    |        |      |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------|----|--------|----|--------|------|
| Sestante Finance SRL                                               | €                                   | 436                              | \$                        | 474         | 0,02                                | Auto1 Car Funding SARL                                                      | €                         | 161         | \$                                  | 184                              | 0,01                      | 4,663 % éch. 25/10/2034                                            | \$ | 48     | \$ | 48     | 0,00 |
| 2,388 % éch. 23/07/2046                                            |                                     |                                  |                           |             |                                     | 2,829 % éch. 15/12/2033                                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 25/01/2036                                            |    | 298    |    | 294    | 0,01 |
| Stratton BTL Mortgage Funding PLC                                  |                                     |                                  |                           |             |                                     | BBVA Consumer Auto                                                          |                           |             |                                     |                                  |                           | 5,633 % éch. 25/06/2035                                            |    | 92     |    | 81     | 0,00 |
| 5,397 % éch. 20/01/2054                                            | £                                   | 3 000                            |                           | 3 985       | 0,14                                | 3,117 % éch. 19/03/2038                                                     |                           | 1 240       |                                     | 1 423                            | 0,05                      | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                  |    | 1 522  |    | 1 058  | 0,04 |
| Stratton Mortgage Funding PLC                                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | Bumper NL BV                                                                |                           |             |                                     |                                  |                           | 2,955 % éch. 25/05/2036                                            |    | 162    |    | 187    | 0,01 |
| 4,649 % éch. 28/06/2050                                            |                                     | 816                              |                           | 1 084       | 0,04                                | 2,925 % éch. 21/03/2036                                                     |                           | 6 988       |                                     | 8 002                            | 0,27                      | 3,431 % éch. 25/02/2037                                            |    | 2 903  |    | 1 643  | 0,06 |
| 4,721 % éch. 25/06/2049                                            |                                     | 6 671                            |                           | 8 858       | 0,30                                | Driver Australia Eleven                                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust                                            |    |        |    |        |      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                     |                                     |                                  |                           |             |                                     | 5,300 % éch. 21/11/2033                                                     | AUD                       | 4 962       |                                     | 3 439                            | 0,12                      | 4,043 % éch. 25/02/2037                                            |    | 4 700  |    | 3 531  | 0,12 |
| 4,063 % éch. 25/02/2037                                            | \$                                  | 355                              |                           | 363         | 0,01                                | Driver Australia Ten                                                        |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,243 % éch. 25/08/2036                                            |    | 3 783  |    | 1 158  | 0,04 |
| 4,203 % éch. 25/06/2037                                            |                                     | 217                              |                           | 207         | 0,01                                | 5,450 % éch. 21/02/2033                                                     |                           | 5 528       |                                     | 3 837                            | 0,13                      | 4,693 % éch. 25/07/2035                                            |    | 2 800  |    | 2 427  | 0,08 |
| 4,311 % éch. 25/05/2035                                            |                                     | 682                              |                           | 563         | 0,02                                | First Mobility SARL                                                         |                           |             |                                     |                                  |                           | GSAA Home Equity Trust                                             |    |        |    |        |      |
| 4,733 % éch. 25/12/2034                                            |                                     | 1 208                            |                           | 1 137       | 0,04                                | 2,809 % éch. 14/10/2032                                                     | €                         | 2 790       |                                     | 3 195                            | 0,11                      | 4,223 % éch. 25/04/2047                                            |    | 3 199  |    | 1 376  | 0,05 |
| 4,887 % éch. 25/07/2035                                            |                                     | 1 460                            |                           | 575         | 0,02                                | Golden Bar Securitisation SRL                                               |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,483 % éch. 25/10/2035                                            |    | 1 545  |    | 1 488  | 0,05 |
| 5,923 % éch. 25/02/2034                                            |                                     | 4                                |                           | 4           | 0,00                                | 3,436 % éch. 22/09/2043                                                     |                           | 4 765       |                                     | 5 479                            | 0,19                      | GSAMP Trust                                                        |    |        |    |        |      |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust                        |                                     |                                  |                           |             |                                     | Hill FL BV                                                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/03/2047                                            |    | 623    |    | 459    | 0,02 |
| 4,203 % éch. 25/09/2047                                            |                                     | 2 521                            |                           | 2 289       | 0,08                                | 2,929 % éch. 18/10/2032                                                     |                           | 1 963       |                                     | 2 246                            | 0,08                      | Home Equity Asset Trust                                            |    |        |    |        |      |
| 4,303 % éch. 25/08/2035                                            |                                     | 349                              |                           | 339         | 0,01                                | Koromo Italy Compartment                                                    |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,438 % éch. 25/02/2036                                            |    | 743    |    | 729    | 0,02 |
| 4,879 % éch. 19/12/2033                                            |                                     | 158                              |                           | 154         | 0,01                                | 2,905 % éch. 26/02/2032                                                     |                           | 2 051       |                                     | 2 350                            | 0,08                      | 5,053 % éch. 25/08/2033                                            |    | 111    |    | 109    | 0,00 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |                                     |                                  |                           |             |                                     | Panorama Auto Trust                                                         |                           |             |                                     |                                  |                           | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust                       |    |        |    |        |      |
| 4,013 % éch. 25/07/2035                                            |                                     | 964                              |                           | 871         | 0,03                                | 5,367 % éch. 20/05/2034                                                     | AUD                       | 10 000      |                                     | 6 928                            | 0,23                      | 4,003 % éch. 25/04/2037                                            |    | 5 538  |    | 3 754  | 0,13 |
| 4,013 % éch. 25/05/2036                                            |                                     | 1 552                            |                           | 1 278       | 0,04                                | Plenti Auto ABS                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                |    |        |    |        |      |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     | 5,399 % éch. 12/08/2033                                                     |                           | 801         |                                     | 556                              | 0,02                      | 4,003 % éch. 25/12/2036                                            |    | 5 301  |    | 2 694  | 0,09 |
| 4,050 % éch. 25/04/2055                                            |                                     | 10 000                           |                           | 9 727       | 0,33                                | Red & Black Auto Italy SRL                                                  | €                         | 1 966       |                                     | 2 258                            | 0,08                      | Long Beach Mortgage Loan Trust                                     |    |        |    |        |      |
| 4,584 % éch. 20/04/2051                                            | £                                   | 7 064                            |                           | 9 377       | 0,32                                | 3,019 % éch. 28/07/2036                                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,363 % éch. 25/02/2036                                            |    | 127    |    | 114    | 0,00 |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                                            |                                     | 6 184                            |                           | 8 213       | 0,28                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust                   |    |        |    |        |      |
| 4,984 % éch. 20/04/2051                                            |                                     | 2 106                            |                           | 2 797       | 0,10                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/07/2037                                            |    | 10 226 |    | 10 249 | 0,35 |
| 5,284 % éch. 20/04/2051                                            |                                     | 1 264                            |                           | 1 680       | 0,06                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                             |    |        |    |        |      |
| 5,984 % éch. 20/04/2051                                            |                                     | 1 053                            |                           | 1 402       | 0,05                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,843 % éch. 25/10/2035                                            |    | 80     |    | 79     | 0,00 |
| 6,984 % éch. 20/04/2051                                            |                                     | 843                              |                           | 1 121       | 0,04                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                             |    |        |    |        |      |
| 7,984 % éch. 20/04/2051                                            |                                     | 526                              |                           | 701         | 0,02                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | 3,546 % éch. 25/01/2035                                            |    | 589    |    | 548    | 0,02 |
| Towd Point Mortgage Trust                                          |                                     |                                  |                           |             |                                     | ACREC LLC                                                                   |                           |             |                                     |                                  |                           | 3,903 % éch. 25/10/2036                                            |    | 1 832  |    | 793    | 0,03 |
| 3,750 % éch. 25/05/2058                                            | \$                                  | 6 967                            |                           | 6 846       | 0,23                                | 4,947 % éch. 18/08/2042                                                     | \$                        | 17 200      |                                     | 17 211                           | 0,59                      | 4,013 % éch. 25/07/2036                                            |    | 7 561  |    | 6 840  | 0,23 |
| 3,799 % éch. 25/07/2057                                            |                                     | 3 200                            |                           | 2 855       | 0,10                                | BDS LLC                                                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/07/2036                                            |    | 3 149  |    | 1 122  | 0,04 |
| 4,072 % éch. 25/04/2056                                            |                                     | 3 096                            |                           | 2 926       | 0,10                                | 4,921 % éch. 17/10/2042                                                     |                           | 10 100      |                                     | 10 108                           | 0,34                      | 4,263 % éch. 25/07/2036                                            |    | 3 149  |    | 1 125  | 0,04 |
| Tower Bridge Funding PLC                                           |                                     |                                  |                           |             |                                     | Dwight Issuer LLC                                                           |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,343 % éch. 25/01/2036                                            |    | 1 007  |    | 983    | 0,03 |
| 4,538 % éch. 20/12/2066                                            | £                                   | 829                              |                           | 1 101       | 0,04                                | 5,000 % éch. 18/01/2044 (c)                                                 |                           | 5 700       |                                     | 5 707                            | 0,19                      | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                              |    |        |    |        |      |
| 4,627 % éch. 20/05/2066                                            |                                     | 362                              |                           | 481         | 0,02                                | MF1 LLC                                                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | 3,863 % éch. 25/04/2037                                            |    | 121    |    | 62     | 0,00 |
| Trinity Square PLC                                                 |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,957 % éch. 18/02/2040                                                     |                           | 20 500      |                                     | 20 513                           | 0,70                      | Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust                      |    |        |    |        |      |
| 4,647 % éch. 15/07/2059                                            |                                     | 4 160                            |                           | 5 526       | 0,19                                | 5,429 % éch. 18/02/2040                                                     |                           | 12 930      |                                     | 12 914                           | 0,44                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                            |    | 3 275  |    | 1 256  | 0,04 |
| Triton Bond Trust                                                  |                                     |                                  |                           |             |                                     | PFP Ltd.                                                                    |                           |             |                                     |                                  |                           | NovaStar Mortgage Funding Trust                                    |    |        |    |        |      |
| 5,000 % éch. 15/02/2058                                            | AUD                                 | 5 960                            |                           | 4 128       | 0,14                                | 5,137 % éch. 18/08/2043                                                     |                           | 2 200       |                                     | 2 209                            | 0,08                      | 4,023 % éch. 25/03/2037                                            |    | 16 119 |    | 10 596 | 0,36 |
| 5,250 % éch. 15/02/2058                                            |                                     | 10 000                           |                           | 6 908       | 0,24                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | Option One Mortgage Loan Trust                                     |    |        |    |        |      |
| Twin Bridges PLC                                                   |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | 3,903 % éch. 25/03/2037                                            |    | 3 727  |    | 3 377  | 0,12 |
| 5,447 % éch. 12/12/2055                                            | £                                   | 3 007                            |                           | 3 999       | 0,14                                |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |    |        |    |        |      |
| Uropa Securities PLC                                               |                                     |                                  |                           |             |                                     | Accredited Mortgage Loan Trust                                              |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,588 % éch. 25/07/2035                                            |    | 6 021  |    | 5 818  | 0,20 |
| 4,116 % éch. 10/10/2040                                            |                                     | 62                               |                           | 81          | 0,00                                | 4,783 % éch. 25/07/2035                                                     |                           | 1 763       |                                     | 1 719                            | 0,06                      | 5,338 % éch. 25/02/2035                                            |    | 105    |    | 104    | 0,00 |
| 4,216 % éch. 10/10/2040                                            |                                     | 31                               |                           | 40          | 0,00                                | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                 |                           |             |                                     |                                  |                           | 5,863 % éch. 25/09/2034                                            |    | 1 175  |    | 1 064  | 0,04 |
| Verus Securitization Trust                                         |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,738 % éch. 25/11/2033                                                     |                           | 464         |                                     | 480                              | 0,02                      | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                            |    |        |    |        |      |
| 2,338 % éch. 25/10/2063                                            | \$                                  | 1 250                            |                           | 1 188       | 0,04                                | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates      |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,258 % éch. 25/07/2036                                            |    | 1 502  |    | 1 430  | 0,05 |
| 4,199 % éch. 25/10/2063                                            |                                     | 1 000                            |                           | 886         | 0,03                                | 4,763 % éch. 25/03/2035                                                     |                           | 24          |                                     | 23                               | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/05/2036                                            |    | 235    |    | 227    | 0,01 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                      |                                     |                                  |                           |             |                                     | 5,593 % éch. 25/12/2034                                                     |                           | 763         |                                     | 683                              | 0,02                      | Renaissance Home Equity Loan Trust                                 |    |        |    |        |      |
| 3,871 % éch. 25/06/2037                                            |                                     | 2 446                            |                           | 2 178       | 0,07                                | Ameriquest Mortgage Securities Trust                                        |                           |             |                                     |                                  |                           | 5,285 % éch. 25/01/2037                                            |    | 5 079  |    | 1 478  | 0,05 |
| 4,235 % éch. 25/12/2036                                            |                                     | 1 704                            |                           | 1 588       | 0,05                                | 4,333 % éch. 25/04/2036                                                     |                           | 3 650       |                                     | 3 386                            | 0,12                      | 5,608 % éch. 25/05/2036                                            |    | 5 981  |    | 2 481  | 0,08 |
| 4,514 % éch. 25/04/2047                                            |                                     | 43                               |                           | 39          | 0,00                                | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                           |             |                                     |                                  |                           | 5,746 % éch. 25/05/2036                                            |    | 1 361  |    | 578    | 0,02 |
| 4,704 % éch. 25/09/2046                                            |                                     | 687                              |                           | 583         | 0,02                                | 4,633 % éch. 25/11/2035                                                     |                           | 2 500       |                                     | 2 397                            | 0,08                      | Residential Asset Mortgage Products Trust                          |    |        |    |        |      |
| 4,994 % éch. 25/01/2047                                            |                                     | 550                              |                           | 500         | 0,02                                | Argent Mortgage Loan Trust                                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/02/2036                                            |    | 140    |    | 134    | 0,00 |
| 5,244 % éch. 25/11/2046                                            |                                     | 270                              |                           | 238         | 0,01                                | 4,243 % éch. 25/05/2035                                                     |                           | 1 923       |                                     | 1 787                            | 0,06                      | Residential Asset Securities Corp. Trust                           |    |        |    |        |      |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust         |                                     |                                  |                           |             |                                     | Asset-Backed Funding Certificates Trust                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,198 % éch. 25/06/2036                                            |    | 799    |    | 789    | 0,03 |
| 4,734 % éch. 25/06/2046                                            |                                     | 1 778                            |                           | 1 500       | 0,05                                | 4,183 % éch. 25/09/2036                                                     |                           | 5 768       |                                     | 5 134                            | 0,18                      | 4,543 % éch. 25/06/2034                                            |    | 346    |    | 344    | 0,01 |
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                              |                                     |                                  |                           |             |                                     | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust                        |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,768 % éch. 25/05/2035                                            |    | 403    |    | 398    | 0,01 |
| 5,761 % éch. 15/09/2040                                            |                                     | 4 800                            |                           | 4 738       | 0,16                                | 3,307 % éch. 25/03/2036                                                     |                           | 1 404       |                                     | 1 293                            | 0,04                      | 4,798 % éch. 25/08/2035                                            |    | 2 131  |    | 2 077  | 0,07 |
| Worldwide Plaza Trust                                              |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,993 % éch. 25/02/2035                                                     |                           | 827         |                                     | 817                              | 0,03                      | Soundview Home Loan Trust                                          |    |        |    |        |      |
| 3,715 % éch. 10/11/2036                                            |                                     | 3 950                            |                           | 205         | 0,01                                | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                  |                           |             |                                     |                                  |                           | 3,933 % éch. 25/07/2037                                            |    | 4 330  |    | 3 797  | 0,13 |
|                                                                    |                                     |                                  |                           | 505 038     | 17,20                               | 4,813 % éch. 25/08/2037                                                     |                           | 6 563       |                                     | 5 959                            | 0,20                      | 4,663 % éch. 25/10/2037                                            |    | 5 494  |    | 4 377  | 0,15 |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                        |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,843 % éch. 25/12/2035                                                     |                           | 1 678       |                                     | 1 701                            | 0,06                      | 4,753 % éch. 25/06/2035                                            |    | 505    |    | 549    | 0,02 |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES                     |                                     |                                  |                           |             |                                     | 5,638 % éch. 25/07/2034                                                     |                           | 122         |                                     | 115                              | 0,00                      | 5,063 % éch. 25/10/2037                                            |    | 4 287  |    | 3 373  | 0,11 |
| Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-Three SARL |                                     |                                  |                           |             |                                     | CIT Mortgage Loan Trust                                                     |                           |             |                                     |                                  |                           | Structured Asset Investment Loan Trust                             |    |        |    |        |      |
| 3,585 % éch. 21/03/2034                                            | €                                   | 1 925                            |                           | 2 213       | 0,07                                | 5,513 % éch. 25/10/2037                                                     |                           | 1 727       |                                     | 1 704                            | 0,06                      | 4,363 % éch. 25/04/2036                                            |    | 9 099  |    | 4 261  | 0,15 |
| 3,885 % éch. 21/03/2034                                            |                                     | 713                              |                           | 821         | 0,03                                | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                         |                           |             |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |    |        |    |        |      |
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL                                  |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,083 % éch. 25/12/2036                                                     |                           | 2 876       |                                     | 1 608                            | 0,05                      | 4,023 % éch. 25/05/2036                                            |    | 153    |    | 152    | 0,01 |
| 2,939 % éch. 29/12/2036                                            |                                     | 1 198                            |                           | 1 372       | 0,05                                | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                           |                           |             |                                     |                                  |                           | 4,888 % éch. 25/04/2035                                            |    | 18     |    | 19     | 0,00 |
| Auto ABS Spanish Loans                                             |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,203 % éch. 25/07/2034                                                     |                           | 1 455       |                                     | 1 432                            | 0,05                      | Terwin Mortgage Trust                                              |    |        |    |        |      |
| 3,059 % éch. 28/09/2038                                            |                                     | 7 327                            |                           | 8 397       | 0,28                                | 4,203 % éch. 25/09/2037                                                     |                           | 1 187       |                                     | 1 294                            | 0,04                      | 4,708 % éch. 25/06/2036                                            |    | 149    |    | 149    | 0,01 |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,203 % éch. 25/09/2047                                                     |                           | 528         |                                     | 552                              | 0,02                      |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,263 % éch. 25/01/2046                                                     |                           | 2 750       |                                     | 2 619                            | 0,09                      |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     | 4,463 % éch. 25/03/2036                                                     |                           | 1 422       |                                     | 1 299                            | 0,04                      |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                     |                                                                             |                           |             |                                     |                                  |                           |                                                                    |    |        |    |        |      |



| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES</b>      |                                     |                                  |                           |                                                   |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                   |                                     |                                  |                           | Flexicommercial ABS Trust                         |                                     |                                  |                           | Plenti PL & Green ABS Trust     |                                     |                                  |                           |
| 3,930 % éch. 25/11/2036                               | \$ 156                              | \$ 145                           | 0,00                      | 5,550 % éch. 14/06/2031                           | AUD 8 571                           | \$ 5 954                         | 0,20                      | 5,276 % éch. 11/07/2037         | AUD 2 380                           | \$ 1 648                         | 0,06                      |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                                     |                                  |                           | FTA Santander Consumo                             |                                     |                                  |                           | 5,486 % éch. 11/04/2036         | 2 506                               | 1 738                            | 0,06                      |
| 4,183 % éch. 25/03/2037                               | 260                                 | 259                              | 0,01                      | 3,538 % éch. 20/07/2038                           | € 568                               | 651                              | 0,02                      | Providus CLO DAC                | € 2 600                             | 2 974                            | 0,10                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,888 % éch. 20/07/2038                           | 568                                 | 652                              | 0,02                      | 3,415 % éch. 20/11/2038         | 2 700                               | 3 090                            | 0,10                      |
|                                                       |                                     | <b>404</b>                       | <b>0,01</b>               | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                                  |                           | 3,513 % éch. 15/11/2039         | 1 000                               | 1 145                            | 0,04                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 2,918 % éch. 25/10/2035                           | 834                                 | 954                              | 0,03                      | 3,995 % éch. 20/11/2038         |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,095 % éch. 25/02/2034                           | 1 806                               | 2 073                            | 0,07                      | Rockford Tower Europe CLO DAC   |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                     |                                     |                                  |                           | 3,489 % éch. 29/08/2036         | 3 700                               | 4 235                            | 0,14                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,136 % éch. 20/12/2044                           | 816                                 | 935                              | 0,03                      | SLM Student Loan Trust          |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,216 % éch. 22/09/2043                           | 767                                 | 881                              | 0,03                      | 2,565 % éch. 25/10/2039         | 995                                 | 1 065                            | 0,04                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.          |                                     |                                  |                           | Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/10/2034                           | \$ 4 000                            | 4 005                            | 0,14                      | 5,960 % éch. 15/09/2038         | \$ 86                               | 86                               | 0,00                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Goodgreen Trust                                   |                                     |                                  |                           | Tikehau CLO DAC                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,930 % éch. 15/10/2053                           | 1 365                               | 1 267                            | 0,04                      | 3,404 % éch. 15/10/2038         | € 2 500                             | 2 863                            | 0,10                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Grosvenor Place CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | 3,458 % éch. 20/01/2037         | 3 000                               | 3 436                            | 0,12                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,444 % éch. 15/11/2039                           | € 2 700                             | 3 091                            | 0,11                      | 3,483 % éch. 20/04/2038         | 2 400                               | 2 748                            | 0,09                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           | 4,098 % éch. 20/04/2038         | 1 000                               | 1 145                            | 0,04                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,523 % éch. 25/07/2037 (c)                       | 2 300                               | 2 630                            | 0,09                      | Toro European CLO DAC           |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Hayfin Emerald CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | 3,474 % éch. 15/04/2037         | 4 100                               | 4 693                            | 0,16                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 22/01/2039                           | 2 900                               | 3 321                            | 0,11                      | Trinitas CLO Ltd.               |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,449 % éch. 17/11/2037                           | 3 000                               | 3 435                            | 0,12                      | 4,715 % éch. 20/07/2035         | \$ 12 900                           | 12 900                           | 0,44                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,498 % éch. 18/10/2039                           | 3 500                               | 4 005                            | 0,14                      | 4,785 % éch. 20/10/2033         | 11 541                              | 11 549                           | 0,39                      |
|                                                       |                                     |                                  |                           | ICG Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,455 % éch. 26/01/2038                           | 2 400                               | 2 747                            | 0,09                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,055 % éch. 26/01/2038                           | 1 000                               | 1 149                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 26/01/2038                           | 1 000                               | 1 149                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Indigo Credit Management DAC                      |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/07/2038                           | 3 200                               | 3 664                            | 0,12                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Invesco CLO Ltd.                                  |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/07/2035                           | \$ 2 400                            | 2 403                            | 0,08                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Invesco Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,260 % éch. 30/10/2038                           | € 2 400                             | 2 747                            | 0,09                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,277 % éch. 15/07/2037                           | 2 500                               | 2 862                            | 0,10                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Lyra Music Assets Delaware LP                     |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 5,760 % éch. 22/12/2064                           | \$ 15 537                           | 15 644                           | 0,53                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Man GLG Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 1,680 % éch. 15/12/2031                           | € 3 983                             | 4 507                            | 0,15                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Marzio Finance SRL                                |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 2,751 % éch. 28/09/2049                           | 1 618                               | 1 855                            | 0,06                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | National Collegiate Student Loan Trust            |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,073 % éch. 25/05/2032                           | \$ 195                              | 194                              | 0,01                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC       |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,414 % éch. 15/07/2039                           | € 1 600                             | 1 831                            | 0,06                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Ocean Trails CLO                                  |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,705 % éch. 20/07/2034                           | \$ 21 000                           | 21 010                           | 0,72                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,973 % éch. 15/10/2034                           | 1 000                               | 1 001                            | 0,03                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,468 % éch. 20/10/2039                           | € 1 000                             | 1 144                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,513 % éch. 15/04/2037                           | 2 400                               | 2 744                            | 0,09                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Palmer Square European Loan Funding DAC           |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,134 % éch. 15/07/2035                           | 1 944                               | 2 224                            | 0,08                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/10/2035                           | 2 900                               | 3 320                            | 0,11                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,253 % éch. 15/08/2033                           | 1 059                               | 1 212                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,273 % éch. 15/05/2034                           | 2 452                               | 2 807                            | 0,10                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,283 % éch. 15/05/2034                           | 1 451                               | 1 661                            | 0,06                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,754 % éch. 15/10/2034                           | 1 000                               | 1 143                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,933 % éch. 15/05/2033                           | 1 000                               | 1 146                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 3,983 % éch. 15/08/2033                           | 2 500                               | 2 865                            | 0,10                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,133 % éch. 15/05/2034                           | 1 000                               | 1 148                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,173 % éch. 15/05/2034                           | 1 000                               | 1 147                            | 0,04                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | Pikes Peak CLO                                    |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,883 % éch. 15/07/2034                           | \$ 10 000                           | 10 011                           | 0,34                      |                                 |                                     |                                  |                           |
|                                                       |                                     |                                  |                           | 4,895 % éch. 11/10/2034                           | 10 000                              | 10 012                           | 0,34                      |                                 |                                     |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                             | Garantie<br>(reçue) | Contrats de<br>mise<br>en pension,<br>à la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOS                                   | 3,660 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 3 300                | Billets du Trésor américain 0,375 % échéance 30/09/2027 | \$ (3 368)          | \$ 3 300                                          | \$ 3 300                                                                       | 0,11                   |
| FICC                                  | 3,620           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 2 600                   | Billets du Trésor américain 3,750 % échéance 15/05/2028 | (2 652)             | 2 600                                             | 2 600                                                                          | 0,09                   |
|                                       | 3,640           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 83 800                  | Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/07/2031 | (85 476)            | 83 800                                            | 83 808                                                                         | 2,86                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                         | \$ (91 496)         | \$ 89 700                                         | \$ 89 708                                                                      | 3,06                   |

(1) Comprend les intérêts courus.

## Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2026           | 438                | \$ (500)                          | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars                                          | Long  | 06/2027           | 1 969              | (2 796)                           | (0,09)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Court | 09/2026           | 815                | 147                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Court | 09/2026           | 1 259              | (74)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 5 335              | (1 049)                           | (0,04)              |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Court | 09/2026           | 972                | (1 309)                           | (0,05)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 88                 | (240)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 27                 | (90)                              | 0,00                |
|                                                                                               |       |                   |                    | <b>\$ (5 911)</b>                 | <b>(0,20)</b>       |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | <b>\$ (5 911)</b>                 | <b>(0,20)</b>       |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 1 770           | \$ (50)                           | 0,00                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500     | 18/03/2056      | 360               | 19                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,827     | 03/07/2028      | \$ 39 385         | (2 069)                           | (0,07)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,000     | 21/06/2033      | 3 100             | (154)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,043     | 07/08/2028      | 14 800            | (217)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 20/12/2030      | 400               | 18                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 18/03/2031      | 2 000             | 30                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 21/08/2031      | 5 100             | (219)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 17/06/2033      | 56 100            | 452                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,510     | 08/03/2033      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,525     | 13/11/2031      | 12 400            | (199)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,545     | 31/10/2030      | 400               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,547     | 31/10/2030      | 1 000             | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,550     | 31/10/2030      | 900               | 14                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,561     | 09/04/2030      | 26 900            | (410)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,572     | 31/10/2030      | 900               | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,582     | 31/10/2030      | 1 500             | 21                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,595     | 31/10/2030      | 1 100             | 15                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,601     | 31/10/2030      | 2 000             | 27                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,602     | 31/10/2030      | 2 000             | 27                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,606     | 31/10/2030      | 900               | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,623     | 31/10/2030      | 900               | 11                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,632     | 13/11/2031      | 12 400            | (158)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,632     | 16/04/2033      | 18 100            | (182)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,638     | 31/05/2028      | 800               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,655     | 31/05/2028      | 1 500             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,664     | 31/10/2030      | 500               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,677     | 31/10/2030      | 400               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,687     | 31/10/2030      | 800               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,689     | 31/10/2030      | 1 200             | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,691     | 31/10/2030      | 900               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,705     | 10/01/2031      | 1 200             | (15)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,721     | 31/10/2030      | 500               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,722     | 31/10/2030      | 500               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,724     | 20/05/2033      | 30 400            | (295)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,727     | 31/10/2030      | 500               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,732     | 31/10/2030      | 400               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,735     | 31/10/2030      | 500               | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,739     | 31/10/2030      | 500               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,740     | 10/07/2030      | 1 500             | (8)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,749     | 31/10/2030      | 500               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2026      | 42 500            | (300)                             | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2028      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/12/2028      | 52 800            | 455                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2029      | 1 800             | 44                                | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2029      | 11 000            | (56)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 20/06/2029      | 14 500            | 346                               | 0,02                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2029      | 28 400            | (560)                             | (0,02)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 17/12/2032      | 14 000            | (426)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/03/2033      | 5 610             | (97)                              | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2034      | 31 000            | (398)                             | (0,01)              |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,760     | 13/11/2031      | 12 400            | (72)                              | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,807     | 31/05/2028      | 500               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,900     | 02/06/2033      | 6 800             | (34)                              | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,916 %   | 10/06/2031      | \$ 40 900         | \$ 328                            | 0,01                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 10/04/2029      | 23 600            | 86                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 15 300            | 491                               | 0,02                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,320     | 10/10/2030      | 800               | 18                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 0,250     | 18/03/2050      | € 2 400           | 1 220                             | 0,04                |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,500     | 16/09/2031      | 22 900            | (323)                             | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,750     | 16/09/2036      | 14 300            | 15                                | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ (2 480)                        | (0,08)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ (2 480)                        | (0,08)              |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

#### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,480 %         | 14/07/2026        | 57 300                           | \$ 465 | \$ 1         | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,063           | 06/07/2026        | 26 600                           | 36     | 6            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,115           | 28/05/2027        | 78 900                           | 258    | 256          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,188           | 07/06/2027        | 64 200                           | 234    | 254          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,784           | 08/09/2026        | 8 700                            | 24     | 25           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,840           | 06/08/2026        | 15 200                           | 41     | 29           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,098           | 06/02/2035        | 6 600                            | 586    | 427          | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,098           | 06/02/2035        | 6 600                            | 586    | 594          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,245           | 20/02/2035        | 10 900                           | 940    | 743          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,245           | 20/02/2035        | 10 900                           | 940    | 927          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,260           | 13/02/2035        | 10 900                           | 952    | 751          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,260           | 13/02/2035        | 10 900                           | 952    | 926          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,265           | 01/05/2035        | 6 000                            | 531    | 419          | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,265           | 01/05/2035        | 6 000                            | 531    | 515          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,400           | 25/06/2035        | 23 000                           | 2 054  | 1 712        | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,400           | 25/06/2035        | 11 500                           | 1 039  | 958          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,427           | 06/08/2035        | 11 400                           | 1 003  | 857          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,427           | 06/08/2035        | 11 400                           | 1 003  | 938          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,470           | 04/06/2035        | 6 100                            | 547    | 467          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,470           | 04/06/2035        | 6 100                            | 547    | 495          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,640           | 23/07/2035        | 24 200                           | 2 176  | 1 994        | 0,07                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,640           | 23/07/2035        | 12 100                           | 1 088  | 939          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,693           | 27/08/2035        | 8 000                            | 689    | 666          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,693           | 27/08/2035        | 8 000                            | 689    | 605          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 04/09/2026        | 73 400                           | 57     | 38           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 19/10/2026        | 70 900                           | 117    | 98           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 23/10/2026        | 35 200                           | 71     | 53           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,786           | 06/08/2026        | 16 600                           | 47     | 21           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,400           | 19/05/2027        | 13 900                           | 79     | 132          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,166           | 06/08/2026        | 11 000                           | 77     | 19           | 0,00                |
| BPS<br>CBK   | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,135           | 14/09/2026        | 18 800                           | 242    | 4            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,635           | 14/09/2026        | 18 800                           | 242    | 397          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,111           | 28/05/2027        | 109 200                          | 359    | 351          | 0,01                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,114           | 28/05/2027        | 168 000                          | 552    | 544          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,158           | 01/06/2027        | 96 900                           | 337    | 349          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,161           | 01/06/2027        | 96 900                           | 337    | 351          | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,308           | 02/05/2035        | 6 600                            | 587    | 470          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,308           | 02/05/2035        | 6 600                            | 587    | 560          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,440           | 18/06/2035        | 9 500                            | 850    | 719          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,440           | 18/06/2035        | 9 500                            | 850    | 778          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,460           | 06/08/2035        | 16 800                           | 1 477  | 1 279        | 0,04                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,460           | 06/08/2035        | 16 800                           | 1 477  | 1 368        | 0,05                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,520           | 29/05/2035        | 6 700                            | 603    | 524          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,520           | 29/05/2035        | 6 700                            | 603    | 535          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,559           | 09/07/2035        | 22 600                           | 2 007  | 1 793        | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,559           | 09/07/2035        | 11 300                           | 1 003  | 893          | 0,03                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,630           | 22/05/2035        | 6 700                            | 613    | 550          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,630           | 22/05/2035        | 6 700                            | 613    | 520          | 0,02                |
| FAR          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 09/10/2026        | 90 800                           | 218    | 110          | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,324           | 06/07/2026        | 35 600                           | 254    | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 2,500           | 26/07/2027        | 150 600                          | 331    | 209          | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,073           | 07/03/2035        | 9 500                            | 826    | 605          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,073           | 07/03/2035        | 9 500                            | 827    | 860          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,400           | 19/05/2027        | 20 000                           | 107    | 190          | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,206           | 04/09/2026        | 13 100                           | 54     | 37           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,216           | 06/08/2026        | 14 500                           | 106    | 19           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,216           | 04/09/2026        | 7 300                            | 30     | 20           | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,663 %         | 04/09/2026        | 9 600                            | \$ 17     | \$ 14        | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,310           | 24/04/2035        | 6 500                            | 575       | 462          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,310           | 24/04/2035        | 6 500                            | 575       | 550          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,430           | 16/05/2035        | 6 600                            | 591       | 496          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,430           | 16/05/2035        | 6 600                            | 591       | 541          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,516           | 19/08/2026        | 10 600                           | 67        | 8            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,525           | 06/08/2026        | 87 500                           | 473       | 37           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 07/12/2026        | 52 900                           | 197       | 134          | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,285           | 07/05/2035        | 6 700                            | 602       | 475          | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,285           | 07/05/2035        | 6 700                            | 602       | 575          | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,458           | 01/08/2035        | 22 500                           | 1 962     | 1 707        | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,458           | 01/08/2035        | 22 500                           | 1 962     | 1 828        | 0,06                |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,693           | 27/08/2035        | 10 000                           | 861       | 832          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,693           | 27/08/2035        | 10 000                           | 861       | 756          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,230           | 04/09/2026        | 4 500                            | 14        | 11           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,819           | 06/08/2026        | 27 300                           | 74        | 45           | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,485           | 07/08/2035        | 10 600                           | 934       | 816          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,485           | 07/08/2035        | 10 600                           | 934       | 857          | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 02/11/2026        | 8 600                            | 28        | 15           | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 07/12/2026        | 35 500                           | 95        | 90           | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 46 466 | \$ 40 149    | 1,37                |

### OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable       | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| DUB          | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,033 %         | 26/01/2027        | 255 000                          | \$ 3 060 | \$ 39        | 0,00                |

### OPTIONS VENDUES

### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,780 %         | 14/07/2026        | 61 300                           | \$ (466) | \$ (640)     | (0,02)              |
| FAR          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,624           | 06/07/2026        | 37 400                           | (254)    | (484)        | (0,02)              |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,550           | 01/07/2026        | 12 900                           | (28)     | 0            | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (748) | \$ (1 124)   | (0,04)              |

### OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable       | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime      | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| DUB          | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,021 %         | 26/01/2027        | 255 000                          | \$ (1 158) | \$ (8)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,027           | 26/01/2027        | 255 000                          | (1 887)    | (16)         | 0,00                |
|              |                                                             |                               |                 |                   |                                  | \$ (3 045) | \$ (24)      | 0,00                |

### OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                        | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Montant<br>notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |        |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------------------------|---------|-----------------|------------------------|--------|
| BOA          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | \$ 95,422          | 06/08/2026           | 6 000                               | \$ (12) | \$ (4)          | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,000 % éch. 01/09/2056  | 99,422             | 08/09/2026           | 13 000                              | (24)    | (26)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056 | 100,625            | 06/08/2026           | 25 000                              | (104)   | (12)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 101,031            | 04/09/2026           | 27 000                              | (55)    | (49)            | 0,00                   |        |
| GSC          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/07/2056  | 93,969             | 06/07/2026           | 35 500                              | (72)    | (16)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 89,641             | 06/08/2026           | 65 500                              | (343)   | (27)            | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 94,906             | 06/08/2026           | 3 500                               | (11)    | (4)             | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 95,188             | 06/08/2026           | 20 000                              | (41)    | (18)            | 0,00                   |        |
| JPM          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 95,383             | 06/08/2026           | 30 000                              | (62)    | (21)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 89,641             | 06/08/2026           | 4 500                               | (24)    | (2)             | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 95,531             | 06/08/2026           | 10 500                              | (24)    | (6)             | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 5,000 % éch. 01/09/2056  | 100,188            | 04/09/2026           | 14 000                              | (16)    | (11)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056 | 101,469            | 06/08/2026           | 11 000                              | (13)    | (15)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 101,000            | 04/09/2026           | 36 500                              | (61)    | (65)            | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056  | 101,469            | 08/09/2026           | 29 500                              | (115)   | (145)           | (0,01)                 |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 101,469            | 08/09/2026           | 29 500                              | (115)   | (85)            | (0,01)                 |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,500 % éch. 01/08/2056  | 103,344            | 06/08/2026           | 15 000                              | (25)    | (18)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,500 % éch. 01/08/2056 | 103,344            | 06/08/2026           | 15 000                              | (25)    | (19)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/07/2056 | 92,891             | 06/07/2026           | 37 500                              | (148)   | (18)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056 | 101,000            | 06/08/2026           | 27 000                              | (94)    | (20)            | 0,00                   |        |
| SAL          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 89,641             | 06/08/2026           | 22 000                              | (115)   | (9)             | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 94,922             | 06/08/2026           | 3 000                               | (8)     | (4)             | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 95,516             | 06/08/2026           | 10 500                              | (24)    | (6)             | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/07/2056 | 101,852            | 06/07/2026           | 26 000                              | (56)    | (3)             | 0,00                   |        |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056  | 101,848            | 06/08/2026           | 6 500                               | (21)    | (16)            | 0,00                   |        |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056 | 101,848            | 06/08/2026           | 6 500                               | (21)    | (16)            | 0,00                   |        |
|              |                                                                                                                    |                    |                      | \$                                  | (1 629) | \$              | (635)                  | (0,02) |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 19 842 \$         | 14 189 \$          | 442 \$                | 442 \$                                  | 0,01                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 27 281            | 19 070             | 205                   | 170                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 1 942             | 2 215              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 6 881             | 9 200              | 67                    | 67                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 022             | 892                | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 072             | 813                | 7                     | 7                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | €               | 724               | 844                | 17                    | 17                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 825             | 2 582              | 0                     | (36)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | £               | 100 741           | 135 359            | 1 650                 | 1 650                                   | 0,05                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 84 581            | 60 296             | 1 698                 | 1 698                                   | 0,06                |
| MBC          | 07/2026           |                 | 10 857            | 7 491              | 8                     | (31)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 12 763            | 14 827             | 235                   | 235                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | £               | 830               | 1 112              | 10                    | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 53 323            | 77 279             | 216                   | 216                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 862               | 752                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | AUD             | 77 279            | 53 289             | 0                     | (218)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 1 457             | 1 277              | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 201               | 152                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | €               | 229 204           | 267 376            | 5 327                 | 5 327                                   | 0,18                |
|              | 07/2026           | \$              | 43 263            | 62 700             | 176                   | 176                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           |                 | 272 750           | 239 780            | 1 391                 | 1 391                                   | 0,05                |
|              | 08/2026           | AUD             | 62 700            | 43 235             | 0                     | (178)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | €               | 239 780           | 273 120            | 0                     | (1 388)                                 | (0,05)              |
| SSB          | 07/2026           | \$              | 142 284           | 107 639            | 580                   | 580                                     | 0,02                |
|              | 08/2026           | €               | 1 942             | 2 217              | 0                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £               | 107 639           | 142 281            | 0                     | (580)                                   | (0,02)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 12 032          | \$ (2 491)            | \$ 9 541                                | 0,32                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD             | 8 789 \$          | 6 183 \$           | 0 \$                  | (12) \$                                 | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 6 183             | 8 776              | 12                    | 12                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 10 822            | 14 973             | 0                     | (268)                                   | (0,01)              |
| BRC          | 07/2026           |                 | 332               | 458                | 0                     | (9)                                     | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CAD             | 15 423 \$         | 10 839             | 0                     | (32)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 10 839            | 15 402             | 32                    | 32                                      | 0,00                |
| MBC          | 08/2026           |                 | 846               | 1 199              | 1                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           |                 | 11 445            | 15 801             | 0                     | (308)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 11 231            | 15 933             | 15                    | 15                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 5 198 \$          | 3 667              | 3                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 11 419            | 15 746             | 0                     | (320)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 3 667             | 5 191              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 63              | \$ (952)              | \$ (889)                                | (0,03)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 07/2026           | \$              | 1 037             | 811                | 0                     | (32)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           |                 | 1 133             | 888                | 0                     | (33)                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CHF             | 879               | 1 087              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 087             | 876                | 3                     | 3                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           |                 | 1 113             | 875                | 0                     | (29)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 3               | \$ (97)               | \$ (94)                                 | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | €               | 186               | 217                | 4                     | 4                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 994               | 1 129              | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 309 878           | 266 165            | 19                    | (5 572)                                 | (0,19)              |
| CBK          | 07/2026           |                 | 838               | 719                | 0                     | (17)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | €               | 245 440           | 279 924            | 0                     | (688)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$              | 280 301           | 245 440            | 686                   | 686                                     | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | €               | 262 465           | 298 150            | 25                    | (1 952)                                 | (0,07)              |
|              | 07/2026           | \$              | 8 945             | 7 693              | 0                     | (149)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 295 979           | 260 240            | 1 953                 | 1 953                                   | 0,07                |



## Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SCX          | 07/2026           | \$ 276 558      | € 237 710         | \$ 0               | \$ (4 784)            | \$ (4 784)                              | (0,16)              |
| SOG          | 07/2026           | € 260 240       | \$ 296 023        | 0                  | (1 509)               | (1 509)                                 | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 299 846      | € 257 039         | 0                  | (5 974)               | (5 974)                                 | (0,20)              |
|              | 08/2026           | 296 424         | 260 240           | 1 506              | 0                     | 1 506                                   | 0,05                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 193           | \$ (20 672)           | \$ (16 479)                             | (0,56)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$ 15 666       | £ 11 669          | \$ 0               | \$ (178)              | \$ (178)                                | (0,01)              |
| BPS                                                | 07/2026           | £ 11 245        | \$ 14 830         | 0                  | (95)                  | (95)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 19 356       | £ 14 467          | 12                 | (167)                 | (155)                                   | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | 15 172          | 11 504            | 96                 | 0                     | 96                                      | 0,01                |
| CBK                                                | 07/2026           | £ 111           | \$ 148            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | \$ 850          | £ 632             | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           | 17 516          | 13 054            | 0                  | (191)                 | (191)                                   | (0,01)              |
| MBC                                                | 07/2026           | £ 18            | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 504          | £ 376             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £ 2 321         | \$ 3 054          | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 3 054        | £ 2 321           | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | £ 12 648        | \$ 16 741         | 0                  | (46)                  | (46)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 182          | £ 136             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 16 740          | 12 648            | 46                 | 0                     | 46                                      | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | £ 12 573        | \$ 16 609         | 0                  | (79)                  | (79)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 16 609       | £ 12 573          | 79                 | 0                     | 79                                      | 0,00                |
| SSB                                                | 07/2026           | £ 1 418         | \$ 1 875          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 1 875        | £ 1 418           | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 269             | \$ (808)              | \$ (539)                                | (0,02)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 29 945                               | 1,02                |

### TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                               |                            |                     |
| 3,000 % éch. 01/07/2056                                        | \$ 10 600                     | \$ (9 409)                 | (0,32)              |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 99 000                        | (87 816)                   | (2,99)              |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 2,000 % éch. 01/07/2041                                        | 14 800                        | (13 484)                   | (0,46)              |
| 2,500 % éch. 01/07/2056                                        | 3 700                         | (3 092)                    | (0,11)              |
| 2,500 % éch. 01/08/2056                                        | 115 000                       | (96 070)                   | (3,27)              |
| 3,000 % éch. 01/07/2041                                        | 500                           | (473)                      | (0,02)              |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 193 650                       | (168 778)                  | (5,75)              |
| 3,500 % éch. 01/07/2056                                        | 19 500                        | (17 695)                   | (0,60)              |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                        | 5 000                         | (4 533)                    | (0,16)              |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 (f)                                    | 165 500                       | (154 703)                  | (5,27)              |
| 4,500 % éch. 01/08/2056                                        | 55 950                        | (53 557)                   | (1,82)              |
| 5,500 % éch. 01/08/2056 (f)                                    | 3 250                         | (3 256)                    | (0,11)              |
| 5,500 % éch. 01/09/2056                                        | 26 750                        | (26 779)                   | (0,91)              |
| 6,500 % éch. 01/08/2056                                        | 18 000                        | (18 600)                   | (0,63)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | \$ (658 245)               | (22,42)             |
| Total des Investissements                                      |                               | \$ 4 956 406               | 168,81              |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | \$ (2 020 269)             | (68,81)             |
| Actif net                                                      |                               | \$ 2 936 137               | 100,00              |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à principal uniquement.

(c) Titre vendu avant l'émission.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 805 545 \$ (31 décembre 2025 : 597 359 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.



Des titres d'une juste valeur globale de 385 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 5 293 \$ (31 décembre 2025 : 3 774 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 24 756 \$ (31 décembre 2025 : 23 109 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 14 670 \$ (31 décembre 2025 : 6 170 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 5 392 965                                         | \$ 110 427                                        | \$ 5 503 392        |
| Fonds d'investissement                        | 5                                                                                 | 0                                                    | 0                                                 | 5                   |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 89 700                                               | 0                                                 | 89 700              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 21 554                                               | 0                                                 | 21 554              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (658 245)                                            | 0                                                 | (658 245)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 5</b>                                                                       | <b>\$ 4 845 974</b>                                  | <b>\$ 110 427</b>                                 | <b>\$ 4 956 406</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 5 129 554                                         | \$ 106 552                                        | \$ 5 236 106        |
| Fonds d'investissement                        | 5                                                                                 | 0                                                    | 0                                                 | 5                   |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 5 600                                                | 0                                                 | 5 600               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 0                                                                                 | 49 120                                               | 0                                                 | 49 120              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (507 487)                                            | 0                                                 | (507 487)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 5</b>                                                                       | <b>\$ 4 676 787</b>                                  | <b>\$ 106 552</b>                                 | <b>\$ 4 783 344</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,760 %        | 16/06/2026        | 13/07/2026      | \$ (81 036)      | \$ (81 163)                              | (2,76)              |
|                                               | 3,770          | 10/06/2026        | 13/07/2026      | (6 014)          | (6 028)                                  | (0,21)              |
| SBI                                           | 3,740          | 11/06/2026        | 13/07/2026      | (491 524)        | (492 545)                                | (16,78)             |
| WFS                                           | 3,740          | 11/06/2026        | 13/07/2026      | (196 428)        | (196 836)                                | (6,70)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (776 572)</b>                      | <b>(26,45)</b>      |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 264                                                     | \$ (260)                | \$ 4                              | \$ 312                                                     | \$ (260)                | \$ 52                             |
| BOA          | 14 966                                                     | 1 580                   | 16 546                            | 15 048                                                     | 1 710                   | 16 758                            |
| BPS          | (5 746)                                                    | 6 000                   | 254                               | (229)                                                      | 270                     | 41                                |
| BRC          | (9)                                                        | 0                       | (9)                               | 3 838                                                      | (4 270)                 | (432)                             |
| CBK          | 117                                                        | (250)                   | (133)                             | 385                                                        | (270)                   | 115                               |
| DUB          | 12 110                                                     | (1 130)                 | 10 980                            | 10 554                                                     | 580                     | 11 134                            |
| FAR          | 2 827                                                      | (1 500)                 | 1 327                             | 1 042                                                      | 670                     | 1 712                             |
| GLM          | 2 508                                                      | (240)                   | 2 268                             | 2 140                                                      | 0                       | 2 140                             |
| GSC          | (86)                                                       | 0                       | (86)                              | (99)                                                       | 0                       | (99)                              |
| JPM          | 7 282                                                      | 500                     | 7 782                             | 6 270                                                      | 490                     | 6 760                             |
| MBC          | 50                                                         | 0                       | 50                                | 4 152                                                      | (4 500)                 | (348)                             |
| MSC          | (38)                                                       | 0                       | (38)                              | (6)                                                        | 0                       | (6)                               |
| MYC          | 1 834                                                      | (40)                    | 1 794                             | 1 874                                                      | (240)                   | 1 634                             |
| MYI          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SAL          | (54)                                                       | 60                      | 6                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | (4 786)                                                    | 5 120                   | 334                               | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |
| SOG          | (942)                                                      | 1 110                   | 168                               | (2 160)                                                    | 2 450                   | 290                               |
| SSB          | (355)                                                      | 300                     | (55)                              | 28                                                         | (10)                    | 18                                |
| UAG          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 3                                                          | 0                       | 3                                 |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 0,95             | 1,04                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 61,01            | 50,58                |
| Fonds d'investissement                                           | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 1,01             | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,00             | 0,07                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,04             | 0,05                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,64             | 0,51                 |
| Autres actifs                                                    | 36,35            | 47,69                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                       | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                         | 0,02             | 0,02                 |
| Obligations et billets privés                                                           | 0,79             | 0,94                 |
| Obligations et billets municipaux                                                       | 0,05             | 0,06                 |
| Agences du gouvernement américain                                                       | 147,12           | 161,61               |
| Obligations du Trésor américain                                                         | 0,12             | 0,14                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 17,20            | 17,52                |
| Titres adossés à des actifs                                                             | 22,13            | 24,25                |
| Fonds d'investissement                                                                  | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de mise en pension                                                             | 3,06             | 0,22                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                        |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                           | (0,20)           | 0,25                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                 | (0,08)           | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                |                  |                      |
| Options achetées                                                                        |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                             | 1,37             | 1,47                 |
| Options à taux d'intérêt plafonnées                                                     | 0,00             | 0,01                 |
| Options sur titres                                                                      | S/O              | 0,00                 |
| Options vendues                                                                         |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                             | (0,04)           | (0,01)               |
| Options à taux d'intérêt plafonnées                                                     | 0,00             | (0,01)               |
| Options sur titres                                                                      | (0,02)           | (0,01)               |
| Contrats de change à terme                                                              | 0,32             | (0,30)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                     | (0,61)           | 0,54                 |
| Titres vendus à découvert                                                               | (22,42)          | (19,82)              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                  | (68,81)          | (86,86)              |
| Actif net                                                                               | 100,00           | 100,00               |

847

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund (suite)

| DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS       | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|---------------|----------------------------------|---------------------------|
| 0,125 % éch. 22/03/2046 (b)                  | £ 2 123                             | \$ 1 839                         | 0,70                      | <b>SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER</b> |         |                                  |                           | NNN REIT, Inc.                           | 1 515         | \$ 71                            | 0,03                      |
| 0,125 % éch. 10/08/2048 (b)                  | 528                                 | 433                              | 0,16                      | Acadia Realty Trust                         | 1 054   | \$ 22                            | 0,01                      | Omega Healthcare Investors, Inc.         | 2 388         | 114                              | 0,04                      |
| 0,625 % éch. 22/03/2040 (b)                  | 287                                 | 315                              | 0,12                      | Agree Realty Corp.                          | 698     | 53                               | 0,02                      | Park Hotels & Resorts, Inc.              | 1 479         | 21                               | 0,01                      |
| 0,625 % éch. 22/11/2042 (b)                  | 2 340                               | 2 440                            | 0,92                      | American Assets Trust, Inc.                 | 831     | 21                               | 0,01                      | Pebblebrook Hotel Trust                  | 1 819         | 35                               | 0,01                      |
| 0,750 % éch. 22/11/2047 (b)                  | 499                                 | 487                              | 0,18                      | American Healthcare REIT, Inc.              | 1 895   | 99                               | 0,04                      | Phillips Edison & Co., Inc.              | 510           | 21                               | 0,01                      |
| 1,250 % éch. 22/11/2027 (b)                  | 2 263                               | 3 037                            | 1,15                      | American Homes 4 Rent « A »                 | 3 061   | 103                              | 0,04                      | Piedmont Realty Trust, Inc.              | 992           | 9                                | 0,00                      |
| 1,875 % éch. 22/09/2049 (b)                  | 2 854                               | 3 486                            | 1,32                      | Apple Hospitality REIT, Inc.                | 1 779   | 30                               | 0,01                      | Prologis, Inc.                           | 8 506         | 1 152                            | 0,44                      |
| 4,000 % éch. 22/10/2031                      | 6 200                               | 8 098                            | 3,07                      | AvalonBay Communities, Inc.                 | 1 258   | 237                              | 0,09                      | Public Storage                           | 1 308         | 416                              | 0,16                      |
|                                              |                                     | <b>100 461</b>                   | <b>38,06</b>              | Brixmor Property Group, Inc.                | 2 456   | 77                               | 0,03                      | Realty Income Corp.                      | 6 583         | 408                              | 0,15                      |
| <b>ACTIONS</b>                               |                                     |                                  |                           | Broadstone Net Lease, Inc.                  | 2 523   | 52                               | 0,02                      | Regency Centers Corp.                    | 1 190         | 95                               | 0,04                      |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                    |                                     |                                  |                           | BXP, Inc.                                   | 1 444   | 96                               | 0,04                      | RLJ Lodging Trust                        | 990           | 12                               | 0,00                      |
| <b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>             |                                     |                                  |                           | Camden Property Trust                       | 847     | 97                               | 0,04                      | Ryman Hospitality Properties, Inc.       | 667           | 86                               | 0,03                      |
| Roku, Inc. (a)                               | 400                                 | 55                               | 0,02                      | CareTrust REIT, Inc.                        | 977     | 39                               | 0,01                      | Sabra Health Care REIT, Inc.             | 2 609         | 51                               | 0,02                      |
| Warner Bros Discovery, Inc. (a)              | 2 100                               | 56                               | 0,02                      | CBL & Associates Properties, Inc.           | 108     | 6                                | 0,00                      | Safehold, Inc.                           | 448           | 7                                | 0,00                      |
|                                              |                                     | <b>111</b>                       | <b>0,04</b>               | COPT Defense Properties                     | 440     | 16                               | 0,01                      | Simon Property Group, Inc.               | 2 613         | 584                              | 0,22                      |
| <b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b> |                                     |                                  |                           | Cousins Properties, Inc.                    | 799     | 24                               | 0,01                      | SL Green Realty Corp.                    | 787           | 41                               | 0,01                      |
| Caesars Entertainment, Inc. (a)              | 1 600                               | 48                               | 0,02                      | CubeSmart                                   | 2 067   | 82                               | 0,03                      | Summit Hotel Properties, Inc.            | 2 263         | 16                               | 0,01                      |
| <b>BIENS DE CONSOMMATION COURANTE</b>        |                                     |                                  |                           | Curbline Properties Corp.                   | 604     | 18                               | 0,01                      | Sun Communities, Inc.                    | 361           | 43                               | 0,02                      |
| Aeon Co. Ltd.                                | 408                                 | 3                                | 0,00                      | DiamondRock Hospitality Co.                 | 2 775   | 34                               | 0,01                      | Sunstone Hotel Investors, Inc.           | 2 612         | 30                               | 0,01                      |
| Kenvue, Inc.                                 | 1 400                               | 27                               | 0,01                      | Digital Realty Trust, Inc.                  | 3 004   | 539                              | 0,20                      | Tanger, Inc.                             | 495           | 20                               | 0,01                      |
|                                              |                                     | <b>30</b>                        | <b>0,01</b>               | Diversified Healthcare Trust                | 17 727  | 165                              | 0,06                      | Terreno Realty Corp.                     | 494           | 32                               | 0,01                      |
| <b>SERVICES FINANCIERS</b>                   |                                     |                                  |                           | EastGroup Properties, Inc.                  | 325     | 66                               | 0,02                      | UDR, Inc.                                | 3 466         | 138                              | 0,05                      |
| Webster Financial Corp.                      | 700                                 | 53                               | 0,02                      | EPR Properties                              | 246     | 14                               | 0,01                      | Urban Edge Properties                    | 986           | 23                               | 0,01                      |
| <b>SOINS DE SANTÉ</b>                        |                                     |                                  |                           | Equinix, Inc.                               | 843     | 879                              | 0,33                      | Ventas, Inc.                             | 3 789         | 336                              | 0,13                      |
| Apogee Therapeutics, Inc. (a)                | 200                                 | 27                               | 0,01                      | Equity LifeStyle Properties, Inc.           | 447     | 29                               | 0,01                      | VICI Properties, Inc.                    | 8 755         | 232                              | 0,09                      |
| Nuvalent, Inc. (a)                           | 500                                 | 62                               | 0,03                      | Equity Residential                          | 3 363   | 228                              | 0,09                      | Vornado Realty Trust                     | 2 015         | 79                               | 0,03                      |
| Organon & Co.                                | 2 400                               | 32                               | 0,01                      | Essex Property Trust, Inc.                  | 587     | 171                              | 0,06                      | Welltower, Inc.                          | 5 760         | 1 307                            | 0,49                      |
|                                              |                                     | <b>121</b>                       | <b>0,05</b>               | Extra Space Storage, Inc.                   | 1 416   | 206                              | 0,08                      | WP Carey, Inc.                           | 1 539         | 110                              | 0,04                      |
| <b>INDUSTRIE</b>                             |                                     |                                  |                           | Federal Realty Investment Trust             | 854     | 105                              | 0,04                      | Xenia Hotels & Resorts, Inc.             | 759           | 15                               | 0,01                      |
| Norfolk Southern Corp.                       | 100                                 | 32                               | 0,01                      | First Industrial Realty Trust, Inc.         | 1 022   | 63                               | 0,02                      |                                          | <b>10 741</b> | <b>4,07</b>                      |                           |
| Qube Holdings Ltd.                           | 7 378                               | 26                               | 0,01                      | Gaming and Leisure Properties, Inc.         | 2 190   | 98                               | 0,04                      | <b>Total des Valeurs mobilières</b>      |               | <b>\$ 315 350</b>                | <b>119,47</b>             |
|                                              |                                     | <b>58</b>                        | <b>0,02</b>               | Global Net Lease, Inc.                      | 1 562   | 14                               | 0,01                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |               |                                  |                           |
| <b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>         |                                     |                                  |                           | Healthcare Realty Trust, Inc.               | 2 647   | 53                               | 0,02                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |               |                                  |                           |
| Qorvo, Inc. (a)                              | 300                                 | 28                               | 0,01                      | Healthpeak Properties, Inc.                 | 7 567   | 162                              | 0,06                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO     |               |                                  |                           |
| Silicon Laboratories, Inc. (a)               | 100                                 | 22                               | 0,01                      | Highwoods Properties, Inc.                  | 321     | 10                               | 0,00                      | US Dollar Short-Term Floating NAV        | 11 075        | 110                              | 0,04                      |
|                                              |                                     | <b>50</b>                        | <b>0,02</b>               | Host Hotels & Resorts, Inc.                 | 10 035  | 238                              | 0,09                      | Fund (d)                                 |               |                                  |                           |
| <b>MATÉRIAUX</b>                             |                                     |                                  |                           | Hudson Pacific Properties, Inc.             | 1 472   | 22                               | 0,01                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |               |                                  |                           |
| Allied Gold Corp. (a)                        | 532                                 | 13                               | 0,00                      | Independence Realty Trust, Inc.             | 1 907   | 32                               | 0,01                      | Invesco Physical Gold ETC                | 17 297        | 6 707                            | 2,54                      |
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>            |                                     |                                  |                           | Innovative Industrial Properties, Inc.      | 222     | 14                               | 0,01                      | iShares Physical Gold ETC                | 214 176       | 16 745                           | 6,35                      |
| AES Corp.                                    | 4 100                               | 60                               | 0,02                      | InvenTrust Properties Corp.                 | 623     | 22                               | 0,01                      |                                          |               | <b>23 452</b>                    | <b>8,89</b>               |
| Dominion Energy, Inc.                        | 900                                 | 62                               | 0,03                      | Invitation Homes, Inc.                      | 5 279   | 159                              | 0,06                      | <b>Total des Fonds d'investissement</b>  |               | <b>\$ 23 562</b>                 | <b>8,93</b>               |
|                                              |                                     | <b>122</b>                       | <b>0,05</b>               | Iron Mountain, Inc.                         | 2 366   | 299                              | 0,11                      |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     | <b>606</b>                       | <b>0,23</b>               | Janus Living, Inc. « A »                    | 1 697   | 49                               | 0,02                      |                                          |               |                                  |                           |
| <b>TITRES PRIVILÉGIÉS</b>                    |                                     |                                  |                           | Kilroy Realty Corp.                         | 1 264   | 47                               | 0,02                      |                                          |               |                                  |                           |
| Nationwide Building Society                  |                                     |                                  |                           | Kimco Realty Corp.                          | 5 550   | 141                              | 0,05                      |                                          |               |                                  |                           |
| 10,250 %                                     | 813                                 | 139                              | 0,05                      | Kite Realty Group Trust                     | 1 923   | 55                               | 0,02                      |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     |                                  |                           | Lineage, Inc.                               | 570     | 25                               | 0,01                      |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     |                                  |                           | LTC Properties, Inc.                        | 377     | 15                               | 0,01                      |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     |                                  |                           | Macerich Co.                                | 2 206   | 56                               | 0,02                      |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     |                                  |                           | Mid-America Apartment                       |         |                                  |                           |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     |                                  |                           | Communities, Inc.                           | 936     | 130                              | 0,05                      |                                          |               |                                  |                           |
|                                              |                                     |                                  |                           | National Storage Affiliates Trust           | 568     | 25                               | 0,01                      |                                          |               |                                  |                           |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                             | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                | Long  | 03/2027              | 210                   | \$ (12)                                 | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre   | Long  | 09/2026              | 204                   | 77                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre                 | Long  | 09/2026              | 8                     | 40                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Euro STOXX 50 septembre                        | Long  | 09/2026              | 43                    | 59                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                   | Court | 09/2026              | 248                   | (145)                                   | (0,05)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre | Long  | 09/2026              | 93                    | 111                                     | 0,04                   |

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente |       | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|-------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026           | 225                | \$                                      | 216   | 0,08                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                         | Court | 09/2026           | 8                  |                                         | (21)  | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 182                |                                         | (96)  | (0,04)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                           | Long  | 09/2026           | 128                |                                         | 12    | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index septembre                                 | Long  | 09/2026           | 6                  |                                         | 4     | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre          | Court | 09/2026           | 12                 |                                         | (24)  | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 186                |                                         | 24    | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 208                |                                         | (8)   | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 139                |                                         | 7     | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 173                |                                         | 135   | 0,05                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Court | 09/2026           | 170                |                                         | (440) | (0,17)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Long  | 09/2026           | 103                |                                         | 348   | 0,13                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre                | Long  | 09/2026           | 70                 |                                         | 60    | 0,02                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$                                      | 347   | 0,13                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                        |       |                   |                    | \$                                      | 347   | 0,13                |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente |       | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|-------|---------------------|
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 1,500 %   | 15/06/2052      | £ 1 900           | \$                                      | 51    | 0,02                |
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2028      | 9 500             |                                         | 82    | 0,03                |
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 19/03/2030      | 4 200             |                                         | (64)  | (0,03)              |
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2031      | 9 760             |                                         | (47)  | (0,02)              |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031      | 3 900             |                                         | (23)  | (0,01)              |
| À recevoir                                         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 16/06/2031      | ¥ 50 000          |                                         | 0     | 0,00                |
| À recevoir                                         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450     | 20/03/2029      | 154 390           |                                         | (2)   | 0,00                |
| À recevoir                                         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500     | 15/12/2031      | 77 000            |                                         | 3     | 0,00                |
| À recevoir                                         | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,550     | 14/09/2028      | 270 000           |                                         | (3)   | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,237     | 21/11/2053      | \$ 1 730          |                                         | 529   | 0,20                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 2,865     | 13/02/2054      | 12 700            |                                         | 2 272 | 0,87                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,085     | 13/02/2034      | 6 100             |                                         | (303) | (0,12)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2035      | 4 700             |                                         | (68)  | (0,03)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 19 590            |                                         | 349   | 0,13                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 4 300             |                                         | 227   | 0,08                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 1 603             |                                         | 16    | 0,01                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,997     | 30/11/2030      | 3 800             |                                         | 12    | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,998     | 15/11/2053      | 100               |                                         | 4     | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 7 330             |                                         | (23)  | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 19 600            |                                         | 95    | 0,04                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,010     | 15/11/2053      | 1 300             |                                         | 24    | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,015     | 15/11/2053      | 100               |                                         | 3     | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,020     | 30/11/2030      | 4 330             |                                         | 17    | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,075     | 15/11/2053      | 1 168             |                                         | 16    | 0,01                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,190     | 04/11/2052      | € 200             |                                         | 109   | 0,04                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,195     | 04/11/2052      | 200               |                                         | 122   | 0,05                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,197     | 08/11/2052      | 400               |                                         | 218   | 0,08                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,112     | 02/09/2027      | 3 500             |                                         | (16)  | (0,01)              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | 14 400            |                                         | 148   | 0,06                |
| À payer <sup>(1)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 13 060            |                                         | 14    | 0,01                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,879     | 15/08/2032      | 8 400             |                                         | 230   | 0,09                |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 6 930             |                                         | 16    | 0,01                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,050     | 13/01/2056      | 2 210             |                                         | (94)  | (0,04)              |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                           | 2,000     | 15/02/2027      | 3 100             |                                         | 24    | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                           | 2,034     | 15/09/2034      | 800               |                                         | 5     | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPTFEMU                           | 2,470     | 15/07/2032      | 1 100             |                                         | 17    | 0,01                |
| À payer                                            | CPTFEMU                           | 2,590     | 15/12/2052      | 500               |                                         | 43    | 0,02                |
| À payer                                            | CPTFEMU                           | 2,680     | 15/04/2053      | 700               |                                         | 87    | 0,03                |
| À payer                                            | CPURNSA                           | 1,280     | 19/05/2030      | \$ 600            |                                         | (61)  | (0,02)              |
| À payer                                            | CPURNSA                           | 1,954     | 03/06/2029      | 750               |                                         | (81)  | (0,03)              |
| À payer                                            | CPURNSA                           | 2,165     | 16/04/2029      | 500               |                                         | (55)  | (0,02)              |
| À payer                                            | CPURNSA                           | 2,379     | 09/07/2028      | 300               |                                         | (34)  | (0,01)              |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni                   | 3,365     | 15/09/2027      | £ 6 000           |                                         | (8)   | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni                   | 3,480     | 15/01/2030      | 800               |                                         | (183) | (0,07)              |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni                   | 4,040     | 15/04/2029      | 1 000             |                                         | 28    | 0,01                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni                   | 4,288     | 15/02/2032      | 1 530             |                                         | 65    | 0,02                |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni                   | 4,530     | 15/04/2028      | 4 600             |                                         | (98)  | (0,04)              |
| À recevoir                                         | IPC Royaume-Uni                   | 4,615     | 15/02/2027      | 1 100             |                                         | 72    | 0,03                |
|                                                    |                                   |           |                 | \$                | 3 735                                   | 1,42  |                     |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 | \$                | 3 735                                   | 1,42  |                     |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description                      | Indice initial | Taux variable                                                 | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM          | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 78,177      | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035        | 300                              | \$ (14) | \$ (6)       | 0,00                |

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| SOG          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote  | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,000 %         | 27/08/2026        | 4 800                            | \$ (27) | \$ (23)      | (0,01)              |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À payer                          | 4,500           | 27/08/2026        | 4 800                            | (28)    | (7)          | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (55) | \$ (30)      | (0,01)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

##### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 %              | 17/11/2059      | \$ 122                           | \$ (4)                 | \$ 4                             | \$ 0         | 0,00                |
| MYI          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 487                              | 0                      | 0                                | 0            | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                | 17/08/2061      | 200                              | 0                      | 1                                | 1            | 0,00                |
| UAG          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                | 17/11/2059      | 243                              | (7)                    | 7                                | 0            | 0,00                |
|              |                             |                      |                 |                                  | \$ (11)                | \$ 12                            | \$ 1         | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

##### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | À recevoir                       | CPURNSA                 | 1,800 %   | 20/07/2026      | \$ 600            | \$ 0                   | \$ (119)                         | \$ (119)     | (0,05)              |
|              | À recevoir                       | CPURNSA                 | 1,805     | 20/09/2026      | 50                | 0                      | (10)                             | (10)         | 0,00                |
|              | À recevoir                       | CPURNSA                 | 1,810     | 19/07/2026      | 500               | 0                      | (98)                             | (98)         | (0,04)              |
|              |                                  |                         |           |                 |                   | \$ 0                   | \$ (227)                         | \$ (227)     | (0,09)              |

##### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                 | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À recevoir         | Indice MLPIREIL Index | 20 626                       | 4,320 %       | \$ 2 310          | 09/06/2027      | \$ 0                   | \$ (17)                          | \$ (17)      | (0,01)              |
|              | À payer            | Indice MLPIREIS Index | 20 684                       | 4,120         | 2 152             | 09/06/2027      | 0                      | (34)                             | (34)         | (0,01)              |
| JPM          | À recevoir         | Indice JMABDEWU Index | 1 627                        | 0,053         | 262               | 15/07/2026      | 0                      | (2)                              | (2)          | 0,00                |
|              | À recevoir         | Indice JMABNIU5 Index | 69 330                       | 0,000         | 16 497            | 15/07/2026      | 0                      | (686)                            | (686)        | (0,26)              |
| MAC          | À recevoir         | Indice PIMCDBU Index  | 158 068                      | 0,220         | 34 911            | 15/09/2026      | (1)                    | (1 506)                          | (1 507)      | (0,57)              |
|              | À recevoir         | Indice PIMCDBV Index  | 67 717                       | 0,600         | 6 094             | 15/03/2027      | 0                      | 147                              | 147          | 0,06                |
| ULO          | À recevoir         | Indice TRNGLU Index   | 2 590                        | 3,365         | 15 343            | 15/07/2026      | 0                      | 109                              | 109          | 0,04                |
|              |                    |                       |                              |               |                   |                 | \$ (1)                 | \$ (1 989)                       | \$ (1 990)   | (0,75)              |

##### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                    | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | À payer            | Banco Santander S.A.     | 1 438                        | 3,370 %       | \$ 18             | 12/02/2027      | \$ 0                   | \$ (2)                           | \$ (2)       | 0,00                |
| JPM          | À payer            | Skyworks Solutions, Inc. | 288                          | 3,920         | 22                | 29/10/2026      | 0                      | 3                                | 3            | 0,00                |
| MYI          | À payer            | Fox Corp.                | 388                          | 4,270         | 21                | 16/06/2027      | 0                      | 0                                | 0            | 0,00                |
| RBC          | À payer            | Kimberly-Clark Corp.     | 205                          | 3,770         | 20                | 06/11/2026      | 0                      | (2)                              | (2)          | 0,00                |
|              | À payer            | Union Pacific Corp.      | 100                          | 3,770         | 26                | 24/03/2027      | 0                      | (1)                              | (1)          | 0,00                |
|              | À payer            | NextEra Energy, Inc.     | 732                          | 3,720         | 64                | 19/05/2027      | 0                      | 0                                | 0            | 0,00                |
|              |                    |                          |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (2)                           | \$ (2)       | 0,00                |



## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |         | Plus-value latente |       | (Moins-value) latente |       | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |      |      |      |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|---------|--------------------|-------|-----------------------|-------|-----------------------------------------|---------------------|--------|------|------|------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 601        | \$                | 430     | \$                 | 13    | \$                    | 0     | \$                                      | 13                  | 0,01   |      |      |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 270        |                   | 40      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           | NZD             | 1 738      |                   | 1 027   |                    | 38    |                       | 0     |                                         | 38                  | 0,01   |      |      |      |
|              | 07/2026           | \$              | 45         |                   | 65      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 997        |                   | 1 765   |                    | 7     |                       | 0     |                                         | 7                   | 0,00   |      |      |      |
|              | 08/2026           | CAD             | 64         |                   | 45      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |      |      |      |
|              | 08/2026           | NZD             | 1 765      |                   | 998     |                    | 0     | (7)                   |       | (7)                                     | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           | BRL             | 52         |                   | 10      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           | NOK             | 775        |                   | 78      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           | \$              | 314        |                   | 438     |                    | 0     | (10)                  |       | (10)                                    | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
| BOA          | 07/2026           |                 | 250        |                   | 1 691   |                    | 0     | (1)                   |       | (1)                                     | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 348        |                   | 55 300  |                    | 0     | (7)                   |       | (7)                                     | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 190        |                   | 289 422 |                    | 0     | (3)                   |       | (3)                                     | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 181        |                   | 1 679   |                    | 0     | (11)                  |       | (11)                                    | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 24         |                   | 91      |                    | 0     | 0                     |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 381        | \$                | 128     |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 08/2026           | \$              | 41         |                   | 320     |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 09/2026           | MXN             | 564        | \$                | 32      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 09/2026           | \$              | 164        |                   | 15 589  |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 09/2026           |                 | 626        |                   | 38 605  |                    | 1     |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
| BPS          | 07/2026           | BRL             | 812        |                   | 157     |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | CAD             | 289        |                   | 209     |                    | 6     |                       | 0     |                                         | 6                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | CHF             | 209        |                   | 266     |                    | 7     |                       | 0     |                                         | 7                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 301        |                   | 44      |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | £               | 257        |                   | 346     |                    | 5     |                       | 0     |                                         | 5                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | IDR             | 29 140 410 |                   | 1 626   |                    | 1     | (1)                   |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | ILS             | 583        |                   | 198     |                    | 2     |                       | 0     |                                         | 2                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | INR             | 53 590     |                   | 558     |                    | 0     | (8)                   |       | (8)                                     | 0,00                | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | ¥               | 66 608     |                   | 419     |                    | 9     |                       | 0     |                                         | 9                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           | KRW             | 123 222    |                   | 81      |                    | 1     |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
| 07/2026      | THB               | 7 413           |            | 226               |         | 3                  |       | 0                     |       | 3                                       | 0,00                | 0,00   |      |      |      |
|              | 07/2026           | \$              | 291        |                   | 1 501   |                    | 0     | (1)                   |       | (1)                                     | 0,00                | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 926        |                   | 6 319   |                    | 2     |                       | 0     |                                         | 2                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 736        |                   | 15 327  |                    | 0     | (14)                  |       | (14)                                    | 0,00                | (0,01) | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 692      |                   | 160 569 |                    | 5     | (3)                   |       | 2                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 382        |                   | 586 466 |                    | 0     | (3)                   |       | (3)                                     | 0,00                | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 958      |                   | 61 780  |                    | 0     | (19)                  |       | (19)                                    | 0,00                | (0,01) | 0,00 |      |      |
|              | 07/2026           |                 | 149        |                   | 2 449   |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 |      |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 546        | \$                | 185     |                    | 1     |                       | 0     |                                         | 1                   | 0,00   | 0,00 | 0,00 |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 6 224 278  |                   | 343     |                    | 0     | (2)                   |       | (2)                                     | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 |      |
|              | 09/2026           | THB             | 6 341      |                   | 196     |                    | 3     |                       | 0     |                                         | 3                   | 0,00   | 0,00 | 0,00 |      |
| 09/2026      | \$                | 1 524           |            | 27 012 063        |         | 2                  | (29)  |                       | (27)  | 0,00                                    | (0,01)              | 0,00   | 0,00 |      |      |
| 09/2026      |                   | 221             |            | 21 026            |         | 0                  | (1)   |                       | (1)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 |      |      |
| 09/2026      |                   | 44              |            | 1 435             |         | 0                  |       | 0                     |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 |      |
| 09/2026      |                   | 275             |            | 5 013 032         |         | 1                  |       | 0                     |       | 1                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 |      |
| BRC          | 07/2026           | ILS             | 724        |                   | 245     |                    | 2     |                       | 0     |                                         | 2                   | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 525      |                   | 1 493   |                    | 58    |                       | 0     |                                         | 58                  | 0,02   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           | SGD             | 2          |                   | 2       |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           | TRY             | 44         |                   | 1       |                    | 0     |                       | 0     |                                         | 0                   | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 1 811      |                   | 7 355   |                    | 0     | (10)                  |       | (10)                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 2 844      |                   | 135 371 |                    | 21    |                       | 0     |                                         | 21                  | 0,01   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 745        |                   | 12 093  |                    | 0     | (8)                   |       | (8)                                     | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           | ¥               | 352 968    | \$                | 2 220   |                    | 49    |                       | 0     |                                         | 49                  | 0,02   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           | \$              | 180        | €                 | 154     |                    | 0     | (3)                   |       | (3)                                     | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
|              | 07/2026           |                 | 1 728      | NZD               | 3 058   |                    | 12    |                       | 0     |                                         | 12                  | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 08/2026      | NZD               | 3 058           | \$         | 1 730             |         | 0                  | (12)  |                       | (12)  | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      | \$                | 7 208           | BRL        | 36 969            |         | 0                  | (172) |                       | (172) | 0,00                                    | (0,06)              | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      | DKK               | 2 247           | \$         | 351               |         | 7                  |       | 0                     |       | 7                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      | ILS               | 650             |            | 224               |         | 6                  |       | 0                     |       | 6                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      | INR               | 34 338          |            | 364               |         | 1                  |       | 0                     |       | 1                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      | NOK               | 930             |            | 100               |         | 6                  |       | 0                     |       | 6                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      | \$                | 246             |            | 211               |         | 0                  | (5)   |                       | (5)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 243             |            | 74 307            |         | 0                  | (4)   |                       | (4)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 306             |            | 5 495 842         |         | 0                  |       | 0                     |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 354             |            | 34 338            |         | 8                  |       | 0                     |       | 8                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 40              |            | 59 740            |         | 0                  | (1)   |                       | (1)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 252             |            | 922               |         | 0                  | (7)   |                       | (7)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 166             |            | 1 537             |         | 0                  | (8)   |                       | (8)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 07/2026      |                   | 700             |            | 22 128            |         | 0                  | (5)   |                       | (5)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 08/2026      | ILS               | 961             | \$         | 333               |         | 10                 |       | 0                     |       | 10                                      | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 08/2026      | \$                | 80              |            | 238               |         | 0                  |       | 0                     |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      | IDR               | 24 352 186      | \$         | 1 349             |         | 0                  | (1)   |                       | (1)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      | INR               | 3 861           |            | 40                |         | 0                  |       | 0                     |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      | PEN               | 3               |            | 1                 |         | 0                  |       | 0                     |       | 0                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      | THB               | 8 058           |            | 243               |         | 0                  | (1)   |                       | (1)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      | \$                | 523             |            | 454 396           |         | 0                  | (30)  |                       | (30)  | 0,00                                    | (0,01)              | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      |                   | 436             |            | 1 689 715         |         | 45                 |       | 0                     |       | 45                                      | 0,02                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      |                   | 343             |            | 6 116 063         |         | 0                  | (4)   |                       | (4)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 09/2026      |                   | 239             |            | 4 213             |         | 1                  | (1)   |                       | (1)   | 0,00                                    | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 12/2026      |                   | 1 043           |            | 18 950 701        |         | 1                  |       | 0                     |       | 1                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 12/2026      |                   | 333             |            | 1 164             |         | 6                  |       | 0                     |       | 6                                       | 0,00                | 0,00   | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB          | 07/2026           | IDR 719 657     | \$ 40             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 27 862      | 295               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 795          | CZK 16 562        | 0                  | (15)                  | (15)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 197             | INR 18 992        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 77              | NOK 719           | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 252             | PLN 936           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 338             | RON 1 527         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 347             | ZAR 5 623         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 7 181 109   | \$ 399            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 210          | IDR 3 822 413     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 09/2026           | 295             | INR 28 050        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 1 806       | \$ 266            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 15 859        | 21 326            | 278                | 0                     | 278                                     | 0,10                |
|              | 07/2026           | INR 26 206      | 278               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 90 230        | 568               | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 915         | 94                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 1 713       | 1 342             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 143          | BRL 724           | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 275             | INR 26 206        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9 748           | ¥ 1 577 297       | 0                  | (44)                  | (44)                                    | (0,02)              |
| GLM          | 07/2026           | 1 526           | PLN 5 596         | 0                  | (38)                  | (38)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 485             | ZAR 8 011         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 453         | \$ 158            | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 1 573 170     | 9 748             | 44                 | 0                     | 44                                      | 0,02                |
|              | 08/2026           | \$ 222          | CNH 1 504         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 94              | SEK 913           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 134             | INR 12 858        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 69              | MXN 1 216         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 556         | \$ 104            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 115 832     | 75                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| IND JPM      | 07/2026           | \$ 505          | BRL 2 547         | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 364           | CAD 6 210         | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 298             | IDR 5 348 501     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 75              | KRW 115 815       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 376             | PLN 1 397         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 266             | RON 1 206         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 6 202       | \$ 4 364          | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$ 176          | INR 16 834        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 5 379 822   | \$ 298            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 416         | 24                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 09/2026           | THB 349         | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 982          | IDR 17 627 922    | 2                  | (7)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 717             | INR 68 962        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 119             | MXN 2 068         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 285             | THB 9 189         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 4 017       | \$ 627            | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 2 600       | 1 854             | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | BRL 3 708       | 721               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 1 847       | 619               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 13 407      | 142               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 35 794      | 23                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 800       | 182               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 188          | CNH 1 272         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 364             | £ 271             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 733             | HUF 224 315       | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 45              | IDR 802 807       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 142             | INR 13 407        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 34              | KRW 52 392        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 096           | PLN 7 637         | 0                  | (65)                  | (65)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           | 162             | THB 5 412         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 626       | \$ 559            | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 152          | HKD 1 190         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 182             | NOK 1 801         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 807 269     | \$ 45             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 1 535       | 87                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 5 401       | 162               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 772        | INR 168 749       | 1                  | (3)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 8 326           | MXN 144 728       | 0                  | (97)                  | (97)                                    | (0,04)              |
|              | 09/2026           | 150             | THB 4 850         | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | 721             | BRL 3 790         | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | MXN 512         | \$ 29             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 188          | MXN 3 312         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 11          | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 2 065       | 2 614             | 58                 | (2)                   | 56                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | € 395           | 453               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 73 665      | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 27 972      | 296               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 266 548       | 1 678             | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | NOK 581         | 58                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 559         | 57                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 181        | AUD 1 712         | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 240           | DKK 8 130         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 316             | € 272             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| MYI          | 07/2026           | \$ 457          | INR 44 020        | \$ 8               | \$ 0                  | \$ 8                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 286           | KRW 4 981 636     | 0                  | (70)                  | (70)                                    | (0,03)              |
|              | 07/2026           | 184             | NOK 1 708         | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 140             | TWD 4 428         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 309       | \$ 903            | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 8 116       | 1 240             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 58           | NOK 581           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 57              | SEK 558           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 4 935       | \$ 148            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 151        | INR 110 128       | 6                  | (2)                   | 4                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | € 52            | \$ 59             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 560         | 322               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 82          | 64                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 164          | MYR 676           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 278             | IDR 4 950 670     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 462             | INR 44 429        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 194             | TRY 9 134         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 4 978 435   | \$ 278            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 210          | IDR 3 733 980     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 334             | 5 993 562         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | 2 169           | CNY 14 801        | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 104             | IDR 1 862 027     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 608             | INR 58 258        | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 144             | HKD 1 123         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 436             | INR 41 813        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 5 617 022   | \$ 311            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 535          | IDR 9 603 834     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 103             | THB 3 331         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 586         | \$ 87             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 4 217       | 657               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | € 54 853        | 63 988            | 1 274              | 0                     | 1 274                                   | 0,48                |
|              | 07/2026           | ¥ 856 437       | 5 391             | 122                | 0                     | 122                                     | 0,05                |
|              | 07/2026           | \$ 733          | AUD 1 062         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 62              | CHF 50            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 62 120          | € 54 611          | 318                | 0                     | 318                                     | 0,12                |
|              | 07/2026           | 201             | KRW 308 307       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 326           | SGD 1 718         | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 1 062       | \$ 732            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 50          | 62                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 54 611        | 62 205            | 0                  | (317)                 | (317)                                   | (0,12)              |
| UAG          | 08/2026           | SGD 1 714       | 1 326             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 6 095       | 4 420             | 124                | 0                     | 124                                     | 0,05                |
|              | 07/2026           | CHF 73          | 92                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 40           | CAD 57            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 57          | \$ 40             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 433          | COP 1 651 786     | 41                 | 0                     | 41                                      | 0,02                |
|              | 07/2026           | 257             | PLN 938           | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 521         | \$ 30             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 887         | 27                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP 2 724 550   | 698               | 0                  | (63)                  | (63)                                    | (0,02)              |
| WST          | 07/2026           | \$ 2 844        | CHF 2 296         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 2 288       | \$ 2 844          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 872           | \$ (1 263)            | \$ 1 609                                | 0,61                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation, E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 648          | € 557             | \$ 0               | \$ (12)               | \$ (12)                                 | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 23              | KRW 35 634        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 08/2026           | KRW 35 630      | \$ 23             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 27 323       | € 23 475          | 5                  | (490)                 | (485)                                   | (0,18)              |
| BSH          | 07/2026           | 6 003           | 5 149             | 0                  | (116)                 | (116)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | € 230           | \$ 268            | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 270          | € 232             | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 6 975         | \$ 7 955          | 0                  | (20)                  | (20)                                    | (0,01)              |
| FAR          | 07/2026           | SGD 38          | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 7 966        | € 6 975           | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,01                |
| MBC          | 07/2026           | € 24 883        | \$ 28 265         | 1                  | (185)                 | (184)                                   | (0,07)              |
|              | 07/2026           | \$ 5 449        | € 4 699           | 0                  | (76)                  | (76)                                    | (0,03)              |
| SOG          | 08/2026           | 28 213          | 24 805            | 186                | 0                     | 186                                     | 0,07                |
|              | 07/2026           | € 24 544        | \$ 27 918         | 0                  | (142)                 | (142)                                   | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 26 270       | € 22 519          | 0                  | (524)                 | (524)                                   | (0,20)              |
|              | 07/2026           | 29              | SGD 38            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 38          | \$ 29             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 27 956       | € 24 544          | 143                | 0                     | 143                                     | 0,05                |
| UAG          | 07/2026           | KRW 35 626      | \$ 24             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 361             | \$ (1 570)            | \$ (1 209)                              | (0,46)              |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 195          | £ 145             | \$ 0               | \$ (2)                | \$ (2)                                  | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | \$ 3            | £ 2               | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 113           | \$ 149            | \$ 0               | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 958          | £ 716             | 1                  | (9)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 137             | 104               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | £ 8             | \$ 11             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 293             | 392               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | \$ 32           | £ 24              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 5             | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | \$ 900          | £ 671             | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | £ 21            | \$ 28             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 1               | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 21              | 28                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 28           | £ 21              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 419           | \$ 555            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 492          | £ 372             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 656           | \$ 873            | 4                  | (2)                   | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 8             | £ 6               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 6             | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | \$ 488          | £ 370             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 41            | \$ 54             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 54           | £ 41              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 13              | \$ (25)               | \$ (12)                                 | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 278          | SGD 355           | \$ 0               | \$ (4)                | \$ (4)                                  | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD 82          | \$ 64             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 174        | SGD 1 499         | 0                  | (15)                  | (15)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 33              | 42                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | 2               | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | SGD 246         | \$ 190            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 135          | SGD 173           | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SGD 55          | \$ 42             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 316          | SGD 403           | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 42              | 55                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 76          | \$ 59             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 404        | SGD 1 791         | 0                  | (19)                  | (19)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 59              | 76                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SGD 388         | \$ 302            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | \$ 1            | SGD 1             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | SGD 32          | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 24           | SGD 32            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RBC          | 07/2026           | 27              | 35                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 3 395       | \$ 2 621          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 15           | SGD 19            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 2 594           | 3 353             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | 20              | 26                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 35              | 45                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 7               | \$ (47)               | \$ (40)                                 | (0,02)              |

|                                                    |             |         |
|----------------------------------------------------|-------------|---------|
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | \$ (1 906)  | (0,72)  |
| Total des Investissements                          | \$ 341 088  | 129,23  |
| Autres actifs et passifs à court terme             | \$ (77 157) | (29,23) |
| Actif net                                          | \$ 263 931  | 100,00  |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (d) Affilié au Fonds.
- (e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804 % | 20/04/2033      | 13/04/2026   | \$ 700 | \$ 699       | 0,26                |

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 27 496 \$ (31 décembre 2025 : 4 514 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 5 302 \$ (31 décembre 2025 : 3 300 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 3 210 \$ (31 décembre 2025 : 840 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 11 346                                                                         | \$ 304 004                                           | \$ 0                                              | \$ 315 350        |
| Fonds d'investissement                        | 23 562                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 23 562            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 292                                                                               | 1 884                                                | 0                                                 | 2 176             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 35 200</b>                                                                  | <b>\$ 305 888</b>                                    | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 341 088</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 8 483                                                                          | \$ 228 213                                           | \$ 0                                              | \$ 236 696        |
| Fonds d'investissement                        | 289                                                                               | 20 789                                               | 0                                                 | 21 078            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 199                                                                               | 4 476                                                | 0                                                 | 4 675             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 8 971</b>                                                                   | <b>\$ 253 478</b>                                    | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 262 449</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| DEU                                           | 3,720 %        | 26/06/2026        | 02/07/2026      | \$ (843)         | \$ (843)                                 | (0,32)              |
|                                               | 3,730          | 29/06/2026        | 06/07/2026      | (21 232)         | (21 236)                                 | (8,05)              |
|                                               | 3,740          | 25/06/2026        | 02/07/2026      | (841)            | (842)                                    | (0,32)              |
|                                               | 3,760          | 24/06/2026        | 01/07/2026      | (4 261)          | (4 264)                                  | (1,61)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (27 185)</b>                       | <b>(10,30)</b>      |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 45                                                      | \$ 0                    | \$ 45                             | \$ 2                                                       | \$ 0                    | \$ 2                              |
| BOA          | (109)                                                      | 0                       | (109)                             | 11                                                         | 0                       | 11                                |
| BPS          | (526)                                                      | 650                     | 124                               | 27                                                         | 0                       | 27                                |
| BRC          | 62                                                         | (50)                    | 12                                | 129                                                        | (120)                   | 9                                 |
| BSH          | (242)                                                      | 0                       | (242)                             | 11                                                         | (10)                    | 1                                 |
| CBK          | 28                                                         | 0                       | 28                                | (279)                                                      | 300                     | 21                                |
| DUB          | (33)                                                       | 0                       | (33)                              | 16                                                         | 0                       | 16                                |
| FAR          | 262                                                        | (350)                   | (88)                              | 141                                                        | (320)                   | (179)                             |
| GLM          | (31)                                                       | 30                      | (1)                               | 23                                                         | 0                       | 23                                |
| GST          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| IND          | 13                                                         | 0                       | 13                                | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (816)                                                      | 790                     | (26)                              | 203                                                        | (370)                   | (167)                             |
| MAC          | (1 360)                                                    | 1 480                   | 120                               | 282                                                        | (360)                   | (78)                              |
| MBC          | (52)                                                       | 0                       | (52)                              | 172                                                        | 0                       | 172                               |
| MYC          | (227)                                                      | 260                     | 33                                | (202)                                                      | 260                     | 58                                |
| MYI          | 4                                                          | (50)                    | (46)                              | (9)                                                        | (50)                    | (59)                              |
| NSL          | 5                                                          | 0                       | 5                                 | 29                                                         | 0                       | 29                                |
| RBC          | (3)                                                        | 0                       | (3)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| RYL          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SAL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| SCX          | 12                                                         | 0                       | 12                                | 11                                                         | 0                       | 11                                |
| SOG          | 858                                                        | (980)                   | (122)                             | (74)                                                       | 0                       | (74)                              |
| SSB          | 167                                                        | 0                       | 167                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| UAG          | (69)                                                       | (290)                   | (359)                             | 5                                                          | 280                     | 285                               |
| ULO          | 109                                                        | 0                       | 109                               | (28)                                                       | 0                       | (28)                              |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 54,07            | 47,83                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 26,30            | 27,81                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,72             | 0,61                 |
| Fonds d'investissement                                           | 6,04             | 6,79                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,28             | 0,12                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 1,25             | 1,69                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,90             | 0,55                 |
| Autres actifs                                                    | 10,44            | 14,60                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                       | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                           | 3,26             | 1,74                 |
| Agences du gouvernement américain                                                       | 31,91            | 34,66                |
| Obligations du Trésor américain                                                         | 36,90            | 41,42                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 3,19             | 4,07                 |
| Titres adossés à des actifs                                                             | 1,80             | 2,71                 |
| Émissions souveraines                                                                   | 38,06            | 27,54                |
| Actions ordinaires                                                                      | 0,23             | 0,23                 |
| Titres privilégiés                                                                      | 0,05             | 0,07                 |
| Sociétés d'investissement immobilier                                                    | 4,07             | 3,90                 |
| Fonds d'investissement                                                                  | 8,93             | 10,36                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                        |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                           | 0,13             | 0,04                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                 | 1,42             | 2,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                |                  |                      |
| Options vendues                                                                         |                  |                      |
| Options plafonnées sur l'inflation                                                      | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                             | (0,01)           | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                 | (0,09)           | (0,10)               |
| Swaps de rendement total sur indices                                                    | (0,75)           | 0,21                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                     | 0,00             | 0,00                 |
| Contrats de change à terme                                                              | 0,61             | (0,17)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                     | (0,48)           | 0,29                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                  | (29,23)          | (29,00)              |
| Actif net                                                                               | 100,00           | 100,00               |



| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS          |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           |
| Bank of Industry Ltd.                    |                                     |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC              |                                     |                                  |                           | Royal Bank of Canada                     |                                     |                                  |                           |
| 3,895 % éch. 23/08/2027                  | €                                   | 4 750                            | \$                        | 2,700 % éch. 10/08/2026                | \$                                  | 12 618                           | \$                        | 4,612 % éch. 26/07/2027                  | CAD                                 | 8 700                            | \$                        |
| Discovery Global Holdings, Inc.          |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 17/08/2027                |                                     | 1 100                            |                           | 5,153 % éch. 04/02/2031                  | \$                                  | 11 991                           |                           |
| 6,144 % éch. 03/06/2033                  | \$                                  | 25 402                           |                           | 4,271 % éch. 09/01/2027                |                                     | 10 160                           |                           | Sammons Financial Group Global Funding   |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     | 25 441                           | 0,39                      | 5,125 % éch. 05/11/2026                |                                     | 23 782                           |                           | 4,950 % éch. 12/06/2030                  |                                     | 500                              |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 05/03/2027                |                                     | 14 500                           |                           | Sammons Financial Group, Inc.            |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 04/11/2027                |                                     | 200                              |                           | 3,350 % éch. 16/04/2031                  |                                     | 3 546                            |                           |
|                                          |                                     | 30 860                           | 0,47                      |                                        |                                     |                                  |                           | Santander Holdings USA, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS            |                                     |                                  |                           | GA Global Funding Trust                |                                     |                                  |                           | 2,490 % éch. 06/01/2028                  |                                     | 4 400                            |                           |
| BANQUE ET FINANCE                        |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 06/01/2027                |                                     | 14 000                           |                           | Santander UK Group Holdings PLC          |                                     |                                  |                           |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 23/09/2027                |                                     | 12 260                           |                           | 2,469 % éch. 11/01/2028                  |                                     | 37 299                           |                           |
| 5,375 % éch. 08/05/2029                  |                                     | 4 000                            |                           | General Motors Financial Co., Inc.     |                                     |                                  |                           | 4,707 % éch. 22/09/2029                  |                                     | 7 500                            |                           |
| American Honda Finance Corp.             |                                     |                                  |                           | 4,675 % éch. 26/02/2027                |                                     | 811                              |                           | Sirius Real Estate Ltd.                  |                                     |                                  |                           |
| 4,562 % éch. 10/04/2028                  |                                     | 15 400                           |                           | 4,977 % éch. 08/05/2027                |                                     | 745                              |                           | 1,750 % éch. 24/11/2028                  | €                                   | 400                              |                           |
| Athene Global Funding                    |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.              |                                     |                                  |                           | Skandinavisk Enskilda Banken AB          |                                     |                                  |                           |
| 4,505 % éch. 07/01/2027                  |                                     | 700                              |                           | 4,341 % éch. 21/01/2029                |                                     | 5 900                            |                           | 4,699 % éch. 03/09/2030                  | \$                                  | 10 700                           |                           |
| 4,637 % éch. 18/09/2028                  |                                     | 41 400                           |                           | 4,594 % éch. 20/04/2030                |                                     | 2 400                            |                           | Société Générale S.A.                    |                                     |                                  |                           |
| 4,847 % éch. 25/03/2027                  |                                     | 11 900                           |                           | 4,632 % éch. 20/04/2030                |                                     | 30 100                           |                           | 5,250 % éch. 19/02/2027                  |                                     | 2 944                            |                           |
| 5,033 % éch. 17/07/2030                  |                                     | 6 000                            |                           | 4,692 % éch. 23/10/2030                |                                     | 24 665                           |                           | SRC Sukuk Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| 5,380 % éch. 07/01/2030                  |                                     | 7 104                            |                           | 4,755 % éch. 24/02/2028                |                                     | 500                              |                           | 4,375 % éch. 02/04/2029                  |                                     | 39 400                           |                           |
| Avolon Holdings Funding Ltd.             |                                     |                                  |                           | 5,049 % éch. 23/07/2030                |                                     | 2 800                            |                           | Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                     |                                  |                           |
| 3,250 % éch. 15/02/2027                  |                                     | 600                              |                           | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.    |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 15/09/2028                  |                                     | 16 000                           |                           |
| 4,200 % éch. 15/04/2029                  |                                     | 4 300                            |                           | 4,250 % éch. 03/05/2030                | €                                   | 300                              |                           | 5,328 % éch. 15/09/2028                  |                                     | 11 550                           |                           |
| 6,375 % éch. 04/05/2028                  |                                     | 10 203                           |                           | Hardwood Funding LLC                   |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 15/06/2029                  |                                     | 2 500                            |                           |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.     |                                     |                                  |                           | 4,360 % éch. 08/06/2029 (h)            | \$                                  | 4 700                            |                           | Sumisho Air Lease Corp.                  |                                     |                                  |                           |
| 4,968 % éch. 08/05/2031                  |                                     | 2 800                            |                           | HSBC Holdings PLC                      |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 15/01/2027                  |                                     | 700                              |                           |
| Banco Santander S.A.                     |                                     |                                  |                           | 4,929 % éch. 03/03/2031                |                                     | 2 225                            |                           | 3,625 % éch. 01/04/2027                  |                                     | 6 657                            |                           |
| 4,175 % éch. 24/03/2028                  |                                     | 2 167                            |                           | 5,597 % éch. 17/05/2028                |                                     | 23 000                           |                           | 3,625 % éch. 01/12/2027                  |                                     | 17 072                           |                           |
| 5,294 % éch. 18/08/2027                  |                                     | 5 000                            |                           | ING Groep NV                           |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 24/03/2029                  |                                     | 21 600                           |                           |
| 5,552 % éch. 14/03/2028                  |                                     | 6 400                            |                           | Intesa Sanpaolo SpA                    |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 24/03/2031                  |                                     | 6 800                            |                           |
| Bank Hapoalim B.M.                       |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 29/06/2030                |                                     | 13 500                           |                           | 5,850 % éch. 15/12/2027                  |                                     | 1 950                            |                           |
| 4,722 % éch. 14/07/2029                  |                                     | 6 800                            |                           | Jackson National Life Global Funding   |                                     |                                  |                           | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.    |                                     |                                  |                           |
| 5,252 % éch. 14/01/2033                  |                                     | 1 500                            |                           | 4,588 % éch. 12/09/2028                |                                     | 21 500                           |                           | 4,660 % éch. 08/07/2031                  |                                     | 10 900                           |                           |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.                |                                     |                                  |                           | 5,350 % éch. 13/01/2030                |                                     | 7 649                            |                           | Synchrony Financial                      |                                     |                                  |                           |
| 5,343 % éch. 29/06/2029                  |                                     | 6 500                            |                           | JPMorgan Chase & Co.                   |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 04/08/2026                  |                                     | 6 764                            |                           |
| Bank of America Corp.                    |                                     |                                  |                           | 4,470 % éch. 22/01/2032                |                                     | 13 000                           |                           | UBS AG                                   |                                     |                                  |                           |
| 5,162 % éch. 24/01/2031                  |                                     | 11 889                           |                           | 4,603 % éch. 22/10/2030                |                                     | 19 100                           |                           | 4,449 % éch. 16/03/2029                  |                                     | 20 450                           |                           |
| Bank of Nova Scotia                      |                                     |                                  |                           | Korea Investment & Securities Co. Ltd. |                                     |                                  |                           | UBS Group AG                             |                                     |                                  |                           |
| 5,130 % éch. 14/02/2031                  |                                     | 9 446                            |                           | 6,875 % éch. 06/11/2026                |                                     | 1 850                            |                           | 4,499 % éch. 10/04/2030                  |                                     | 19 400                           |                           |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.  |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC               |                                     |                                  |                           | Ventas Realty LP                         |                                     |                                  |                           |
| 4,623 % éch. 16/10/2028                  |                                     | 19 858                           |                           | 4,692 % éch. 26/11/2028                |                                     | 20 900                           |                           | 3,850 % éch. 01/04/2027                  |                                     | 1 402                            |                           |
| Barclays PLC                             |                                     |                                  |                           | Logicor Financing SARL                 |                                     |                                  |                           | VICI Properties LP                       |                                     |                                  |                           |
| 4,565 % éch. 24/05/2030                  |                                     | 12 200                           |                           | 4,250 % éch. 18/07/2029                | €                                   | 3 000                            |                           | 4,250 % éch. 01/12/2026                  |                                     | 42 646                           |                           |
| 4,707 % éch. 11/11/2029                  |                                     | 17 947                           |                           | Marex Group PLC                        |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/09/2026                  |                                     | 7 200                            |                           |
| BNP Paribas S.A.                         |                                     |                                  |                           | 5,680 % éch. 21/04/2031                | \$                                  | 500                              |                           | 4,750 % éch. 01/04/2028                  |                                     | 1 734                            |                           |
| 2,591 % éch. 20/01/2028                  |                                     | 18 200                           |                           | Mizrahi Tefahot Bank Ltd.              |                                     |                                  |                           | Wells Fargo & Co.                        |                                     |                                  |                           |
| 5,056 % éch. 09/05/2029                  |                                     | 500                              |                           | 5,049 % éch. 28/01/2031                |                                     | 24 600                           |                           | 3,526 % éch. 24/03/2028                  |                                     | 4 900                            |                           |
| BPCE S.A.                                |                                     |                                  |                           | Mizuho Financial Group, Inc.           |                                     |                                  |                           | 4,370 % éch. 23/01/2030                  |                                     | 15 700                           |                           |
| 3,500 % éch. 23/10/2027                  |                                     | 8 093                            |                           | 4,486 % éch. 13/07/2030 (b)            |                                     | 10 200                           |                           | 4,700 % éch. 24/04/2028                  |                                     | 200                              |                           |
| 5,612 % éch. 19/10/2027                  |                                     | 500                              |                           | 4,711 % éch. 08/07/2031                |                                     | 11 300                           |                           | 5,150 % éch. 23/04/2031                  |                                     | 17 700                           |                           |
| Canadian Imperial Bank of Commerce       |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley                         |                                     |                                  |                           | 5,244 % éch. 24/01/2031                  |                                     | 2 000                            |                           |
| 4,297 % éch. 26/06/2028                  |                                     | 48 200                           |                           | 4,654 % éch. 18/10/2030                |                                     | 13 304                           |                           | Westfield Stratford City Finance PLC     |                                     |                                  |                           |
| 4,428 % éch. 29/01/2030                  |                                     | 22 000                           |                           | Morgan Stanley Private Bank N.A.       |                                     |                                  |                           | 5,124 % éch. 05/05/2036                  | £                                   | 15 000                           |                           |
| Citadel Finance LLC                      |                                     |                                  |                           | 4,734 % éch. 18/07/2031                |                                     | 2 700                            |                           |                                          |                                     | 20 071                           | 0,31                      |
| 4,750 % éch. 14/02/2029                  |                                     | 7 700                            |                           | National Bank of Canada                |                                     |                                  |                           |                                          |                                     | 1 466 724                        | 22,46                     |
| Citigroup, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 4,402 % éch. 20/01/2029                |                                     | 51 500                           |                           | INDUSTRIE                                |                                     |                                  |                           |
| 4,643 % éch. 07/05/2028                  |                                     | 39 500                           |                           | Nationwide Building Society            |                                     |                                  |                           | Air Canada Pass-Through Trust            |                                     |                                  |                           |
| Corebridge Financial, Inc.               |                                     |                                  |                           | 4,703 % éch. 14/07/2029                |                                     | 26 135                           |                           | 3,600 % éch. 15/09/2028                  | \$                                  | 100                              |                           |
| 3,650 % éch. 05/04/2027                  |                                     | 3 900                            |                           | NatWest Group PLC                      |                                     |                                  |                           | Alaska Airlines Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           |
| Crown Castle, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 4,735 % éch. 23/05/2029                |                                     | 9 899                            |                           | 4,800 % éch. 15/02/2029                  |                                     | 228                              |                           |
| 2,900 % éch. 15/03/2027                  |                                     | 1 800                            |                           | 5,516 % éch. 30/09/2028                |                                     | 12 479                           |                           | American Airlines Pass-Through Trust     |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 01/09/2029                  |                                     | 13 200                           |                           | NatWest Markets PLC                    |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 15/04/2030                  |                                     | 110                              |                           |
| Deutsche Bank AG                         |                                     |                                  |                           | 4,427 % éch. 06/11/2028                |                                     | 11 400                           |                           | 3,350 % éch. 15/04/2031                  |                                     | 113                              |                           |
| 2,311 % éch. 16/11/2027                  |                                     | 17 331                           |                           | 4,450 % éch. 06/11/2028                |                                     | 8 600                            |                           | 3,600 % éch. 22/03/2029                  |                                     | 105                              |                           |
| 5,706 % éch. 08/02/2028                  |                                     | 11 085                           |                           | 4,768 % éch. 17/05/2029                |                                     | 9 900                            |                           | 3,650 % éch. 15/08/2030                  |                                     | 114                              |                           |
| Emirates NBD Bank PJSC                   |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Acceptance Co. LLC        |                                     |                                  |                           | Baxter International, Inc.               |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 29/06/2031                  |                                     | 15 900                           |                           | 5,625 % éch. 29/09/2028                |                                     | 1 400                            |                           | 4,900 % éch. 15/12/2030                  |                                     | 400                              |                           |
| Equitable Financial Life Global Funding  |                                     |                                  |                           | Nomura Holdings, Inc.                  |                                     |                                  |                           | Bayer U.S. Finance LLC                   |                                     |                                  |                           |
| 1,400 % éch. 27/08/2027                  |                                     | 4 588                            |                           | 2,329 % éch. 22/01/2027                |                                     | 3 981                            |                           | 4,375 % éch. 15/12/2028                  |                                     | 7 400                            |                           |
| Extra Space Storage LP                   |                                     |                                  |                           | Norinchukin Bank                       |                                     |                                  |                           | Berry Global, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 01/07/2030                  |                                     | 2 100                            |                           | 5,094 % éch. 16/10/2029                |                                     | 20 500                           |                           | 1,650 % éch. 15/01/2027                  |                                     | 7 246                            |                           |
| F&G Global Funding                       |                                     |                                  |                           | QNB Finance Ltd.                       |                                     |                                  |                           | BMW U.S. Capital LLC                     |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 20/09/2028                  |                                     | 1 250                            |                           | 4,538 % éch. 19/09/2027                |                                     | 46 500                           |                           | 4,428 % éch. 17/03/2028                  |                                     | 55 600                           |                           |
| 5,875 % éch. 10/06/2027                  |                                     | 13 682                           |                           | RGA Global Funding                     |                                     |                                  |                           | CDW LLC                                  |                                     |                                  |                           |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 30/11/2026                |                                     | 2 700                            |                           | 2,670 % éch. 01/12/2026                  |                                     | 25 114                           |                           |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                  |                                     | 52 700                           |                           | 5,500 % éch. 11/01/2031                |                                     | 800                              |                           | DAE Funding LLC                          |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 20/03/2028                  |                                     | 2 800                            |                           |

# Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

| DESCRIPTION                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Daimler Truck Finance North America LLC   |                                     |                                  |                           | <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>                  |                                     |                                  |                           | 4,678 % éch. 25/01/2055 - 25/09/2055 | \$ 7 541                            | \$ 7 578                         | 0,12                      |
| 4,650 % éch. 12/10/2030                   | \$ 21 900                           | \$ 21 729                        | 0,33                      | AES Corp.                                          |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 01/08/2031              | 5 000                               | 5 029                            | 0,08                      |
| Delta Air Lines, Inc.                     |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 15/07/2029                            | \$ 6 100                            | \$ 6 136                         | 0,09                      | 4,728 % éch. 25/06/2054 - 25/10/2055 | 54 823                              | 55 211                           | 0,85                      |
| 4,750 % éch. 20/10/2028                   | 3 691                               | 3 688                            | 0,06                      | Black Hills Corp.                                  |                                     |                                  |                           | 4,730 % éch. 01/05/2029              | 5 085                               | 5 120                            | 0,08                      |
| Element Fleet Management Corp.            |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/01/2027                            | 2 617                               | 2 600                            | 0,04                      | 4,740 % éch. 01/04/2030              | 10 440                              | 10 473                           | 0,16                      |
| 5,643 % éch. 13/03/2027                   | 8 020                               | 8 076                            | 0,12                      | Fells Point Funding Trust                          |                                     |                                  |                           | 4,760 % éch. 01/06/2029 (i)          | 41 675                              | 42 027                           | 0,64                      |
| Equate Petrochemical Co. KSCC             |                                     |                                  |                           | 3,046 % éch. 31/01/2027                            | 13 683                              | 13 559                           | 0,21                      | 4,778 % éch. 25/06/2054 - 25/09/2055 | 49 779                              | 50 225                           | 0,77                      |
| 4,250 % éch. 03/11/2026                   | 3 300                               | 3 291                            | 0,05                      | Israel Electric Corp. Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 4,808 % éch. 25/08/2055              | 3 630                               | 3 654                            | 0,06                      |
| Fiserv, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 15/12/2027                            | 29 730                              | 30 923                           | 0,47                      | 4,812 % éch. 01/08/2029              | 34 864                              | 35 214                           | 0,54                      |
| 4,550 % éch. 15/02/2031                   | 600                                 | 586                              | 0,01                      | JERA Co., Inc.                                     |                                     |                                  |                           | 4,828 % éch. 25/12/2053 - 25/11/2055 | 87 209                              | 88 222                           | 1,35                      |
| Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc. |                                     |                                  |                           | 4,544 % éch. 02/09/2030                            | 3 200                               | 3 159                            | 0,05                      | 4,878 % éch. 25/06/2054 - 25/02/2055 | 5 369                               | 5 439                            | 0,08                      |
| 1,875 % éch. 01/12/2026                   | 10 525                              | 10 394                           | 0,16                      | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. |                                     |                                  |                           | 4,967 % éch. 01/07/2044              | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| GE HealthCare Technologies, Inc.          |                                     |                                  |                           | 4,189 % éch. 03/12/2027                            | 18 500                              | 18 531                           | 0,28                      | 5,028 % éch. 25/09/2055              | 21 876                              | 22 139                           | 0,34                      |
| 4,800 % éch. 14/08/2029                   | 6 311                               | 6 345                            | 0,10                      | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.              |                                     |                                  |                           | 5,040 % éch. 01/07/2030              | 942                                 | 960                              | 0,02                      |
| General Motors Co.                        |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 15/03/2030                            | 8 080                               | 8 186                            | 0,13                      | 5,100 % éch. 01/04/2030              | 8 600                               | 8 756                            | 0,13                      |
| 5,350 % éch. 15/04/2028                   | 4 200                               | 4 244                            | 0,07                      | Pacific Gas & Electric Co.                         |                                     |                                  |                           | 5,467 % éch. 01/11/2035              | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| Glencore Funding LLC                      |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 01/02/2031                            | 2 600                               | 2 334                            | 0,04                      | 5,810 % éch. 01/06/2031              | 4 800                               | 4 915                            | 0,08                      |
| 4,695 % éch. 04/04/2027                   | 646                                 | 649                              | 0,01                      | 3,000 % éch. 15/06/2028                            | 500                                 | 484                              | 0,01                      | 5,984 % éch. 01/01/2036              | 142                                 | 147                              | 0,00                      |
| Global Payments, Inc.                     |                                     |                                  |                           | PacifiCorp                                         |                                     |                                  |                           | 6,224 % éch. 01/05/2038              | 97                                  | 100                              | 0,00                      |
| 2,150 % éch. 15/01/2027                   | 4 087                               | 4 035                            | 0,06                      | 4,250 % éch. 15/03/2029                            | 800                                 | 790                              | 0,01                      | 6,275 % éch. 01/09/2035              | 4                                   | 4                                | 0,00                      |
| 4,450 % éch. 01/06/2028                   | 28 437                              | 28 201                           | 0,43                      | 4,650 % éch. 15/04/2029                            | 1 000                               | 998                              | 0,02                      | 6,305 % éch. 01/07/2035              | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 4,500 % éch. 15/11/2028                   | 12 600                              | 12 452                           | 0,19                      | Plains All American Pipeline LP                    |                                     |                                  |                           | Freddie Mac                          |                                     |                                  |                           |
| Hyundai Capital America                   |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/01/2031                            | 6 000                               | 5 951                            | 0,09                      | 3,000 % éch. 01/11/2032 (i)          | 5 930                               | 5 725                            | 0,09                      |
| 4,677 % éch. 19/03/2027                   | 17 700                              | 17 754                           | 0,27                      | Sempra                                             |                                     |                                  |                           | 3,004 % éch. 25/07/2054              | 14 200                              | 13 766                           | 0,21                      |
| 4,707 % éch. 18/09/2028                   | 7 000                               | 7 034                            | 0,11                      | 4,313 % éch. 07/01/2028                            | 14 600                              | 14 669                           | 0,22                      | 3,400 % éch. 15/08/2040              | 820                                 | 789                              | 0,01                      |
| 4,986 % éch. 27/03/2030                   | 40 786                              | 41 317                           | 0,63                      | SGSP Australia Assets Pty. Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 4,204 % éch. 15/07/2040              | 254                                 | 252                              | 0,00                      |
| Imperial Brands Finance PLC               |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 07/07/2027                            | 7 200                               | 7 118                            | 0,11                      | 4,264 % éch. 15/03/2042              | 95                                  | 92                               | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 26/07/2026                   | 300                                 | 300                              | 0,00                      | Southern California Edison Co.                     |                                     |                                  |                           | 4,449 % éch. 15/03/2050              | 1 926                               | 1 911                            | 0,03                      |
| JetBlue Pass-Through Trust                |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 01/03/2028                            | 400                                 | 394                              | 0,01                      | 4,528 % éch. 25/11/2054 - 25/12/2055 | 46 482                              | 46 770                           | 0,72                      |
| 2,750 % éch. 15/11/2033                   | 209                                 | 185                              | 0,00                      | 4,200 % éch. 01/03/2029                            | 4 000                               | 3 940                            | 0,06                      | 4,549 % éch. 15/04/2049 - 15/12/2050 | 7 143                               | 7 154                            | 0,11                      |
| 4,000 % éch. 15/05/2034                   | 128                                 | 122                              | 0,00                      | 4,875 % éch. 01/02/2027                            | 5 121                               | 5 130                            | 0,08                      | 4,568 % éch. 25/11/2054              | 16 601                              | 16 737                           | 0,26                      |
| Keurig Dr Pepper, Inc.                    |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 01/06/2029                            | 5 121                               | 5 176                            | 0,08                      | 4,578 % éch. 25/10/2054 - 25/06/2056 | 99 719                              | 100 660                          | 1,54                      |
| 3,430 % éch. 15/06/2027                   | 10 200                              | 10 097                           | 0,16                      | 5,250 % éch. 15/03/2030                            | 5 500                               | 5 563                            | 0,08                      | 4,608 % éch. 25/02/2055              | 945                                 | 953                              | 0,01                      |
| MPLX LP                                   |                                     |                                  |                           | 5,650 % éch. 01/10/2028                            | 200                                 | 204                              | 0,00                      | 4,628 % éch. 25/09/2054 - 25/02/2055 | 10 423                              | 10 481                           | 0,16                      |
| 4,125 % éch. 01/03/2027                   | 2 107                               | 2 102                            | 0,03                      | Vistra Operations Co. LLC                          |                                     |                                  |                           | 4,649 % éch. 15/08/2048              | 2 293                               | 2 314                            | 0,04                      |
| NTT Finance Corp.                         |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 30/01/2027                            | 8 979                               | 8 932                            | 0,14                      | 4,650 % éch. 25/07/2056              | 31 000                              | 31 050                           | 0,48                      |
| 4,620 % éch. 16/07/2028                   | 200                                 | 200                              | 0,00                      | 5,050 % éch. 30/12/2026                            | 8 089                               | 8 101                            | 0,12                      | 4,728 % éch. 25/11/2054 - 25/10/2055 | 28 741                              | 28 812                           | 0,44                      |
| 4,665 % éch. 20/06/2031 (b)               | 35 000                              | 34 993                           | 0,54                      |                                                    |                                     |                                  |                           | 4,769 % éch. 25/09/2033              | 3 000                               | 2 984                            | 0,05                      |
| 4,713 % éch. 16/07/2028                   | 2 555                               | 2 576                            | 0,04                      |                                                    |                                     |                                  |                           | 4,778 % éch. 25/12/2054 - 25/09/2055 | 74 589                              | 75 384                           | 1,15                      |
| 4,943 % éch. 16/07/2030                   | 18 943                              | 19 304                           | 0,30                      |                                                    |                                     |                                  |                           | 4,828 % éch. 25/12/2054 - 25/08/2055 | 14 940                              | 15 115                           | 0,23                      |
| NXP BV                                    |                                     |                                  |                           |                                                    |                                     |                                  |                           | 4,878 % éch. 25/05/2054              | 10 021                              | 10 160                           | 0,16                      |
| 3,150 % éch. 01/05/2027                   | 8 405                               | 8 319                            | 0,13                      | <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>           |                                     |                                  |                           | 4,928 % éch. 25/03/2055              | 9 924                               | 10 015                           | 0,15                      |
| QatarEnergy                               |                                     |                                  |                           | Fannie Mae                                         |                                     |                                  |                           | 4,944 % éch. 25/02/2045              | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| 4,625 % éch. 23/06/2029                   | 9 100                               | 9 044                            | 0,14                      | 1,630 % éch. 01/05/2027                            | 19 900                              | 19 435                           | 0,30                      | 5,128 % éch. 25/07/2055 - 25/06/2056 | 20 872                              | 21 023                           | 0,32                      |
| QatarEnergy LNG                           |                                     |                                  |                           | 2,080 % éch. 01/10/2026                            | 2 904                               | 2 883                            | 0,04                      | 6,075 % éch. 01/05/2031              | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 6,332 % éch. 30/09/2027                   | 3 215                               | 3 237                            | 0,05                      | 2,110 % éch. 01/02/2027                            | 12 814                              | 12 633                           | 0,19                      | 6,076 % éch. 01/09/2037              | 179                                 | 186                              | 0,00                      |
| RD Michigan Property Owner LLC            |                                     |                                  |                           | 2,170 % éch. 01/09/2026                            | 12 710                              | 12 641                           | 0,19                      | 6,137 % éch. 01/06/2035              | 5                                   | 5                                | 0,00                      |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                   | 11 370                              | 11 339                           | 0,17                      | 2,564 % éch. 25/12/2026                            | 5 774                               | 5 727                            | 0,09                      | 6,522 % éch. 01/09/2035              | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| Renasas Electronics Corp.                 |                                     |                                  |                           | 2,634 % éch. 25/12/2026                            | 2 228                               | 2 208                            | 0,03                      | Ginnie Mae                           |                                     |                                  |                           |
| 2,170 % éch. 25/11/2026                   | 4 709                               | 4 665                            | 0,07                      | 2,638 % éch. 25/03/2037 (a)                        | 142                                 | 11                               | 0,00                      | 2,000 % éch. 20/08/2030              | 26                                  | 25                               | 0,00                      |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.              |                                     |                                  |                           | 2,959 % éch. 25/02/2027                            | 6 459                               | 6 405                            | 0,10                      | 2,250 % éch. 20/02/2027              | 25                                  | 25                               | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/04/2028                   | 12 300                              | 12 419                           | 0,19                      | 2,961 % éch. 25/02/2027                            | 8 101                               | 8 027                            | 0,12                      | 3,000 % éch. 15/09/2026 - 20/05/2047 | 703                                 | 690                              | 0,01                      |
| Sirius XM Radio LLC                       |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 25/10/2040                            | 404                                 | 386                              | 0,01                      | 3,000 % éch. 20/10/2028 (i)          | 1 624                               | 1 600                            | 0,02                      |
| 5,000 % éch. 01/08/2027                   | 5 407                               | 5 402                            | 0,08                      | 3,040 % éch. 01/02/2027                            | 2 443                               | 2 421                            | 0,04                      | 3,500 % éch. 20/12/2068 - 20/01/2069 | 4 305                               | 4 134                            | 0,06                      |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust        |                                     |                                  |                           | 3,061 % éch. 25/05/2027                            | 9 046                               | 8 950                            | 0,14                      | 3,909 % éch. 20/01/2068              | 1 107                               | 1 105                            | 0,02                      |
| 4,100 % éch. 01/10/2029                   | 187                                 | 181                              | 0,00                      | 3,167 % éch. 25/06/2027                            | 4 049                               | 4 003                            | 0,06                      | 3,920 % éch. 20/05/2067              | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| Sysco Corp.                               |                                     |                                  |                           | 3,210 % éch. 01/07/2026                            | 13 980                              | 13 943                           | 0,21                      | 4,000 % éch. 20/08/2055              | 196                                 | 183                              | 0,00                      |
| 5,100 % éch. 23/09/2030                   | 7 766                               | 7 842                            | 0,12                      | 3,470 % éch. 01/11/2034                            | 2 153                               | 2 076                            | 0,03                      | 4,101 % éch. 20/12/2062              | 13                                  | 13                               | 0,00                      |
| Telefonica Emisiones S.A.                 |                                     |                                  |                           | 3,600 % éch. 25/11/2048                            | 760                                 | 725                              | 0,01                      | 4,161 % éch. 20/12/2060              | 52                                  | 52                               | 0,00                      |
| 4,103 % éch. 08/03/2027                   | 7 000                               | 6 973                            | 0,11                      | 4,164 % éch. 25/03/2049 - 25/09/2049               | 2 125                               | 2 115                            | 0,03                      | 4,201 % éch. 20/06/2065              | 55                                  | 55                               | 0,00                      |
| Uber Technologies, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 4,214 % éch. 25/09/2046 - 25/11/2059               | 2 210                               | 2 193                            | 0,03                      | 4,211 % éch. 20/06/2069              | 148                                 | 147                              | 0,00                      |
| 4,500 % éch. 15/08/2029                   | 34 023                              | 33 792                           | 0,52                      | 4,250 % éch. 01/04/2030                            | 14 267                              | 14 148                           | 0,22                      | 4,231 % éch. 20/08/2065              | 67                                  | 67                               | 0,00                      |
| United Airlines Pass-Through Trust        |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 25/12/2047                            | 1 720                               | 1 722                            | 0,03                      | 4,241 % éch. 20/03/2061              | 35                                  | 35                               | 0,00                      |
| 2,700 % éch. 01/11/2033                   | 635                                 | 580                              | 0,01                      | 4,449 % éch. 25/01/2051                            | 4 858                               | 4 878                            | 0,08                      | 4,259 % éch. 20/02/2074 - 20/05/2074 | 3 244                               | 3 254                            | 0,05                      |
| 3,500 % éch. 01/09/2031                   | 435                                 | 420                              | 0,01                      | 4,528 % éch. 25/12/2053 - 25/08/2055               | 33 931                              | 34 105                           | 0,52                      | 4,261 % éch. 20/06/2069 - 20/11/2069 | 2 832                               | 2 830                            | 0,04                      |
| 5,875 % éch. 15/04/2029                   | 591                                 | 598                              | 0,01                      | 4,532 % éch. 01/09/2029                            | 28 431                              | 28 518                           | 0,44                      | 4,275 % éch. 20/07/2064              | 104                                 | 104                              | 0,00                      |
| Viper Energy Partners LLC                 |                                     |                                  |                           | 4,538 % éch. 25/03/2055                            | 25 038                              | 25 217                           | 0,39                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,900 % éch. 01/08/2030                   | 13 750                              | 13 712                           | 0,21                      | 4,549 % éch. 25/12/2050                            | 2 007                               | 2 005                            | 0,03                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| Vmed O2 UK Financing PLC                  |                                     |                                  |                           | 4,578 % éch. 25/11/2053 - 25/03/2055               | 26 969                              | 27 197                           | 0,42                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 15/04/2032                   | 1 000                               | 904                              | 0,01                      | 4,598 % éch. 25/08/2054                            | 1 990                               | 2 004                            | 0,03                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| Volkswagen Group of America Finance LLC   |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 01/04/2030                            | 24 700                              | 24 837                           | 0,38                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,450 % éch. 11/09/2027                   | 6 400                               | 6 381                            | 0,10                      | 4,610 % éch. 01/07/2029                            | 19 598                              | 19 648                           | 0,30                      |                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,550 % éch. 11/09/2028                   | 5 200                               | 5 170                            | 0,08                      | 4,628 % éch. 25/11/2055                            | 4 962                               | 4 999                            | 0,08                      |                                      |                                     |                                  |                           |
|                                           |                                     | <b>469 771</b>                   | <b>7,19</b>               |                                                    |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,309 % éch. 20/02/2074                                        | \$ 702                              | 703                              | 0,01                      | Bear Stearns ALT-A Trust                             | \$ 487                              | \$ 320                           | 0,01                      | HarborView Mortgage Loan Trust                               | \$ 15                               | \$ 15                            | 0,00                      |
| 4,359 % éch. 20/10/2072                                        | 329                                 | 330                              | 0,01                      | 3,985 % éch. 25/08/2036                              | 2 738                               | 1 447                            | 0,02                      | 4,194 % éch. 19/05/2035                                      | 8                                   | 7                                | 0,00                      |
| 4,379 % éch. 20/09/2075                                        | 5 758                               | 5 812                            | 0,09                      | 4,231 % éch. 25/11/2036                              | 5                                   | 3                                | 0,00                      | 5,133 % éch. 19/08/2036                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,389 % éch. 20/10/2075                                        | 7 080                               | 7 138                            | 0,11                      | 4,642 % éch. 25/09/2035                              | 616                                 | 349                              | 0,01                      | Hops Hill PLC                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,399 % éch. 20/04/2074                                        | 1 815                               | 1 831                            | 0,03                      | 4,807 % éch. 25/07/2035                              | 18                                  | 17                               | 0,00                      | 4,614 % éch. 21/04/2056                                      | £ 586                               | 779                              | 0,01                      |
| 4,411 % éch. 20/02/2070                                        | 1 019                               | 1 021                            | 0,02                      | 4,850 % éch. 25/01/2036                              | 1 439                               | 1 436                            | 0,02                      | 4,734 % éch. 21/12/2055                                      | 2 694                               | 3 585                            | 0,06                      |
| 4,421 % éch. 20/12/2065                                        | 120                                 | 120                              | 0,00                      | Bear Stearns Mortgage Funding Trust                  | 258                                 | 229                              | 0,00                      | Impac CMB Trust                                              | \$ 2 043                            | 2 004                            | 0,03                      |
| 4,459 % éch. 20/04/2054 -                                      |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/06/2047                              | 1 066                               | 958                              | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/05/2035                                      |                                     |                                  |                           |
| 20/05/2074                                                     | 20 177                              | 20 285                           | 0,31                      | 4,123 % éch. 25/10/2036                              |                                     |                                  |                           | Jeronimo Funding DAC                                         | € 1 170                             | 1 345                            | 0,02                      |
| 4,461 % éch. 20/10/2065                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust         | 352                                 | 274                              | 0,00                      | 3,415 % éch. 25/10/2064                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,509 % éch. 20/07/2074                                        | 568                                 | 577                              | 0,01                      | 3,918 % éch. 26/12/2046                              | 1 160                               | 810                              | 0,01                      | JPMorgan Alternative Loan Trust                              | \$ 1 280                            | 633                              | 0,01                      |
| 4,511 % éch. 20/11/2065 -                                      |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 26/01/2036                              | 268                                 | 265                              | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/03/2036                                      |                                     |                                  |                           |
| 20/02/2067                                                     | 3 022                               | 3 034                            | 0,05                      | Benchmark Mortgage Trust                             | 832                                 | 827                              | 0,01                      | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust          |                                     |                                  |                           |
| 4,531 % éch. 20/02/2066                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 3,402 % éch. 15/01/2051                              | 1 679                               | 1 675                            | 0,03                      | 3,241 % éch. 15/09/2050                                      | 660                                 | 656                              | 0,01                      |
| 4,561 % éch. 20/01/2066                                        | 41                                  | 41                               | 0,00                      | 4,059 % éch. 15/07/2051                              |                                     |                                  |                           | 5,023 % éch. 15/02/2035                                      | 5 842                               | 5 700                            | 0,09                      |
| 4,709 % éch. 20/05/2073                                        | 297                                 | 302                              | 0,00                      | Blackwattle RMBS Trust                               | AUD 500                             | 346                              | 0,01                      | JPMorgan Mortgage Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,758 % éch. 20/06/2055 -                                      |                                     |                                  |                           | 5,049 % éch. 12/12/2056                              | £ 14 649                            | 19 476                           | 0,30                      | 4,638 % éch. 25/04/2036                                      | 439                                 | 386                              | 0,01                      |
| 20/07/2055                                                     | 36 177                              | 36 649                           | 0,56                      | Bletchley Park Funding PLC                           |                                     |                                  |                           | Jubilee Place BV                                             | € 15 927                            | 18 196                           | 0,28                      |
| 4,809 % éch. 20/08/2053                                        | 6 222                               | 6 305                            | 0,10                      | 4,604 % éch. 27/07/2070                              | 17 308                              | 22 987                           | 0,35                      | 2,900 % éch. 17/10/2061                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,911 % éch. 20/03/2066                                        | 92                                  | 93                               | 0,00                      | Brants Bridge PLC                                    | 266                                 | 354                              | 0,01                      | 3,107 % éch. 17/03/2062                                      | 2 155                               | 2 467                            | 0,04                      |
| 5,125 % éch. 20/10/2029                                        | 3                                   | 3                                | 0,00                      | CD Mortgage Trust                                    |                                     |                                  |                           | 3,127 % éch. 18/09/2062                                      | 1 057                               | 1 209                            | 0,02                      |
| 5,197 % éch. 20/06/2067                                        | 279                                 | 281                              | 0,00                      | 2,622 % éch. 10/08/2049                              | \$ 0                                | 0                                | 0,00                      | 3,207 % éch. 17/09/2060                                      | 1 559                               | 1 787                            | 0,03                      |
| 5,375 % éch. 20/07/2027                                        | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 3,190 % éch. 13/11/2050                              | 9 085                               | 8 965                            | 0,14                      | Kinbane DAC                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 20/04/2041                                        | 85                                  | 87                               | 0,00                      | Citigroup Commercial Mortgage Trust                  | 3 069                               | 3 069                            | 0,05                      | 3,379 % éch. 24/01/2063                                      | 757                                 | 867                              | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 20/02/2055                                        | 61                                  | 62                               | 0,00                      | 2,832 % éch. 10/08/2049                              | 591                                 | 588                              | 0,01                      | La Trobe Financial Capital Markets Trust                     |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 20/06/2055                                        | 781                                 | 803                              | 0,01                      | 3,962 % éch. 10/03/2051                              |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/08/2057                                      | AUD 2 867                           | 1 986                            | 0,03                      |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                  | 31                                  | 29                               | 0,00                      | 5,050 % éch. 15/05/2057                                      | 55                                  | 38                               | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 86 000                              | 79 957                           | 1,22                      | 5,329 % éch. 25/08/2035                              | 20                                  | 20                               | 0,00                      | 5,167 % éch. 13/11/2057                                      | 9 600                               | 6 652                            | 0,10                      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056                                        | 83 700                              | 80 407                           | 1,23                      | 5,900 % éch. 25/10/2035                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 5,300 % éch. 15/08/2057                                      | 6 623                               | 4 583                            | 0,07                      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                      |                                     |                                  |                           | 6,190 % éch. 25/05/2035                              |                                     |                                  |                           | Lanebrook Mortgage Transaction PLC                           |                                     |                                  |                           |
| 01/08/2056                                                     | 81 600                              | 80 410                           | 1,23                      | Countrywide Alternative Loan Trust                   | 42                                  | 38                               | 0,00                      | 4,546 % éch. 15/03/2061                                      | £ 892                               | 1 184                            | 0,02                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                        | 80 100                              | 80 400                           | 1,23                      | 3,949 % éch. 20/12/2046                              | 733                                 | 733                              | 0,01                      | Lehman XS Trust                                              | \$ 1 908                            | 1 932                            | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                        | 79 100                              | 80 573                           | 1,23                      | 3,963 % éch. 25/04/2047                              | 966                                 | 868                              | 0,01                      | 4,123 % éch. 25/11/2035                                      | 7 490                               | 7 170                            | 0,11                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | 3,973 % éch. 25/04/2047                              | 689                                 | 422                              | 0,01                      | 4,123 % éch. 25/07/2037                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/11/2026 -                                      |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/06/2035                              | 52                                  | 49                               | 0,00                      | 4,303 % éch. 25/12/2035                                      | 3 325                               | 3 204                            | 0,05                      |
| 01/02/2027                                                     | 773                                 | 769                              | 0,01                      | 4,083 % éch. 25/02/2047                              | 199                                 | 187                              | 0,00                      | Liberty Trust                                                |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/04/2043 -                                      |                                     |                                  |                           | 4,123 % éch. 25/05/2047                              | 2 858                               | 2 656                            | 0,04                      | 5,305 % éch. 25/04/2058                                      | AUD 1 678                           | 1 164                            | 0,02                      |
| 01/08/2051 (i)                                                 | 1 182                               | 1 138                            | 0,02                      | 4,744 % éch. 25/12/2035                              | 437                                 | 385                              | 0,01                      | London Wall Mortgage Capital PLC                             | £ 6 267                             | 8 336                            | 0,13                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2053 (i)                                    | 3 051                               | 3 081                            | 0,05                      | 5,750 % éch. 25/04/2037                              | 456                                 | 378                              | 0,01                      | 4,738 % éch. 15/05/2057                                      | £ 6 267                             | 8 336                            | 0,13                      |
| 6,000 % éch. 01/11/2053 (i)                                    | 5 377                               | 5 590                            | 0,09                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust    | 2 083                               | 1 847                            | 0,03                      | Lugo Funding DAC                                             | € 1 482                             | 1 693                            | 0,03                      |
| 6,500 % éch. 01/10/2036                                        | 19                                  | 20                               | 0,00                      | 4,223 % éch. 25/05/2035                              | 2 385                               | 2 225                            | 0,03                      | Luminent Mortgage Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 25/02/2035                              |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/10/2046                                      | \$ 107                              | 100                              | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/09/2056                                        | 653 600                             | 654 309                          | 10,02                     | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | 1                                   | 1                                | 0,00                      | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,426 % éch. 25/03/2032                              |                                     |                                  |                           | 4,544 % éch. 25/12/2046                                      | 7 696                               | 6 217                            | 0,10                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates          | 3 557                               | 3 113                            | 0,05                      | Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,703 % éch. 27/12/2037                              | 4 328                               | 4 252                            | 0,07                      | 4,220 % éch. 15/06/2030                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,850 % éch. 25/09/2057                              | 12 073                              | 11 928                           | 0,18                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | CSAIL Commercial Mortgage Trust                      | 1 664                               | 1 660                            | 0,03                      | 4,183 % éch. 25/02/2036                                      | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,033 % éch. 15/04/2051                              | 5 074                               | 5 062                            | 0,08                      | 4,223 % éch. 25/04/2029                                      | 53                                  | 49                               | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,359 % éch. 15/11/2051                              |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/11/2035                                      | 2                                   | 1                                | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | DBGS Mortgage Trust                                  |                                     |                                  |                           | 4,786 % éch. 25/12/2029                                      | 26                                  | 26                               | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Dilosk RMBS DAC                                      | € 787                               | 900                              | 0,01                      | 4,837 % éch. 25/12/2034                                      | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 2,845 % éch. 25/01/2063                              | 14 970                              | 17 127                           | 0,26                      | Merriem Square Residential DAC                               | € 2 137                             | 2 451                            | 0,04                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,080 % éch. 24/09/2060                              | 855                                 | 980                              | 0,02                      | Morgan Stanley Capital Trust                                 | \$ 2 262                            | 2 250                            | 0,03                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,204 % éch. 20/10/2062                              |                                     |                                  |                           | Mortimer BTL PLC                                             | £ 454                               | 603                              | 0,01                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Domi BV                                              | 16 600                              | 18 971                           | 0,29                      | Mortimer Mix PLC                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 2,892 % éch. 15/02/2057                              | 1 478                               | 1 690                            | 0,03                      | 4,579 % éch. 22/09/2067                                      | 867                                 | 1 151                            | 0,02                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,081 % éch. 15/06/2056                              |                                     |                                  |                           | Olympus Trust                                                |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Edenbrook Mortgage Funding PLC                       | £ 944                               | 1 254                            | 0,02                      | 5,262 % éch. 10/04/2057                                      | AUD 14 083                          | 9 744                            | 0,15                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Elstree PLC                                          | 3 603                               | 4 779                            | 0,07                      | Pepper Residential Securities Trust                          | 17 991                              | 12 454                           | 0,19                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Frontier Mortgage Funding PLC                        | 8 575                               | 11 368                           | 0,17                      | 5,299 % éch. 12/07/2067                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,464 % éch. 20/12/2066                              |                                     |                                  |                           | Pierpont BTL PLC                                             | £ 3 492                             | 4 636                            | 0,07                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | GS Mortgage Securities Corp. Trust                   | \$ 0                                | 0                                | 0,00                      | 4,546 % éch. 22/12/2053                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 10/07/2051                              | 61                                  | 61                               | 0,00                      | Polaris PLC                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | GS Mortgage Securities Corp. Trust                   |                                     |                                  |                           | 4,464 % éch. 27/06/2070                                      | 22 400                              | 29 667                           | 0,45                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 3,178 % éch. 10/11/2049                              |                                     |                                  |                           | 4,505 % éch. 25/08/2068                                      | 3 178                               | 4 215                            | 0,06                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | GSR Mortgage Loan Trust                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      | 4,555 % éch. 26/02/2068                                      | 4 871                               | 6 465                            | 0,10                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,113 % éch. 25/01/2034                              |                                     |                                  |                           | Prime Mortgage Trust                                         | \$ 9                                | 8                                | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 4,163 % éch. 25/02/2034                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | Project Cashmere                                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                  | AUD 45 300                          | 31 281                           | 0,48                      |

## OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN

Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)

1,625 % éch. 15/04/2030 (i) 125 188 123 702 1,89

## TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

AFG Trust

5,012 % éch. 10/10/2057 AUD 8 855 6 133 0,09

5,262 % éch. 10/10/2057 27 300 18 864 0,29

American Home Mortgage Assets Trust

4,143 % éch. 25/09/2046 \$ 72 71 0,00

American Home Mortgage Investment Trust

4,043 % éch. 25/03/2046 235 218 0,00

Ashford Hospitality Trust

5,048 % éch. 15/04/2035 6 200 6 202 0,10

Atlas Funding PLC

4,563 % éch. 20/01/2068 £ 8 900 11 836 0,18

4,586 % éch. 20/09/2061 620 824 0,01

Avon Finance PLC

4,646 % éch. 28/12/2049 4 552 6 044 0,09

Banc of America Funding Trust

3,795 % éch. 26/10/2036 \$ 2 946 2 854 0,04

5,365 % éch. 25/05/2035 1 1 0,00

5,608 % éch. 20/02/2036 6 6 0,00

Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.

3,265 % éch. 15/09/2060 389 387 0,01

3,289 % éch. 15/07/2060 106 106 0,00

4,185 % éch. 15/09/2060 3 670 3 654 0,06

Barclays Commercial Mortgage Securities Trust

3,488 % éch. 15/02/2050 36 36 0,00

Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust

6,156 % éch. 25/01/2034 4 4 0,00

## Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

| DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)           | JUSTE EN % DE<br>VALEUR<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |       |      |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------|------|
| Puma Trust                                          |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                       |                                               |                                           | 2,889 % éch. 27/06/2035          | € 99                                                 | \$ 114                           | 0,00                      |       |      |
| 5,108 % éch. 18/01/2057                             | AUD                                 | 8 949                            | \$ 6 183                  | 0,09                                                             | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES |                                           | Retail Automotive CP Germany UG  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust              |                                     |                                  |                           | Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-Four SRL |                                               |                                           | 2,985 % éch. 21/07/2034          | 1 337                                                | 1 531                            | 0,02                      |       |      |
| 6,500 % éch. 25/08/2036                             | \$                                  | 621                              | 519                       | 0,01                                                             | 2,849 % éch. 16/08/2040                       | € 8 082                                   | \$ 9 273                         | 0,14                                                 | Revocar UG                       |                           |       |      |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust |                                     |                                  |                           | Auto ABS French Loans                                            |                                               |                                           | 2,845 % éch. 21/02/2037          | 706                                                  | 808                              | 0,01                      |       |      |
| 5,392 % éch. 25/09/2035                             |                                     | 393                              | 244                       | 0,00                                                             | 2,829 % éch. 24/07/2036                       | 2 913                                     | 3 332                            | 0,05                                                 | 2,945 % éch. 21/04/2036          | 242                       | 277   | 0,00 |
| Resimac Bastille Trust                              |                                     |                                  |                           | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                                |                                               |                                           | SC Nordics SARL Rahoituspalvelut |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 5,158 % éch. 09/12/2057                             | AUD                                 | 6 200                            | 4 296                     | 0,07                                                             | 2,939 % éch. 29/12/2036                       | 599                                       | 686                              | 0,01                                                 | 2,849 % éch. 25/12/2035          | 5 186                     | 5 930 | 0,09 |
| 5,349 % éch. 12/02/2057                             |                                     | 15 279                           | 10 588                    | 0,16                                                             | 2,939 % éch. 28/12/2040                       | 4 299                                     | 4 929                            | 0,08                                                 | SCF Rahoituspalvelut DAC         |                           |       |      |
| 5,558 % éch. 09/12/2057                             |                                     | 11 300                           | 7 835                     | 0,12                                                             | Auto ABS Spanish Loans                        |                                           |                                  | 2,842 % éch. 25/06/2032                              | 245                              | 280                       | 0,00  |      |
| Resimac Premier Trust                               |                                     |                                  |                           | 2,521 % éch. 28/02/2032                                          | 1 768                                         | 2 022                                     | 0,03                             | 2,859 % éch. 25/06/2034                              | 142                              | 162                       | 0,00  |      |
| 5,423 % éch. 11/02/2058                             |                                     | 15 800                           | 10 948                    | 0,17                                                             | 3,059 % éch. 28/09/2038                       | 14 653                                    | 16 792                           | 0,26                                                 | 2,979 % éch. 25/06/2033          | 2 788                     | 3 191 | 0,05 |
| RMAC PLC                                            |                                     |                                  |                           | Auto1 Car Funding SARL                                           |                                               |                                           | Silver Arrow S.A., Compartiment  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 4,947 % éch. 15/02/2047                             | £                                   | 1 044                            | 1 387                     | 0,02                                                             | 2,829 % éch. 15/12/2033                       | 5 943                                     | 6 804                            | 0,10                                                 | 2,569 % éch. 15/02/2030          | 519                       | 593   | 0,01 |
| Sapphire Trust Central Finance                      |                                     |                                  |                           | AutoFlorence SRL                                                 |                                               |                                           | 4,284 % éch. 20/01/2031          | 166                                                  | 220                              | 0,00                      |       |      |
| 5,131 % éch. 12/03/2068                             | AUD                                 | 7 900                            | 5 474                     | 0,08                                                             | 3,192 % éch. 25/12/2046                       | 524                                       | 602                              | 0,01                                                 |                                  | 279 198                   | 4,27  |      |
| 5,299 % éch. 12/02/2067                             |                                     | 11 300                           | 7 823                     | 0,12                                                             | Autonoria Spain                               |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| Sequoia Mortgage Trust                              |                                     |                                  |                           | 2,942 % éch. 30/09/2041                                          | 985                                           | 1 129                                     | 0,02                             | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES           |                                  |                           |       |      |
| 4,354 % éch. 20/12/2034                             | \$                                  | 67                               | 62                        | 0,00                                                             | Bavarian Sky S.A.                             |                                           |                                  | COMMERCIALES AUTRES                                  |                                  |                           |       |      |
| Stratton Mortgage Funding PLC                       |                                     |                                  |                           | 2,695 % éch. 20/03/2030                                          | 58                                            | 66                                        | 0,00                             | ACREC LLC                                            |                                  |                           |       |      |
| 4,646 % éch. 28/06/2050                             | £                                   | 3 189                            | 4 235                     | 0,07                                                             | 2,735 % éch. 20/11/2031                       | 116                                       | 133                              | 0,00                                                 | 4,947 % éch. 18/08/2042          | \$ 6 900                  | 6 904 | 0,11 |
| 4,649 % éch. 28/06/2050                             |                                     | 552                              | 733                       | 0,01                                                             | BBVA Consumer Auto                            |                                           |                                  | FS Rialto Issuer LLC                                 |                                  |                           |       |      |
| 4,721 % éch. 25/06/2049                             |                                     | 2 360                            | 3 134                     | 0,05                                                             | 3,117 % éch. 19/03/2038                       | 13 056                                    | 14 976                           | 0,23                                                 | 5,089 % éch. 19/01/2044          | 1 000                     | 1 003 | 0,01 |
| 4,896 % éch. 20/06/2060                             |                                     | 592                              | 786                       | 0,01                                                             | Bumper NL BV                                  |                                           |                                  | MF1 LLC                                              |                                  |                           |       |      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust      |                                     |                                  |                           | 2,879 % éch. 24/01/2037                                          | 3 100                                         | 3 548                                     | 0,06                             | 4,957 % éch. 18/02/2040                              | 10 000                           | 10 006                    | 0,15  |      |
| 4,083 % éch. 25/10/2035                             | \$                                  | 1 341                            | 1 302                     | 0,02                                                             | 2,925 % éch. 21/03/2036                       | 14 868                                    | 17 026                           | 0,26                                                 | 5,087 % éch. 18/02/2043          | 2 000                     | 2 004 | 0,03 |
| 5,144 % éch. 25/01/2035                             |                                     | 15                               | 14                        | 0,00                                                             | 2,955 % éch. 22/03/2035                       | 855                                       | 978                              | 0,02                                                 |                                  |                           |       |      |
| 5,923 % éch. 25/02/2034                             |                                     | 5                                | 5                         | 0,00                                                             | Cars Alliance Auto Loans Germany              |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust         |                                     |                                  |                           | 2,729 % éch. 18/01/2036                                          | 13 660                                        | 15 623                                    | 0,24                             |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 4,123 % éch. 25/09/2047                             |                                     | 485                              | 463                       | 0,01                                                             | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC      |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 4,254 % éch. 19/07/2035                             |                                     | 6                                | 6                         | 0,00                                                             | 2,814 % éch. 15/12/2032                       | 62                                        | 70                               | 0,00                                                 |                                  |                           |       |      |
| 4,323 % éch. 25/02/2036                             |                                     | 6                                | 5                         | 0,00                                                             | Driver Australia Eleven                       |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 5,144 % éch. 25/12/2035                             |                                     | 33                               | 28                        | 0,00                                                             | 5,300 % éch. 21/11/2033                       | AUD 1 563                                 | 1 084                            | 0,02                                                 |                                  |                           |       |      |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                 |                                     |                                  |                           | E-Carat DE                                                       |                                               |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 4,403 % éch. 25/09/2043                             |                                     | 177                              | 175                       | 0,00                                                             | 2,400 % éch. 25/11/2035                       | € 1 132                                   | 1 294                            | 0,02                                                 |                                  |                           |       |      |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                     |                                     |                                  |                           | FACT S.A.                                                        |                                               |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| 4,584 % éch. 20/04/2051                             | £                                   | 16 962                           | 22 515                    | 0,34                                                             | 2,935 % éch. 22/09/2031                       | 13 445                                    | 15 400                           | 0,24                                                 |                                  |                           |       |      |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                             |                                     | 4 726                            | 6 276                     | 0,10                                                             | First Mobility SARL                           |                                           |                                  |                                                      |                                  |                           |       |      |
| Towd Point Mortgage Trust                           |                                     |                                  |                           | 2,809 % éch. 14/10/2032                                          | 767                                           | 879                                       | 0,01                             | Asset-Backed Funding Certificates Trust              |                                  |                           |       |      |
| 3,750 % éch. 25/10/2056                             | \$                                  | 6 980                            | 6 891                     | 0,11                                                             | First Mobility Swiss Lease                    |                                           |                                  | 4,083 % éch. 25/11/2036                              | 5 566                            | 2 241                     | 0,03  |      |
| Tower Bridge Funding PLC                            |                                     |                                  |                           | 2,959 % éch. 23/09/2033                                          | 20 404                                        | 23 359                                    | 0,36                             | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust           |                                  |                           |       |      |
| 4,497 % éch. 20/01/2073                             | £                                   | 4 954                            | 6 570                     | 0,10                                                             | FTA Santander Consumer Spain Auto             |                                           |                                  | 4,083 % éch. 25/08/2036                              | 306                              | 300                       | 0,00  |      |
| 4,538 % éch. 20/12/2066                             |                                     | 8 290                            | 11 006                    | 0,17                                                             | 3,236 % éch. 22/09/2039                       | 10 560                                    | 12 106                           | 0,19                                                 | 4,273 % éch. 25/12/2036          | 208                       | 207   | 0,00 |
| 4,627 % éch. 20/05/2066                             |                                     | 362                              | 481                       | 0,01                                                             | Fulvia SPV SRL                                |                                           |                                  | Carrington Mortgage Loan Trust                       |                                  |                           |       |      |
| Triton Bond Trust                                   |                                     |                                  |                           | 3,030 % éch. 23/12/2041                                          | 10 453                                        | 11 978                                    | 0,18                             | 4,753 % éch. 25/06/2035                              | 195                              | 196                       | 0,00  |      |
| 5,000 % éch. 15/02/2058                             | AUD                                 | 13 197                           | 9 141                     | 0,14                                                             | Globaldrive Auto Receivables BV               |                                           |                                  | Chase Funding Trust                                  |                                  |                           |       |      |
| 5,250 % éch. 15/02/2058                             |                                     | 18 800                           | 12 987                    | 0,20                                                             | 2,715 % éch. 22/06/2032                       | 459                                       | 525                              | 0,01                                                 | 4,503 % éch. 25/10/2032          | 1                         | 1     | 0,00 |
| Twin Bridges PLC                                    |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                                    |                                               |                                           |                                  | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.    |                                  |                           |       |      |
| 4,517 % éch. 12/12/2055                             | £                                   | 5 855                            | 7 770                     | 0,12                                                             | 3,436 % éch. 22/09/2043                       | 1 978                                     | 2 274                            | 0,04                                                 | 4,043 % éch. 25/02/2037          | 442                       | 427   | 0,01 |
| 4,927 % éch. 15/05/2056                             |                                     | 175                              | 233                       | 0,00                                                             | Hiil FL BV                                    |                                           |                                  | 4,043 % éch. 25/03/2037                              | 375                              | 371                       | 0,01  |      |
| UBS Commercial Mortgage Trust                       |                                     |                                  |                           | 2,929 % éch. 18/10/2032                                          | 13 489                                        | 15 434                                    | 0,24                             | 4,163 % éch. 25/08/2034                              | 88                               | 85                        | 0,00  |      |
| 3,225 % éch. 15/08/2050                             | \$                                  | 928                              | 917                       | 0,01                                                             | 2,969 % éch. 18/05/2031                       | 3 240                                     | 3 707                            | 0,06                                                 | 4,303 % éch. 25/03/2036          | 443                       | 406   | 0,01 |
| 3,264 % éch. 15/08/2050                             |                                     | 297                              | 297                       | 0,00                                                             | Koromo Italy Compartiment                     |                                           |                                  | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |                                  |                           |       |      |
| 3,903 % éch. 15/02/2051                             |                                     | 1 911                            | 1 899                     | 0,03                                                             | 2,905 % éch. 26/02/2032                       | 707                                       | 810                              | 0,01                                                 | 4,049 % éch. 25/01/2032          | 1                         | 1     | 0,00 |
| 4,030 % éch. 15/08/2051                             |                                     | 15 722                           | 15 535                    | 0,24                                                             | Koromo UK PLC                                 |                                           |                                  | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC    |                                  |                           |       |      |
| 4,197 % éch. 15/12/2051                             |                                     | 1 801                            | 1 784                     | 0,03                                                             | 4,305 % éch. 23/11/2032                       | £ 5 000                                   | 6 638                            | 0,10                                                 | 5,338 % éch. 25/03/2046          | 1 238                     | 1 219 | 0,02 |
| 4,391 % éch. 15/12/2051                             |                                     | 2 635                            | 2 627                     | 0,04                                                             | 4,335 % éch. 23/10/2034                       | 4 869                                     | 6 466                            | 0,10                                                 | Ellington Loan Acquisition Trust |                           |       |      |
| Verus Securitization Trust                          |                                     |                                  |                           | LT Autorahoitus DAC                                              |                                               |                                           |                                  | 4,813 % éch. 25/05/2037                              | 1 093                            | 1 075                     | 0,02  |      |
| 2,829 % éch. 25/10/2066                             |                                     | 4 366                            | 3 986                     | 0,06                                                             | 2,899 % éch. 18/07/2033                       | € 2 469                                   | 2 826                            | 0,04                                                 | EquiFirst Mortgage Loan Trust    |                           |       |      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust       |                                     |                                  |                           | 3,109 % éch. 18/12/2032                                          | 700                                           | 801                                       | 0,01                             | 5,488 % éch. 25/12/2034                              | 307                              | 305                       | 0,00  |      |
| 4,303 % éch. 25/12/2045                             |                                     | 3                                | 4                         | 0,00                                                             | LT Rahoitus DAC                               |                                           |                                  | Fremont Home Loan Trust                              |                                  |                           |       |      |
| 4,343 % éch. 25/10/2045                             |                                     | 2                                | 2                         | 0,00                                                             | 2,749 % éch. 18/07/2036                       | 802                                       | 916                              | 0,01                                                 | 4,103 % éch. 25/02/2037          | 3 630                     | 1 097 | 0,02 |
| 4,379 % éch. 25/08/2046                             |                                     | 18                               | 17                        | 0,00                                                             | Panorama Auto Trust                           |                                           |                                  | GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates        |                                  |                           |       |      |
| 4,408 % éch. 25/10/2035                             |                                     | 172                              | 158                       | 0,00                                                             | 5,230 % éch. 20/04/2034                       | AUD 55 777                                | 38 617                           | 0,59                                                 | 4,403 % éch. 25/12/2035          | 1 815                     | 1 764 | 0,03 |
| 4,444 % éch. 25/03/2047                             |                                     | 1 442                            | 1 302                     | 0,02                                                             | 5,367 % éch. 20/05/2034                       | 11 200                                    | 7 760                            | 0,12                                                 | GSAA Home Equity Trust           |                           |       |      |
| 4,683 % éch. 25/10/2044                             |                                     | 300                              | 298                       | 0,00                                                             | Plenti Auto ABS                               |                                           |                                  | 4,263 % éch. 25/01/2036                              | 874                              | 270                       | 0,00  |      |
| 4,743 % éch. 25/10/2045                             |                                     | 1 107                            | 1 074                     | 0,02                                                             | 5,399 % éch. 12/08/2033                       | 250                                       | 174                              | 0,00                                                 | GSAMP Trust                      |                           |       |      |
| 4,923 % éch. 25/11/2045                             |                                     | 661                              | 637                       | 0,01                                                             | Pulse UK PLC                                  |                                           |                                  | 4,043 % éch. 25/12/2036                              | 875                              | 466                       | 0,01  |      |
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust               |                                     |                                  |                           | 4,397 % éch. 27/05/2036                                          | £ 2 480                                       | 3 292                                     | 0,05                             | 4,063 % éch. 25/09/2036                              | 2 540                            | 865                       | 0,01  |      |
| 3,374 % éch. 15/12/2059                             |                                     | 2 046                            | 2 040                     | 0,03                                                             | Red & Black Auto Italy SRL                    |                                           |                                  | 4,663 % éch. 25/11/2035                              | 897                              | 884                       | 0,01  |      |
| 3,390 % éch. 15/11/2050                             |                                     | 246                              | 245                       | 0,00                                                             | 3,019 % éch. 28/07/2036                       | € 9 593                                   | 11 014                           | 0,17                                                 | Home Equity Asset Trust          |                           |       |      |
| 3,951 % éch. 15/03/2051                             |                                     | 3 280                            | 3 263                     | 0,05                                                             | 3,209 % éch. 28/07/2034                       | 466                                       | 535                              | 0,01                                                 | 4,460 % éch. 25/10/2035          | 1 634                     | 1 619 | 0,03 |
| 4,365 % éch. 15/09/2061                             |                                     | 5 486                            | 5 468                     | 0,08                                                             | Red & Black Auto Lease France                 |                                           |                                  | 4,468 % éch. 25/01/2036                              | 650                              | 625                       | 0,01  |      |
| Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust        |                                     |                                  |                           | 2,513 % éch. 27/06/2039                                          | 187                                           | 214                                       | 0,00                             | HSI Asset Securitization Corp. Trust                 |                                  |                           |       |      |
| 6,099 % éch. 25/04/2036                             |                                     | 872                              | 872                       | 0,01                                                             |                                               |                                           |                                  | 4,543 % éch. 25/01/2036                              | 1 200                            | 1 043                     | 0,02  |      |
|                                                     |                                     |                                  | 596 061                   | 9,13                                                             |                                               |                                           |                                  | JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.                  |                                  |                           |       |      |
|                                                     |                                     |                                  |                           |                                                                  |                                               |                                           |                                  | 4,693 % éch. 25/12/2035                              | 541                              | 535                       | 0,00  |      |



| DESCRIPTION                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                   |                                     |                                  |                           | Ballyrock CLO Ltd.                                |                                     |                                  |                           | Marzio Finance SRL                          |                                     |                                  |                           |
| 4,198 % éch. 25/05/2036                                               | \$ 376                              | \$ 360                           | 0,01                      | 5,177 % éch. 25/07/2037                           | \$ 1 000                            | \$ 1 002                         | 0,01                      | 2,751 % éch. 28/09/2049                     | € 622                               | \$ 713                           | 0,01                      |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                        |                                     |                                  |                           | Barings Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | 2,801 % éch. 28/05/2049                     | 612                                 | 702                              | 0,01                      |
| 4,203 % éch. 25/02/2036                                               | 450                                 | 446                              | 0,01                      | 3,426 % éch. 15/08/2039                           | € 1 000                             | 1 144                            | 0,02                      | Mila BV                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,323 % éch. 25/10/2034                                               | 4                                   | 4                                | 0,00                      | 3,444 % éch. 21/10/2038                           | 1 200                               | 1 374                            | 0,02                      | 2,936 % éch. 16/09/2041                     | 638                                 | 731                              | 0,01                      |
| 4,363 % éch. 25/01/2036                                               | 269                                 | 243                              | 0,00                      | BBAM European CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                |                                     |                                  |                           | 3,124 % éch. 15/01/2036                           | 1 523                               | 1 741                            | 0,03                      | 3,085 % éch. 25/10/2034                     | 1 000                               | 1 143                            | 0,02                      |
| 3,893 % éch. 25/10/2036                                               | 582                                 | 524                              | 0,01                      | BBVA Consumer FTA                                 |                                     |                                  |                           | Noria DE                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,263 % éch. 25/04/2036                                               | 1 249                               | 1 206                            | 0,02                      | 2,931 % éch. 21/08/2038                           | 3 495                               | 4 003                            | 0,06                      | 2,832 % éch. 25/02/2043                     | 8 697                               | 9 941                            | 0,15                      |
| 4,618 % éch. 25/03/2034                                               | 384                                 | 396                              | 0,01                      | Black Diamond CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | Ocean Trails CLO                            |                                     |                                  |                           |
| 4,678 % éch. 25/07/2034                                               | 553                                 | 566                              | 0,01                      | 2,500 % éch. 15/05/2032                           | \$ 308                              | 308                              | 0,00                      | 4,705 % éch. 20/07/2034                     | \$ 9 300                            | 9 304                            | 0,14                      |
| 4,678 % éch. 25/09/2034                                               | 1 096                               | 1 114                            | 0,02                      | 3,263 % éch. 15/05/2032                           | € 1 719                             | 1 966                            | 0,03                      | 4,973 % éch. 15/10/2034                     | 3 700                               | 3 705                            | 0,06                      |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                                 |                                     |                                  |                           | 4,133 % éch. 15/05/2032                           | 1 000                               | 1 147                            | 0,02                      | 5,373 % éch. 15/10/2034                     | 8 800                               | 8 821                            | 0,13                      |
| 4,083 % éch. 25/04/2036                                               | 165                                 | 113                              | 0,00                      | Blackrock European CLO DAC                        |                                     |                                  |                           | OCP Euro CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                    |                                     |                                  |                           | 3,118 % éch. 19/07/2035                           | 8 723                               | 9 985                            | 0,15                      | 3,478 % éch. 20/07/2036                     | € 1 500                             | 1 716                            | 0,03                      |
| 3,943 % éch. 25/12/2036                                               | 1 615                               | 534                              | 0,01                      | BPCE Consumer Loans FCT                           |                                     |                                  |                           | Palmer Square BDC CLO Ltd.                  |                                     |                                  |                           |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust                  |                                     |                                  |                           | 2,879 % éch. 31/10/2042                           | 1 090                               | 1 249                            | 0,02                      | 5,273 % éch. 15/07/2037                     | \$ 500                              | 500                              | 0,01                      |
| 4,393 % éch. 25/02/2036                                               | 1 051                               | 956                              | 0,01                      | Cairn CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           | Palmer Square European Loan Funding DAC     |                                     |                                  |                           |
| Option One Mortgage Loan Trust                                        |                                     |                                  |                           | 2,820 % éch. 31/01/2030                           | 159                                 | 182                              | 0,00                      | 3,054 % éch. 15/10/2034                     | € 995                               | 1 138                            | 0,02                      |
| 3,983 % éch. 25/04/2037                                               | 1 635                               | 1 176                            | 0,02                      | 3,434 % éch. 15/01/2040                           | 7 950                               | 9 097                            | 0,14                      | 3,134 % éch. 15/07/2035                     | 926                                 | 1 059                            | 0,02                      |
| Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           | Canyon Capital CLO Ltd.                           |                                     |                                  |                           | 3,253 % éch. 15/05/2033                     | 162                                 | 185                              | 0,00                      |
| 4,498 % éch. 25/11/2035                                               | 274                                 | 243                              | 0,00                      | 4,683 % éch. 15/10/2034                           | \$ 4 200                            | 4 204                            | 0,06                      | 3,273 % éch. 15/05/2034                     | 10 379                              | 11 881                           | 0,18                      |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates    |                                     |                                  |                           | Capital Four CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | 3,283 % éch. 15/05/2034                     | 14 697                              | 16 824                           | 0,26                      |
| 5,083 % éch. 25/01/2036                                               | 822                                 | 791                              | 0,01                      | 3,415 % éch. 25/10/2038                           | € 3 000                             | 3 434                            | 0,05                      | 3,433 % éch. 15/02/2035                     | 1 760                               | 2 014                            | 0,03                      |
| Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                               |                                     |                                  |                           | Carlyle Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | 3,754 % éch. 15/10/2034                     | 1 000                               | 1 143                            | 0,02                      |
| 4,633 % éch. 25/02/2036                                               | 1 252                               | 1 198                            | 0,02                      | 3,173 % éch. 15/08/2032                           | 1 077                               | 1 232                            | 0,02                      | 3,933 % éch. 15/05/2033                     | 1 000                               | 1 146                            | 0,02                      |
| Residential Asset Mortgage Products Trust                             |                                     |                                  |                           | 3,493 % éch. 15/08/2038                           | 6 700                               | 7 675                            | 0,12                      | 4,133 % éch. 15/05/2034                     | 15 000                              | 17 226                           | 0,26                      |
| 4,303 % éch. 25/02/2036                                               | 838                                 | 806                              | 0,01                      | Contego CLO BV                                    |                                     |                                  |                           | Park Blue CLO Ltd.                          |                                     |                                  |                           |
| 4,828 % éch. 25/05/2035                                               | 1 754                               | 1 685                            | 0,03                      | 3,454 % éch. 15/04/2038                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | 5,095 % éch. 20/07/2037                     | \$ 4 600                            | 4 613                            | 0,07                      |
| Residential Asset Securities Corp. Trust                              |                                     |                                  |                           | Cumulus Static CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | Pikes Peak CLO                              |                                     |                                  |                           |
| 4,043 % éch. 25/07/2036                                               | 856                                 | 840                              | 0,01                      | 3,483 % éch. 15/11/2033                           | 294                                 | 336                              | 0,01                      | 4,883 % éch. 15/07/2034                     | 10 000                              | 10 011                           | 0,15                      |
| Saxon Asset Securities Trust                                          |                                     |                                  |                           | CVC Cordatus Loan Fund DAC                        |                                     |                                  |                           | 4,895 % éch. 11/10/2034                     | 10 000                              | 10 012                           | 0,15                      |
| 4,663 % éch. 26/12/2034                                               | 87                                  | 85                               | 0,00                      | 3,066 % éch. 25/04/2036                           | 9 300                               | 10 639                           | 0,16                      | Plenti PL & Green ABS Trust                 |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Investment Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | 3,285 % éch. 23/01/2039                           | 9 300                               | 10 648                           | 0,16                      | 5,276 % éch. 11/07/2037                     | AUD 3 571                           | 2 471                            | 0,04                      |
| 3,943 % éch. 25/09/2036                                               | 5 840                               | 3 587                            | 0,06                      | Dryden Euro CLO DAC                               |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC                            |                                     |                                  |                           |
| 4,383 % éch. 25/01/2036                                               | 926                                 | 874                              | 0,01                      | 1,950 % éch. 18/10/2034                           | 1 000                               | 1 048                            | 0,02                      | 3,364 % éch. 15/10/2038                     | € 5 700                             | 6 527                            | 0,10                      |
| 4,528 % éch. 25/08/2035                                               | 871                                 | 850                              | 0,01                      | 3,143 % éch. 15/05/2034                           | 278                                 | 318                              | 0,00                      | Riserva CLO Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                 |                                     |                                  |                           | 3,144 % éch. 15/01/2034                           | 3 191                               | 3 653                            | 0,06                      | 4,725 % éch. 18/01/2034                     | \$ 824                              | 824                              | 0,01                      |
| 4,033 % éch. 25/03/2036                                               | 1 131                               | 1 065                            | 0,02                      | 3,498 % éch. 18/10/2039                           | 1 000                               | 1 144                            | 0,02                      | Rockfield Park CLO DAC                      |                                     |                                  |                           |
| 4,073 % éch. 25/08/2046                                               | 2 363                               | 2 192                            | 0,03                      | FCT Ponant                                        |                                     |                                  |                           | 3,143 % éch. 16/07/2034                     | € 12 235                            | 13 999                           | 0,21                      |
| 4,083 % éch. 25/10/2036                                               | 1 334                               | 912                              | 0,01                      | 2,855 % éch. 27/09/2038                           | 404                                 | 462                              | 0,01                      | Rockford Tower Europe CLO DAC               |                                     |                                  |                           |
| 4,183 % éch. 25/02/2037                                               | 700                                 | 689                              | 0,01                      | FTA Santander Consumo                             |                                     |                                  |                           | 3,121 % éch. 24/01/2035                     | 1 800                               | 2 058                            | 0,03                      |
| Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust                     |                                     |                                  |                           | 3,106 % éch. 21/12/2037                           | 493                                 | 565                              | 0,01                      | 3,489 % éch. 29/08/2036                     | 1 100                               | 1 259                            | 0,02                      |
| 4,073 % éch. 25/08/2036                                               | 647                                 | 607                              | 0,01                      | 3,236 % éch. 21/03/2036                           | 250                                 | 287                              | 0,00                      | Sabadell Consumo FT                         |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     | 52 696                           | 0,81                      | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                                  |                           | 3,085 % éch. 22/10/2035                     | 8 328                               | 9 542                            | 0,15                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 2,918 % éch. 25/10/2035                           | 4 004                               | 4 582                            | 0,07                      | SC Germany S.A., Compartment Consumer       |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,095 % éch. 25/02/2034                           | 2 913                               | 3 343                            | 0,05                      | 2,779 % éch. 16/12/2041                     | 1 399                               | 1 601                            | 0,02                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Ginkgo Sales Finance                              |                                     |                                  |                           | 2,829 % éch. 14/05/2038                     | 6 153                               | 7 054                            | 0,11                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 2,942 % éch. 25/11/2049                           | 1 439                               | 1 649                            | 0,02                      | 2,849 % éch. 15/09/2037                     | 8 896                               | 10 190                           | 0,16                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                     |                                     |                                  |                           | SLM Private Credit Student Loan Trust       |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,136 % éch. 20/12/2044                           | 4 162                               | 4 771                            | 0,07                      | 4,166 % éch. 16/12/2041                     | \$ 484                              | 478                              | 0,01                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,216 % éch. 22/09/2043                           | 9 586                               | 11 007                           | 0,17                      | 4,256 % éch. 15/06/2039                     | 933                                 | 921                              | 0,01                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.          |                                     |                                  |                           | SLM Student Loan Trust                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/10/2034                           | \$ 10 000                           | 10 012                           | 0,15                      | 2,565 % éch. 25/10/2039                     | € 5 308                             | 5 680                            | 0,09                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Grosvenor Place CLO DAC                           |                                     |                                  |                           | St. Paul's CLO DAC                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,383 % éch. 15/08/2039                           | € 1 000                             | 1 144                            | 0,02                      | 3,090 % éch. 17/01/2032                     | 4 548                               | 5 204                            | 0,08                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,444 % éch. 15/01/2039                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | Symphony CLO Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Harvest CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           | 4,725 % éch. 19/04/2034                     | \$ 1 600                            | 1 601                            | 0,02                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,464 % éch. 15/10/2038                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | 4,901 % éch. 16/04/2031                     | 97                                  | 97                               | 0,00                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Hayfin Emerald CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | Tikehau CLO DAC                             |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 22/01/2039                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | 3,404 % éch. 15/10/2038                     | € 1 000                             | 1 145                            | 0,02                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,449 % éch. 17/11/2037                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | Toro European CLO DAC                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,454 % éch. 15/10/2038                           | 1 000                               | 1 144                            | 0,02                      | 3,093 % éch. 15/02/2034                     | 3 710                               | 4 245                            | 0,06                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,498 % éch. 18/10/2039                           | 8 500                               | 9 726                            | 0,15                      | 3,474 % éch. 15/04/2037                     | 28 900                              | 33 080                           | 0,51                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Henley CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           | Trinitas CLO Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,165 % éch. 10/06/2034                           | 5 000                               | 5 726                            | 0,09                      | 4,715 % éch. 20/07/2035                     | \$ 5 600                            | 5 600                            | 0,09                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | ICG Euro CLO DAC                                  |                                     |                                  |                           | 4,777 % éch. 25/01/2034                     | 1 162                               | 1 163                            | 0,02                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,455 % éch. 26/01/2038                           | 9 800                               | 11 216                           | 0,17                      | 4,785 % éch. 20/10/2033                     | 5 933                               | 5 938                            | 0,09                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Indigo Credit Management DAC                      |                                     |                                  |                           | 4,825 % éch. 20/10/2034                     | 1 800                               | 1 802                            | 0,03                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,404 % éch. 15/07/2038                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | Trinitas Euro CLO DAC                       |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | Invesco Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | 3,414 % éch. 15/07/2039                     | € 1 000                             | 1 145                            | 0,02                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,260 % éch. 30/10/2038                           | 19 100                              | 21 864                           | 0,33                      | Venture CLO Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,277 % éch. 15/07/2037                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | 5,195 % éch. 15/01/2032                     | \$ 168                              | 169                              | 0,00                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,454 % éch. 22/10/2036                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,02                      | Voya Euro CLO DAC                           |                                     |                                  |                           |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 3,904 % éch. 15/04/2033                           | 1 000                               | 1 147                            | 0,02                      | 3,164 % éch. 15/07/2035                     | € 15 500                            | 17 732                           | 0,27                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | KKR CLO Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | 3,174 % éch. 15/10/2034                     | 20 000                              | 22 881                           | 0,35                      |
|                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,935 % éch. 15/04/2031                           | \$ 200                              | 200                              | 0,00                      |                                             |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)      | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                                                            | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                                                               | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET                                                                    | DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                   | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET                                    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| Whetstone Park CLO Ltd.<br>4,745 % éch. 20/01/2035                                                            | \$ 900                                   | \$ 901                           | 0,01                      | Constellation Energy Corp.<br>4,060 % éch. 07/07/2026<br>4,110 % éch. 03/08/2026<br>4,110 % éch. 04/08/2026<br>4,120 % éch. 05/08/2026                                                                                                                                                                                                        | \$ 3 100<br>6 300<br>8 400<br>8 400                                                                            | \$ 3 097<br>6 273<br>8 363<br>8 362                                                                            | 0,05<br>0,10<br>0,13<br>0,13                                                                 | Tampa Electric Co.<br>4,040 % éch. 14/07/2026<br>4,050 % éch. 21/07/2026<br>4,060 % éch. 08/07/2026<br>4,060 % éch. 09/07/2026                                                                                                      | \$ 9 400<br>8 400<br>10 900<br>18 400                              | \$ 9 386<br>8 381<br>10 890<br>18 382                              | 0,14<br>0,13<br>0,17<br>0,28                                 |
| PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE                                                                       |                                          |                                  |                           | CRH America Finance, Inc.<br>4,040 % éch. 04/09/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 3 400                                                                                                          | 3 375                                                                                                          | 0,05                                                                                         | Telus Corp.<br>4,250 % éch. 15/09/2026<br>4,260 % éch. 07/10/2026<br>4,270 % éch. 05/08/2026<br>4,280 % éch. 29/07/2026<br>4,280 % éch. 24/09/2026<br>4,300 % éch. 02/07/2026<br>4,300 % éch. 06/07/2026<br>4,380 % éch. 06/08/2026 | 3 600<br>700<br>2 900<br>10 400<br>700<br>1 300<br>1 950<br>22 100 | 3 566<br>691<br>2 887<br>10 364<br>693<br>1 300<br>1 949<br>22 002 | 0,05<br>0,01<br>0,04<br>0,16<br>0,01<br>0,02<br>0,03<br>0,34 |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>4,263 % éch. 25/05/2037                                         | 1 293                                    | 1 231                            | 0,02                      | eBay, Inc.<br>4,060 % éch. 25/08/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 28 800                                                                                                         | 28 619                                                                                                         | 0,44                                                                                         | Triton Container International Ltd.<br>4,310 % éch. 07/07/2026<br>4,310 % éch. 09/07/2026<br>4,330 % éch. 08/07/2026                                                                                                                | 2 400<br>6 900<br>1 700                                            | 2 398<br>6 893<br>1 698                                            | 0,04<br>0,10<br>0,03                                         |
| Curzon Mortgages PLC<br>4,592 % éch. 28/07/2049                                                               | £ 12 400                                 | 16 464                           | 0,25                      | EIDP, Inc.<br>4,060 % éch. 20/07/2026<br>4,180 % éch. 07/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                              | 7 200<br>15 000                                                                                                | 7 184<br>14 988                                                                                                | 0,11<br>0,23                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| First Franklin Mortgage Loan Trust<br>4,243 % éch. 25/05/2036                                                 | \$ 5 181                                 | 4 616                            | 0,07                      | Enbridge, Inc.<br>4,000 % éch. 17/07/2026<br>4,040 % éch. 18/08/2026<br>4,040 % éch. 16/09/2026                                                                                                                                                                                                                                               | 44 500<br>87 400<br>9 100                                                                                      | 44 417<br>86 922<br>9 020                                                                                      | 0,68<br>1,33<br>0,14                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| RAAC Trust<br>5,263 % éch. 25/09/2047                                                                         | 2 448                                    | 2 493                            | 0,04                      | Entergy Corp.<br>4,050 % éch. 11/09/2026<br>4,060 % éch. 12/08/2026<br>4,060 % éch. 18/08/2026<br>4,070 % éch. 20/08/2026<br>4,070 % éch. 08/09/2026                                                                                                                                                                                          | 19 200<br>4 200<br>18 200<br>16 300<br>10 500                                                                  | 19 042<br>4 180<br>18 100<br>16 207<br>10 417                                                                  | 0,29<br>0,06<br>0,28<br>0,25<br>0,16                                                         | BILLET À COURT TERME                                                                                                                                                                                                                |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Specialty Underwriting & Residential Finance Trust<br>4,003 % éch. 25/03/2037                                 | 4 026                                    | 2 074                            | 0,03                      | Equifax Inc.<br>4,140 % éch. 30/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 38 200                                                                                                         | 38 073                                                                                                         | 0,58                                                                                         | Daiwa Securities Co. Ltd.<br>4,090 % éch. 18/02/2027                                                                                                                                                                                | 46 000                                                             | 45 857                                                             | 0,70                                                         |
| 4,263 % éch. 25/06/2037                                                                                       | 5 297                                    | 3 214                            | 0,05                      | Evergy Missouri West, Inc.<br>4,230 % éch. 07/07/2026<br>4,230 % éch. 08/07/2026<br>4,230 % éch. 09/07/2026                                                                                                                                                                                                                                   | 700<br>700<br>1 300                                                                                            | 699<br>699<br>1 299                                                                                            | 0,01<br>0,01<br>0,02                                                                         | BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAIN                                                                                                                                                                                                         |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| 4,738 % éch. 25/12/2035                                                                                       | 18                                       | 18                               | 0,00                      | Fidelity National Information Services, Inc.<br>4,000 % éch. 07/07/2026<br>4,020 % éch. 07/07/2026                                                                                                                                                                                                                                            | 31 100<br>11 800                                                                                               | 31 076<br>11 791                                                                                               | 0,47<br>0,18                                                                                 | 7,046 % éch. 27/01/2027 (c)(d)<br>7,066 % éch. 28/10/2026 (c)(d)<br>7,304 % éch. 19/08/2026 (c)(d)<br>7,305 % éch. 18/11/2026 (c)(d)                                                                                                | 201 400<br>25 100<br>13 600<br>44 400                              | 11 816<br>1 499<br>823<br>2 642                                    | 0,18<br>0,03<br>0,01<br>0,04                                 |
| 30 110 0,46                                                                                                   |                                          |                                  |                           | Glencore Funding LLC<br>4,020 % éch. 08/07/2026<br>4,020 % éch. 06/08/2026<br>4,040 % éch. 04/08/2026<br>4,050 % éch. 10/08/2026<br>4,050 % éch. 11/08/2026                                                                                                                                                                                   | 300<br>800<br>600<br>42 400<br>45 200                                                                          | 300<br>797<br>598<br>42 206<br>44 989                                                                          | 0,00<br>0,01<br>0,01<br>0,65<br>0,69                                                         | TOTAL DES INSTRUMENTS À COURT TERME                                                                                                                                                                                                 |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| 951 209 14,56                                                                                                 |                                          |                                  |                           | Haleon UK Capital PLC<br>4,100 % éch. 10/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 30 100                                                                                                         | 30 066                                                                                                         | 0,46                                                                                         | 1 008 797 15,45                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                                         |                                          |                                  |                           | HCA, Inc.<br>4,220 % éch. 14/07/2026<br>4,220 % éch. 17/07/2026<br>4,220 % éch. 23/07/2026<br>4,270 % éch. 07/08/2026<br>4,270 % éch. 11/08/2026<br>4,270 % éch. 12/08/2026<br>4,270 % éch. 17/08/2026<br>4,270 % éch. 20/08/2026<br>4,300 % éch. 17/08/2026<br>4,300 % éch. 18/08/2026<br>4,330 % éch. 27/07/2026<br>4,350 % éch. 09/09/2026 | 13 900<br>7 700<br>8 300<br>14 900<br>13 700<br>14 900<br>13 700<br>1 100<br>1 700<br>1 900<br>11 800<br>1 100 | 13 877<br>7 685<br>8 277<br>14 832<br>13 630<br>14 822<br>13 620<br>1 093<br>1 690<br>1 889<br>11 762<br>1 090 | 0,21<br>0,12<br>0,13<br>0,23<br>0,21<br>0,23<br>0,21<br>0,02<br>0,02<br>0,03<br>0,18<br>0,02 | Total des Valeurs mobilières \$ 7 176 188 109,87                                                                                                                                                                                    |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>5,375 % éch. 21/01/2029                                | 3 400                                    | 3 394                            | 0,05                      | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>4,000 % éch. 22/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                              | 44 800                                                                                                         | 44 691                                                                                                         | 0,68                                                                                         | ACTIONS                                                                                                                                                                                                                             |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| 6,125 % éch. 21/01/2031                                                                                       | 4 300                                    | 4 347                            | 0,07                      | Oglethorpe Power Corp.<br>4,030 % éch. 10/07/2026<br>4,070 % éch. 27/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                  | 14 300<br>17 000                                                                                               | 14 285<br>16 951                                                                                               | 0,22<br>0,26                                                                                 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF                                                                                                                                                                            |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| TES colombien<br>2,250 % éch. 18/04/2029 (e)<br>6,500 % éch. 22/01/2031 (e)<br>11,000 % éch. 22/08/2029       | COP 2 778 718<br>4 125 774<br>53 199 800 | 726<br>1 186<br>14 976           | 0,01<br>0,02<br>0,23      | Rogers Communications<br>4,250 % éch. 06/08/2026<br>4,260 % éch. 30/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                   | 39 300<br>13 500                                                                                               | 39 135<br>13 454                                                                                               | 0,60<br>0,21                                                                                 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) 9 060 373 90 353 1,38                                                                                                                               |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Eagle Funding Luxco SARL<br>5,500 % éch. 17/08/2030                                                           | \$ 36 150                                | 36 342                           | 0,56                      | Southern California Edison Co.<br>4,380 % éch. 13/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 18 300                                                                                                         | 18 274                                                                                                         | 0,28                                                                                         | Total des Fonds d'investissement \$ 90 353 1,38                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Obligation internationale du gouvernement israélien<br>1,500 % éch. 18/01/2027<br>5,000 % éch. 30/10/2026     | € 2 000<br>22 900                        | 2 266<br>26 359                  | 0,04<br>0,40              | Spire, Inc.<br>4,030 % éch. 21/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 29 100                                                                                                         | 29 033                                                                                                         | 0,44                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>4,150 % éch. 28/03/2027                                 | \$ 2 200                                 | 2 199                            | 0,03                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,000 % éch. 31/01/2030<br>10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 921 200<br>14 000                    | 56 677<br>867                    | 0,87<br>0,01              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| 149 339 2,29                                                                                                  |                                          |                                  |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| INSTRUMENTS À COURT TERME                                                                                     |                                          |                                  |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| BILLET DE TRÉSORERIE                                                                                          |                                          |                                  |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Alimentation Couche-Tard, Inc.<br>4,010 % éch. 14/07/2026<br>4,040 % éch. 13/07/2026                          | \$ 35 900<br>700                         | 35 844<br>699                    | 0,55<br>0,01              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Autoliv, Inc.<br>4,070 % éch. 25/08/2026                                                                      | 8 500                                    | 8 447                            | 0,13                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Boston Scientific Corp.<br>4,000 % éch. 01/07/2026                                                            | 700                                      | 700                              | 0,01                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| 4,010 % éch. 06/07/2026                                                                                       | 800                                      | 799                              | 0,01                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| 4,025 % éch. 07/07/2026                                                                                       | 2 600                                    | 2 598                            | 0,04                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Campbell Soup Co.<br>4,270 % éch. 28/09/2026                                                                  | 3 400                                    | 3 365                            | 0,05                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |
| Clorox Co.<br>4,090 % éch. 07/07/2026<br>4,090 % éch. 08/07/2026<br>4,100 % éch. 13/07/2026                   | 8 300<br>4 000<br>8 700                  | 8 294<br>3 997<br>8 688          | 0,13<br>0,06<br>0,13      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                |                                                                                                                |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                    |                                                                    |                                                              |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                           | Type | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------|------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                           | Long | 12/2026              | 1 180                 | \$ (157)                                | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                              | Long | 03/2028              | 3 109                 | (2 901)                                 | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                | Long | 03/2027              | 849                   | (379)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours août                      | Long | 08/2026              | 2 317                 | 70                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre | Long | 09/2026              | 4 643                 | 1 658                                   | 0,02                   |



| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026           | 926                | \$ 994                                  | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés de change sur dollar australien septembre                       | Court | 09/2026           | 331                | 426                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés de change sur livre sterling septembre                          | Court | 09/2026           | 2 983              | 1 617                                   | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre       | Court | 09/2026           | 649                | (234)                                   | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre                       | Long  | 09/2026           | 12 902             | 30 567                                  | 0,47                   |
| Contrats à terme standardisés de change sur Euro septembre                                    | Court | 09/2026           | 5 647              | 8 332                                   | 0,13                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026           | 282                | 26                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 122                | 22                                      | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 6 263              | 1 195                                   | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 7 843              | (4 802)                                 | (0,07)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 373                | (688)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 616                | 1 751                                   | 0,03                   |
|                                                                                               |       |                   |                    | <b>\$ 37 497</b>                        | <b>0,58</b>            |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | <b>\$ 37 497</b>                        | <b>0,58</b>            |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Bank of America Corp.           | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 12 400                        | \$ (113)                                | 0,00                   |
| Deutsche Bank AG                | 1,000                | 20/06/2030      | € 10 000                         | 117                                     | 0,00                   |
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 300                           | 2                                       | 0,00                   |
| Ford Motor Co.                  | 5,000                | 20/12/2028      | 300                              | (13)                                    | 0,00                   |
| General Electric Co.            | 1,000                | 20/12/2026      | 3 700                            | (24)                                    | 0,00                   |
|                                 |                      |                 |                                  | <b>\$ (31)</b>                          | <b>0,00</b>            |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 9 520                         | \$ 4                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 23 530                           | 88                                      | 0,00                   |
|                                |                      |                 |                                  | <b>\$ 92</b>                            | <b>0,00</b>            |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/<br>à recevoir               | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 69 640          | \$ (789)                                | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2032      | \$ 28 900         | (446)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030      | 23 130            | (472)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 21/06/2028      | 12 300            | 57                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 273 330           | 4 863                                   | 0,07                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,650     | 11/09/2027      | 614 000           | 1 593                                   | 0,02                   |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,734     | 31/05/2032      | 71 500            | (690)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2026      | 252 990           | (658)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2027      | 22 000            | (86)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2028      | 21 900            | 291                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/12/2028      | 47 930            | 299                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2029      | 4 800             | (94)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 28 690            | 42                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2030      | 83 300            | 1 985                                   | 0,03                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2033      | 9 900             | 311                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2034      | 100 050           | 2 406                                   | 0,04                   |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,791     | 31/05/2032      | 83 700            | (552)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 152 630           | (352)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | CAD 162 600       | (476)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      | 57 400            | (296)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 7,498     | 28/04/2028      | COP 57 903 400    | 1 110                                   | 0,02                   |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,450     | 28/04/2028      | 57 903 400        | (820)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 8,530     | 22/08/2029      | 50 416 200        | 819                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                         | JIBAR ZAR à 3 mois                | 8,635     | 31/01/2030      | ZAR 898 800       | 290                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | € 16 900          | 290                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 7 500             | 69                                      | 0,00                   |
| À payer                                            | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,136     | 25/07/2029      | PLN 153 700       | 906                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,930     | 25/07/2029      | 56 600            | (899)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | WIBOR PLN à 6 mois                | 5,010     | 25/07/2029      | 95 900            | (700)                                   | (0,01)                 |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | <b>\$ 8 001</b>                         | <b>0,12</b>            |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | <b>\$ 8 062</b>                         | <b>0,12</b>            |

## Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                |     | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW | 1 400,000       | 09/07/2026        | 24 226                           | \$ 246 | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote |     | 1 400,000       | 13/07/2026        | 5 394                            | 37     | 0            | 0,00                |
|              |                                            |     |                 |                   |                                  | \$ 283 | \$ 0         | 0,00                |

##### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                               | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BPS          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,250 %         | 09/12/2026        | 13 300                           | \$ 6     | \$ 22        | 0,00                |
| DUB          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,650           | 09/09/2026        | 917 200                          | 938      | 4 159        | 0,06                |
| FAR          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 03/08/2026        | 428 600                          | 383      | 3            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,250           | 09/12/2026        | 1 532 000                        | 699      | 2 573        | 0,04                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 28/07/2026        | 1 275 800                        | 957      | 5            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 11/08/2026        | 446 200                          | 500      | 6            | 0,00                |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 03/08/2026        | 509 000                          | 458      | 4            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 11/08/2026        | 489 600                          | 548      | 6            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,650           | 09/09/2026        | 269 400                          | 271      | 1 222        | 0,02                |
|              |                                                           |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 4 760 | \$ 8 000     | 0,12                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                |     | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW | 1 350,000       | 09/07/2026        | 24 226                           | \$ (86) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote |     | 1 350,000       | 13/07/2026        | 5 394                            | (12)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |     |                 |                   |                                  | \$ (98) | \$ 0         | 0,00                |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                  | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) %           | 20/12/2030      | \$ 14 000                        | \$ (550)               | \$ 85                             | \$ (465)     | (0,01)              |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

### SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                             | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| CIB          | À recevoir         | Indice S&P 500 Total Return Index | 14 786                       | 4,570 %       | \$ 243 311        | 06/01/2027      | \$ 0                   | \$ 4 525                          | \$ 4 525     | 0,07                |
| FAR          | À recevoir         | Indice S&P 500 Total Return Index | 46 413                       | 4,170         | 786 020           | 04/11/2026      | 0                      | (10 224)                          | (10 224)     | (0,15)              |
| RBC          | À recevoir         | Indice S&P 500 Total Return Index | 38 098                       | 4,090         | 645 203           | 07/10/2026      | 0                      | (8 350)                           | (8 350)      | (0,13)              |
|              |                    |                                   |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (14 049)                       | \$ (14 049)  | (0,21)              |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |             | Devise à recevoir |             | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|-------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 43 642      | \$                | 31 207      | \$                 | 972                   | \$ 972                                  | 0,02                |        |
|              | 07/2026           | CNH             | 3 792       |                   | 562         |                    | 3                     | 3                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           | NZD             | 21 075      |                   | 12 446      |                    | 458                   | 458                                     | 0,01                |        |
|              | 07/2026           | \$              | 402         | CAD               | 572         |                    | 1                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026           |                 | 10 719      | NZD               | 18 870      |                    | 68                    | (53)                                    | 15                  | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 571         | \$                | 402         |                    | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | NZD             | 17 129      |                   | 9 687       |                    | 0                     | (68)                                    | (68)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 417         |                   | 80          |                    | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 439 039     |                   | 288         |                    | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 9 570       |                   | 968         |                    | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| BOA          | 07/2026           | SGD             | 35          |                   | 27          |                    | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 3 142       | CNH               | 21 246      |                    | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 569       | ¥                 | 249 518     |                    | 0                     | (33)                                    | (33)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 218       | NOK               | 20 607      |                    | 0                     | (136)                                   | (136)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 337         | PLN               | 1 271       |                    | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 4 612       | \$                | 1 551       |                    | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ZAR             | 13 163      |                   | 756         |                    | 0                     | (44)                                    | (44)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | COP             | 16 657 730  |                   | 4 311       |                    | 0                     | (437)                                   | (437)               | (0,01) |
|              | 09/2026           | INR             | 16 685      |                   | 176         |                    | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 7 195       |                   | 406         |                    | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
| BPS          | 10/2026           | ZAR             | 24 286      |                   | 1 487       |                    | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,00   |
|              | 01/2027           |                 | 193 025     |                   | 11 740      |                    | 157                   | 0                                       | 157                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 6 324       |                   | 4 358       |                    | 0                     | (23)                                    | (23)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | BRL             | 9 720       |                   | 1 878       |                    | 6                     | (6)                                     | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 2 687       |                   | 3 416       |                    | 85                    | 0                                       | 85                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 17 506      |                   | 2 587       |                    | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 366         |                   | 483         |                    | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 363 300 071 |                   | 20 273      |                    | 17                    | (12)                                    | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 6 926       |                   | 2 350       |                    | 24                    | 0                                       | 24                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 676 165     |                   | 7 040       |                    | 0                     | (103)                                   | (103)               | 0,00   |
| BRC          | 07/2026           | KRW             | 1 571 863   |                   | 1 031       |                    | 15                    | 0                                       | 15                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 255       |                   | 229         |                    | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | THB             | 93 745      |                   | 2 858       |                    | 39                    | (5)                                     | 34                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 448         | BRL               | 2 260       |                    | 0                     | (11)                                    | (11)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 61          | CZK               | 1 275       |                    | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 561       | £                 | 4 897       |                    | 0                     | (62)                                    | (62)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 19 677      | INR               | 1 865 664   |                    | 39                    | (36)                                    | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 933       | ¥                 | 1 107 001   |                    | 0                     | (122)                                   | (122)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 764       | KRW               | 7 307 054   |                    | 0                     | (43)                                    | (43)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 274         | TWD               | 8 633       |                    | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           | ZAR             | 83 300      | \$                | 5 078       |                    | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 1 253       |                   | 420         |                    | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 2 126       | BRL               | 10 828      |                    | 0                     | (50)                                    | (50)                | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 483         | £                 | 366         |                    | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 29 202 228  | \$                | 1 606       |                    | 0                     | (13)                                    | (13)                | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 83 698      |                   | 2 580       |                    | 45                    | 0                                       | 45                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 10 460      | IDR               | 185 123 693 |                    | 12                    | (210)                                   | (198)               | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 242       | INR               | 118 012     |                    | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 489         | THB               | 16 033      |                    | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 848         | IDR               | 15 432 376  |                    | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           | ILS             | 8 552       | \$                | 2 889       |                    | 18                    | 0                                       | 18                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 264 967     |                   | 1 639       |                    | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 30 612      |                   | 18 103      |                    | 690                   | 0                                       | 690                 | 0,01   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 411 397     |                   | 25 328      |                    | 267                   | 0                                       | 267                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 639       | ¥                 | 264 273     |                    | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00   |
|              | 12/2026           | ZAR             | 6 673       | \$                | 379         |                    | 0                     | (23)                                    | (23)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 2 230       |                   | 1 612       |                    | 40                    | 0                                       | 40                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | HUF             | 7 127       |                   | 23          |                    | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 7 722       |                   | 2 658       |                    | 65                    | 0                                       | 65                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 402 494     |                   | 4 266       |                    | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           | NOK             | 11 445      |                   | 1 234       |                    | 77                    | 0                                       | 77                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 12 793      | AUD               | 18 102      |                    | 0                     | (252)                                   | (252)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 894       | IDR               | 69 864 373  |                    | 6                     | 0                                       | 6                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 154       | INR               | 402 494     |                    | 98                    | 0                                       | 98                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 524         | KRW               | 791 562     |                    | 0                     | (12)                                    | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 778       | PLN               | 17 461      |                    | 0                     | (133)                                   | (133)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 101         | SEK               | 930         |                    | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 98          | TWD               | 3 092       |                    | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 15 092      | \$                | 5 258       |                    | 188                   | 0                                       | 188                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 019       | ILS               | 3 026       |                    | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
| 09/2026      | CLP               | 27 112 971      | \$          | 31 231            |             | 1 806              | 0                     | 1 806                                   | 0,03                |        |
| 09/2026      | COP               | 118 787 560     |             | 30 846            |             | 0                  | (3 012)               | (3 012)                                 | (0,05)              |        |
| 09/2026      | IDR               | 104 076 662     |             | 5 765             |             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | INR               | 43 525          |             | 453               |             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | THB               | 102 643         |             | 3 100             |             | 1                  | (10)                  | (9)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      | \$                | 2 137           | IDR         | 38 118 534        |             | 0                  | (24)                  | (24)                                    | 0,00                |        |
| 09/2026      |                   | 856             | MXN         | 15 320            |             | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |        |
| 12/2026      |                   | 1 872           | IDR         | 34 035 854        |             | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      | IDR               | 9 355 554       | \$          | 523               |             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      | INR               | 141 860         |             | 1 502             |             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      | \$                | 66              | CZK         | 1 378             |             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |

# Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | \$              | 1 002             | INR                | 96 698                | \$ 17                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 646               | NOK                | 6 005                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 773             | PLN                | 17 712                | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 191 302           | \$                 | 11 818                | (62)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 89 869 255        |                    | 4 988                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 312             | IDR                | 23 823 065            | 6                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 502             | INR                | 142 822               | 9                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | ZAR             | 8 901             | \$                 | 505                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 17 415            |                    | 2 574                 | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 26 110            |                    | 29 779                | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 139 799           |                    | 1 482                 | (73)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 10 930 198        |                    | 67 554                | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 4 965             |                    | 1 360                 | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | SEK             | 554               |                    | 57                    | 301                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 61 561            |                    | 48 254                | 39                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 6 925             | CNH                | 47 103                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 465             | INR                | 139 799               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 794             | ¥                  | 761 740               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 568            | PLN                | 49 974                | (107)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 272 529           | \$                 | 16 514                | (273)                                   | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           | CNH             | 47 000            |                    | 6 925                 | (87)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 9 366             |                    | 3 271                 | (14)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 29 819            | €                  | 26 110                | 125                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 67 554            | ¥                  | 10 901 595            | 73                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 57                | SEK                | 553                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 35 633            | BRL                | 183 209               | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 716               | INR                | 68 594                | (762)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 695               | MXN                | 12 274                | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 1 496 559         | \$                 | 969                   | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 4 283             | BRL                | 22 975                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 38 665            | CAD                | 55 021                | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 771             | IDR                | 67 610 928            | 116                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 969               | KRW                | 1 496 346             | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 13 372            | \$                 | 810                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 54 943            |                    | 38 665                | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 3 457             | BRL                | 17 667                | (5)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 985               | INR                | 94 487                | (116)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 68 006 865        | \$                 | 3 771                 | (70)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 8 536             |                    | 488                   | 9                                       | 0,00                |
| JPM          | 09/2026           | THB             | 234 827           |                    | 7 277                 | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4 603             | BRL                | 23 695                | 3                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 6 119             | IDR                | 109 866 550           | (93)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 3 998             | INR                | 384 457               | (41)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 434             | MXN                | 24 994                | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 183 227           | \$                 | 130 615               | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 19 086            |                    | 3 709                 | 0                                       | 0,06                |
|              | 07/2026           | ILS             | 21 853            |                    | 7 319                 | 21                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 67 425            |                    | 715                   | (17)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 462 446           |                    | 299                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 13 205            |                    | 1 334                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 2 397             |                    | 1 416                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 12 679            |                    | 3 480                 | 53                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 88                | HUF                | 26 853                | 107                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 568               | IDR                | 10 215 934            | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 714               | INR                | 67 425                | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 450               | KRW                | 691 490               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 305             | NZD                | 2 314                 | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 279               | PLN                | 1 053                 | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           |                 | 2 056             | THB                | 68 731                | 13                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 27 736            | \$                 | 9 566                 | 249                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 334             | NOK                | 13 210                | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 10 615 056        | \$                 | 588                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 283 127           |                    | 2 970                 | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 18 031            |                    | 1 022                 | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 190 187           |                    | 5 823                 | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 911             | INR                | 182 278               | (21)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 4 258             | MXN                | 74 357                | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 3 709             | BRL                | 19 506                | (30)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR             | 42 506            | \$                 | 2 425                 | (21)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 43 299            | MXN                | 759 664               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 14 431            | \$                 | 9 965                 | (140)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | CHF             | 24 934            |                    | 31 651                | (407)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 929 850           |                    | 52                    | (51)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 142 421           |                    | 1 508                 | (26)                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 7 556 936         |                    | 4 985                 | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 4 345             |                    | 438                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 338               |                    | 35                    | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 87 290            | AUD                | 126 348               | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 325             | INR                | 224 133               | (98)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 35 916            | ¥                  | 5 739 359             | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 539             | NOK                | 14 270                | (603)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 823             | NZD                | 3 230                 | (97)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 120 572           | \$                 | 83 143                | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   |                    |                       | (341)                                   | (0,01)              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |    |       |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|----|-------|------|
| MYI          | 08/2026           | ILS             | 506               | \$                 | 169                   | \$                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | \$              | 179               | NOK                | 1 781                 | \$                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           |                 | 35                | SEK                | 338                   |                                         | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | MXN             | 1 765             | \$                 | 100                   |                                         | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | THB             | 58 984            |                    | 1 767                 | (20)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | \$              | 6 308             | INR                | 603 452               | (8)                                     | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | €               | 130               | \$                 | 149                   | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | \$              | 2 774             | AUD                | 3 939                 | (46)                                    | 0,00                |    |       |      |
| NSL          | 07/2026           | £               | 75                | \$                 | 99                    | (1)                                     | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | \$              | 3 510             | IDR                | 62 582 085            | (10)                                    | 0,00                |    |       |      |
| RYL          | 07/2026           |                 | 2 351             | INR                | 226 216               | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           |                 | 99                | £                  | 75                    | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 62 933 058        | \$                 | 3 510                 | 21                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | \$              | 1 308             | IDR                | 23 272 199            | (18)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 000             | £                  | 757                   | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 1 320             | IDR                | 23 695 368            | 2                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 3 095             | INR                | 296 627               | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           |                 | 2 449             |                    | 234 690               | 20                                      | 0,00                |    |       |      |
| SCX          | 09/2026           | IDR             | 70 690 423        | \$                 | 3 916                 | (3)                                     | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | THB             | 83 507            |                    | 2 586                 | 57                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | \$              | 3 334             | IDR                | 59 856 240            | (21)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | CAD             | 757               | \$                 | 548                   | 15                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | CNH             | 29 633            |                    | 4 381                 | 15                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | £               | 8 692             |                    | 11 482                | (54)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 91                |                    | 70                    | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | \$              | 68 472            | AUD                | 99 235                | 278                                     | 0,00                |    |       |      |
| SOG          | 07/2026           |                 | 807               | CHF                | 653                   | 2                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 30 481            | €                  | 26 129                | (607)                                   | (0,01)              |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 21 008            | ¥                  | 3 337 531             | (473)                                   | (0,01)              |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 47 634            | SGD                | 61 686                | 57                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | AUD             | 99 235            | \$                 | 68 428                | (282)                                   | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | CHF             | 651               |                    | 807                   | (2)                                     | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | SGD             | 61 547            |                    | 47 634                | (60)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | \$              | 11 481            | £                  | 8 692                 | 54                                      | 0,00                |    |       |      |
| SSB          | 08/2026           |                 | 70                | SGD                | 90                    | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | CAD             | 53 571            | \$                 | 38 850                | 1 090                                   | 0,02                |    |       |      |
|              | 07/2026           | CHF             | 936               |                    | 1 190                 | 30                                      | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           | \$              | 355               | CAD                | 503                   | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | CAD             | 503               | \$                 | 355                   | 0                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 08/2026           | \$              | 14 540            | COP                | 55 460 020            | 1 374                                   | 0,02                |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 5 699             | £                  | 4 240                 | (71)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 4 859             | PLN                | 17 756                | (135)                                   | 0,00                |    |       |      |
| UAG          | 09/2026           | MXN             | 7 472             | \$                 | 426                   | 1                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | THB             | 11 337            |                    | 345                   | 2                                       | 0,00                |    |       |      |
|              | 09/2026           | \$              | 31 452            | CLP                | 27 991 307            | (1 073)                                 | (0,02)              |    |       |      |
|              | 07/2026           |                 | 34 561            | CHF                | 27 904                | 32                                      | 0,00                |    |       |      |
| WST          | 08/2026           | CHF             | 27 804            | \$                 | 34 561                | (32)                                    | 0,00                |    |       |      |
|              |                   |                 |                   | \$                 | 15 917                | \$                                      | (11 877)            | \$ | 4 040 | 0,06 |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA                                                | 07/2026           | \$ 433          | € 372             | \$ 0               | \$ (8)                | \$ (8)                                  | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | 106 877         | 91 787            | 12                 | (1 949)               | (1 937)                                 | (0,03)              |
| CBK                                                | 07/2026           | 14 605          | 12 522            | 0                  | (288)                 | (288)                                   | (0,01)              |
| FAR                                                | 07/2026           | € 89 841        | \$ 102 464        | 0                  | (252)                 | (252)                                   | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 102 602      | € 89 841          | 251                | 0                     | 251                                     | 0,00                |
| MBC                                                | 07/2026           | € 90 783        | \$ 103 136        | 16                 | (672)                 | (656)                                   | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 5 588        | € 4 844           | 0                  | (50)                  | (50)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 102 008         | 89 690            | 672                | 0                     | 672                                     | 0,01                |
| SCX                                                | 07/2026           | 86 609          | 74 443            | 0                  | (1 498)               | (1 498)                                 | (0,02)              |
| SOG                                                | 07/2026           | € 89 871        | \$ 102 229        | 0                  | (520)                 | (520)                                   | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 104 290      | € 89 401          | 0                  | (2 078)               | (2 078)                                 | (0,03)              |
|                                                    | 08/2026           | 102 368         | 89 871            | 519                | 0                     | 519                                     | 0,01                |
| SSB                                                | 07/2026           | € 2 873         | \$ 3 276          | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 3 280        | € 2 873           | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 1 479           | \$ (7 324)            | \$ (5 845)                              | (0,09)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (8 319)                              | (0,13)              |

## Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

### TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                                  |                                  |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                  |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | \$ 20                            | \$ (19)                          | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 01/09/2056                                        | 51 000                           | (47 629)                         | (0,73)                    |
| 4,500 % éch. 01/08/2056                                        | 83 800                           | (80 216)                         | (1,23)                    |
| 5,000 % éch. 01/07/2056                                        | 37 870                           | (37 216)                         | (0,57)                    |
| 5,500 % éch. 01/09/2056 (g)                                    | 57 122                           | (57 184)                         | (0,87)                    |
| <b>Total des Titres vendus à découvert</b>                     |                                  | <b>\$ (222 264)</b>              | <b>(3,40)</b>             |
| <b>Total des Investissements</b>                               |                                  | <b>\$ 7 081 517</b>              | <b>108,42</b>             |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b>                  |                                  | <b>\$ (549 675)</b>              | <b>(8,42)</b>             |
| <b>Actif net</b>                                               |                                  | <b>\$ 6 531 842</b>              | <b>100,00</b>             |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût     | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------|---------|--------------------|-----------------|----------|-----------------|------------------------|
| Hardwood Funding LLC      | 4,360 % | 08/06/2029         | 16/01/2026      | \$ 4 700 | \$ 4 612        | 0,07                   |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 114 264 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 413 383 \$ (31 décembre 2025 : 137 431 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 38 010 \$ (31 décembre 2025 : 12 660 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 7 140 295                                               | \$ 35 893                                                  | \$ 7 176 188        |
| Fonds d'investissement                        | 90 353                                                                                     | 0                                                          | 0                                                          | 90 353              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 34 226                                                                                     | (7 362)                                                    | 10 376                                                     | 37 240              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (222 264)                                                  | 0                                                          | (222 264)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 124 579</b>                                                                          | <b>\$ 6 910 669</b>                                        | <b>\$ 46 269</b>                                           | <b>\$ 7 081 517</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 6 853 120                                               | \$ 30 208                                                  | \$ 6 883 328        |
| Fonds d'investissement                        | 565 679                                                                                    | 0                                                          | 0                                                          | 565 679             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 85 000                                                     | 0                                                          | 85 000              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (6 616)                                                                                    | (26 557)                                                   | 0                                                          | (33 173)            |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (225 793)                                                  | 0                                                          | (225 793)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 559 063</b>                                                                          | <b>\$ 6 685 770</b>                                        | <b>\$ 30 208</b>                                           | <b>\$ 7 275 041</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.



## Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,770 %        | 18/06/2026        | 02/07/2026      | \$ (29 337)      | \$ (29 376)                              | (0,45)              |
| JPS                                           | 3,740          | 24/06/2026        | 15/07/2026      | (83 841)         | (83 902)                                 | (1,28)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (113 278)</b>                      | <b>(1,73)</b>       |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 1 380                                                   | \$ (1 510)              | \$ (130)                          | \$ 57                                                      | \$ (150)                | \$ (93)                           |
| BOA          | (488)                                                      | 340                     | (148)                             | 2 238                                                      | (2 260)                 | (22)                              |
| BPS          | (2 328)                                                    | 2 380                   | 52                                | 11                                                         | 290                     | 301                               |
| BRC          | 952                                                        | (1 180)                 | (228)                             | 916                                                        | (1 060)                 | (144)                             |
| CBK          | (1 434)                                                    | 1 620                   | 186                               | (770)                                                      | 1 000                   | 230                               |
| CIB          | 4 525                                                      | (2 590)                 | 1 935                             | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| DUB          | 4 224                                                      | (3 810)                 | 414                               | 1 083                                                      | (1 040)                 | 43                                |
| FAR          | (8 023)                                                    | 14 390                  | 6 367                             | (18 379)                                                   | 8 200                   | (10 179)                          |
| GLM          | 181                                                        | (310)                   | (129)                             | (45)                                                       | 140                     | 95                                |
| GST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (854)                                                      | (840)                   | (1 694)                           |
| IND          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 98                                                         | 0                       | 98                                |
| JPM          | 3 569                                                      | (4 270)                 | (701)                             | (1 098)                                                    | (3 630)                 | (4 728)                           |
| MBC          | 40                                                         | (260)                   | (220)                             | 516                                                        | (600)                   | (84)                              |
| MYC          | 767                                                        | (840)                   | (73)                              | (323)                                                      | 320                     | (3)                               |
| MYI          | (46)                                                       | 0                       | (46)                              | 7                                                          | (3)                     | 4                                 |
| NSL          | 29                                                         | 0                       | 29                                | 118                                                        | 0                       | 118                               |
| RBC          | (8 350)                                                    | 13 370                  | 5 020                             | (8 973)                                                    | (10 460)                | (19 433)                          |
| RYL          | 4                                                          | 0                       | 4                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | (1 403)                                                    | 1 490                   | 87                                | 100                                                        | (280)                   | (180)                             |
| SOG          | (3 136)                                                    | 3 130                   | (6)                               | 1 865                                                      | (1 930)                 | (65)                              |
| SSB          | 2 494                                                      | (2 680)                 | (186)                             | 409                                                        | (230)                   | 179                               |
| TOR          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (5 073)                                                    | 850                     | (4 223)                           |
| UAG          | (1 276)                                                    | 1 290                   | 14                                | (1 988)                                                    | 1 860                   | (128)                             |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 43                                                         | 0                       | 43                                |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 21,36            | 19,31                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 40,26            | 41,53                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,37             | 2,29                 |
| Fonds d'investissement                                           | 0,79             | 5,19                 |
| Contrats de mise en pension                                      | S/O              | 0,78                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,41             | 0,05                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,14             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,26             | 0,18                 |
| Autres actifs                                                    | 35,41            | 30,59                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,47             | 0,14                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 31,99            | 24,49                |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 34,09            | 44,82                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 1,89             | 1,99                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 9,13             | 8,61                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 14,56            | 17,88                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 2,29             | 3,48                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 15,45            | 10,15                |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 1,38             | 9,17                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | S/O              | 1,38                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,58             | (0,08)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,12             | 0,03                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,12             | 0,03                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | S/O              | 0,14                 |
| Swaps de rendement total sur indices                                                                     | (0,21)           | (0,58)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,06             | (0,13)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,09)           | 0,06                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (3,40)           | (3,66)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (8,42)           | (17,91)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                    | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)    | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| BANQUE ET FINANCE                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                                                            |                                     |                                  |                           | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust        | \$                                  | 5                                | \$ 5                      | 0,04                                   | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                           |  |
| 2,528 % éch. 18/11/2027                                                                 | \$                                  | 19                               | \$ 19                     | 4,155 % éch. 25/11/2034                               |                                     |                                  |                           |                                        | 6,250 % éch. 31/03/2036                                | ZAR                                 | 1 720 \$ 90               |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | GSR Mortgage Loan Trust                               |                                     |                                  |                           |                                        | 7,000 % éch. 28/02/2031                                |                                     | 2 230 131                 |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,096 % éch. 25/11/2035                               |                                     | 11                               | 9                         | 0,07                                   | 8,000 % éch. 31/01/2030                                |                                     | 0 0                       |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | London Wall Mortgage Capital PLC                      |                                     |                                  |                           |                                        | 8,250 % éch. 31/03/2032                                |                                     | 300 19                    |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,738 % éch. 15/05/2057                               | £                                   | 38                               | 51                        | 0,38                                   | 8,500 % éch. 31/01/2037                                |                                     | 200 12                    |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Polaris PLC                                           |                                     |                                  |                           |                                        | 8,875 % éch. 28/02/2035                                |                                     | 1 000 63                  |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,555 % éch. 26/02/2068                               |                                     | 89                               | 118                       | 0,88                                   | Obligation internationale du gouvernement turc         |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Stratton Mortgage Funding PLC                         |                                     |                                  |                           |                                        | 40,305 % éch. 06/09/2028                               | TRY                                 | 1 100 24                  |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,649 % éch. 28/06/2050                               |                                     | 61                               | 81                        | 0,61                                   |                                                        |                                     | 1 102 8,25                |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,721 % éch. 25/06/2049                               |                                     | 157                              | 209                       | 1,56                                   | INSTRUMENTS A COURT TERME                              |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Structured Asset Mortgage Investments Trust           |                                     |                                  |                           |                                        | BILLETS A COURT TERME                                  |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,254 % éch. 19/07/2035                               | \$                                  | 9                                | 8                         | 0,06                                   | Federal Home Loan Bank                                 |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,383 % éch. 25/09/2045                               |                                     | 7                                | 7                         | 0,05                                   | 3,530 % éch. 04/09/2026 (a)(b)                         | \$                                  | 100 99                    |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           |                                        | 3,610 % éch. 26/08/2026 (a)(b)                         |                                     | 300 298                   |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/01/2036                               |                                     | 10                               | 8                         | 0,06                                   |                                                        |                                     | 397 2,98                  |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,113 % éch. 25/03/2035                               |                                     | 30                               | 27                        | 0,20                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  | 674                       | 5,04                                   | BONS DU TRÉSOR NIGÉRIAN                                |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                           |                                     |                                  |                           | 20,537 % éch. 14/01/2027 (a)(b)        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES        |                                     |                                  |                           | 20,607 % éch. 21/01/2027 (a)(b)        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Auto ABS Spanish Loans                                | €                                   | 69                               | 79                        | 0,59                                   | 20,677 % éch. 28/01/2027 (a)(b)                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 3,059 % éch. 28/09/2038                               |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Plenti Auto ABS                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,399 % éch. 12/08/2033                               | AUD                                 | 250                              | 174                       | 1,30                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 253                                    | 1,89                                                   | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN            |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                   |                                     |                                  |                           | 3,670 % éch. 15/09/2026 (a)(b)         |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust            |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/08/2036                               | \$                                  | 54                               | 53                        | 0,40                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,013 % éch. 25/08/2037                               |                                     | 0                                | 0                         | 0,00                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust                               |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,378 % éch. 25/11/2035                               |                                     | 84                               | 76                        | 0,57                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | GSA Home Equity Trust                                 |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 5,638 % éch. 25/02/2035                               |                                     | 69                               | 71                        | 0,53                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | GSAMP Trust                                           |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,043 % éch. 25/12/2036                               |                                     | 122                              | 65                        | 0,48                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Home Equity Loan Trust                                |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 3,993 % éch. 25/04/2037                               |                                     | 34                               | 33                        | 0,25                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | HSI Asset Securitization Corp. Trust                  |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,543 % éch. 25/01/2036                               |                                     | 100                              | 87                        | 0,65                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                   |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/10/2036                               |                                     | 3                                | 3                         | 0,02                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,618 % éch. 25/03/2034                               |                                     | 24                               | 25                        | 0,19                                   |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           | 413                                    | 3,09                                                   | Total des Instruments à court terme |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                    |                                     |                                  |                           | 727 5,44                               |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Marzio Finance SRL                                    | €                                   | 62                               | 71                        | 0,53                                   | Total des Valeurs mobilières                           |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 2,751 % éch. 28/09/2049                               |                                     |                                  |                           |                                        | \$ 15 401 115,20                                       |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Ocean Trails CLO                                      | \$                                  | 300                              | 301                       | 2,25                                   | ACTIONS                                                |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,973 % éch. 15/10/2034                               |                                     |                                  |                           |                                        | FONDS D'INVESTISSEMENT                                 |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Providus CLO DAC                                      | €                                   | 300                              | 344                       | 2,57                                   | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF                      |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | 3,364 % éch. 15/10/2038                               |                                     |                                  |                           |                                        | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO                   |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        | US Dollar Short-Term Floating NAV                      |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        | Fund (d)                                               |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        | 84 193                                                 | 839                                 | 6,28                      |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE                              |                                     |                                  |                           | FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE               |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar                |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Short Maturity UCITS ETF (d)                          |                                     |                                  |                           | Short Maturity UCITS ETF (d)           |                                                        |                                     |                           |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        | 3 800                                                  | 382                                 | 2,85                      |  |
|                                                                                         |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement                      |                                     |                                  |                           | \$ 1 221 9,13                          |                                                        |                                     |                           |  |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Obligations du Trésor américain                                                         |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 4,625 % éch. 15/05/2044                                                                 | 150                                 | 145                              | 1,09                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| American Home Mortgage Assets Trust                                                     | 235                                 | 53                               | 0,40                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 4,664 % éch. 25/11/2046                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Banc of America Alternative Loan Trust                                                  | 8                                   | 6                                | 0,04                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 6,000 % éch. 25/03/2021                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Banc of America Mortgage Trust                                                          | 3                                   | 2                                | 0,02                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 5,739 % éch. 25/06/2034                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                             | 8                                   | 7                                | 0,05                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 5,307 % éch. 25/05/2037                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Chase Mortgage Finance Trust                                                            | 1                                   | 1                                | 0,01                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 4,763 % éch. 25/07/2037                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                      | 16                                  | 15                               | 0,11                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 4,744 % éch. 25/12/2035                                                                 | 10                                  | 7                                | 0,05                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 5,500 % éch. 25/11/2035                                                                 | 27                                  | 12                               | 0,09                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 5,915 % éch. 25/11/2035                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                       | 54                                  | 48                               | 0,36                      |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |
| 4,223 % éch. 25/05/2035                                                                 |                                     |                                  |                           |                                                       |                                     |                                  |                           |                                        |                                                        |                                     |                           |  |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par                                                                        | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BPS                                   | 3,690 %      | 30/06/2026        | 01/07/2026      | \$ 800               | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,875 % échéance 15/07/2035 | \$ (812)         | \$ 800                                   | \$ 800                                                             | 5,98                |
|                                       | 3,700        | 30/06/2026        | 01/07/2026      | 2 500                | Ginnie Mae 4,000 % éch. 20/01/2049                                                 | (2 723)          | 2 500                                    | 2 500                                                              | 18,70               |
| Total des Contrats de mise en pension |              |                   |                 |                      |                                                                                    | \$ (3 535)       | \$ 3 300                                 | \$ 3 300                                                           | 24,68               |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois mars                                | Long  | 06/2027           | 3                  | \$ 5                              | 0,03                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre        | Long  | 09/2026           | 2                  | 2                                 | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre                           | Long  | 09/2026           | 32                 | 75                                | 0,56                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre           | Long  | 09/2026           | 1                  | 1                                 | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                         | Long  | 09/2026           | 1                  | 2                                 | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Court | 09/2026           | 6                  | (3)                               | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 3                  | 1                                 | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 15                 | (1)                               | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Long  | 09/2026           | 18                 | 10                                | 0,08                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026           | 3                  | (6)                               | (0,05)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 1                  | 2                                 | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Court | 09/2026           | 3                  | 3                                 | 0,02                |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ 91                             | 0,68                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                        |       |                   |                    | \$ 91                             | 0,68                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Bank of America Corp. | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 100                           | \$ (1)                            | (0,01)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | (1,000) %           | 20/12/2030      | \$ 200                           | \$ 0                              | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000 %              | 20/06/2031      | \$ 198                           | \$ 9                              | 0,07                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 1 370                            | 1                                 | 0,01                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 10                             | 0,08                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,750 %   | 17/09/2030      | £ 800             | \$ (9)                            | (0,07)              |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/09/2035      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500     | 17/09/2055      | 50                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 0,740     | 15/02/2027      | \$ 100            | 9                                 | 0,07                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,000     | 16/12/2027      | 300               | (23)                              | (0,18)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,250     | 17/06/2030      | 100               | (7)                               | (0,05)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,250     | 16/06/2051      | 100               | 2                                 | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,277     | 21/07/2031      | 200               | (13)                              | (0,09)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 1,750     | 15/06/2032      | 700               | (32)                              | (0,25)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 2,750     | 21/06/2053      | 100               | 5                                 | 0,04                |

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 %   | 16/09/2028      | \$ 70             | \$ 0                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 19/03/2030      | 940               | (15)                              | (0,11)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2030      | 60                | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2033      | 150               | (3)                               | (0,03)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,150     | 25/08/2028      | 4 370             | (4)                               | (0,03)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 21/06/2028      | 160               | (4)                               | (0,03)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 16/09/2031      | 170               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2032      | 300               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,435     | 05/11/2034      | 10                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/12/2027      | 1 950             | (27)                              | (0,20)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      | 200               | (2)                               | (0,02)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/12/2054      | 325               | 33                                | 0,25                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/09/2055      | 120               | 4                                 | 0,03                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,560     | 30/04/2033      | 200               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 04/06/2033      | 200               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,646     | 17/04/2033      | 100               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 31/05/2028      | 300               | 2                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,655     | 31/05/2028      | 200               | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,662     | 31/05/2028      | 230               | 2                                 | 0,01                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,674     | 29/04/2033      | 200               | (2)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 20/02/2049      | 125               | 8                                 | 0,06                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,721     | 01/04/2033      | 200               | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,742     | 26/03/2033      | 200               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2030      | 670               | 17                                | 0,13                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 210               | (5)                               | (0,04)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 110               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2032      | 60                | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 150               | 3                                 | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2035      | 880               | 16                                | 0,12                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 30                | 1                                 | 0,01                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 16/09/2036      | 150               | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2055      | 10                | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,783     | 23/06/2033      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 08/01/2035      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,982     | 30/09/2026      | 400               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 26/02/2035      | 50                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2056      | 40                | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,046     | 15/11/2052      | 110               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,054     | 15/11/2052      | 120               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,110     | 25/08/2057      | 150               | 6                                 | 0,04                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,810    | 02/01/2029      | 600               | (3)                               | (0,02)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,975    | 02/01/2029      | 800               | (4)                               | (0,03)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,985    | 02/01/2031      | 880               | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,245    | 02/01/2029      | 900               | (4)                               | (0,03)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,291    | 02/01/2029      | 300               | (1)                               | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,927    | 04/01/2027      | 600               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CDI BRL à un an               | 14,210    | 02/01/2031      | 900               | (1)                               | (0,01)              |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 8,590     | 22/08/2029      | 159 200           | 3                                 | 0,02                |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois  | 8,933     | 22/08/2029      | 157 500           | 2                                 | 0,02                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 20/09/2033      | 200               | 2                                 | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,500     | 18/06/2035      | 200               | (7)                               | (0,05)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois           | 4,530     | 31/12/2035      | 500               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,710     | 06/08/2034      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,750     | 16/09/2036      | 1 040             | 10                                | 0,07                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,000     | 16/09/2056      | 450               | (3)                               | (0,02)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | WIBOR PLN à 6 mois            | 4,730     | 31/12/2035      | 100               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,453     | 20/07/2052      | 60                | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,480     | 29/10/2035      | 200               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,503     | 25/03/2030      | 200               | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,515     | 29/10/2030      | 100               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,520     | 27/03/2030      | 200               | 1                                 | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,598     | 28/09/2032      | 200               | 1                                 | 0,01                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ (62)                           | (0,47)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ (53)                           | (0,40)              |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 25                               | \$ 0 | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 15                               | 0    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 18,000      | 19/08/2026        | 60                               | 3    | 6            | 0,04                |
| JPM          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 04/09/2026        | 20                               | 0    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 3 | \$ 6         | 0,04                |

##### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,093 %         | 04/01/2027        | 1 300                            | \$ 1   | \$ 3         | 0,02                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 5,000           | 11/06/2027        | 1 100                            | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,063           | 06/07/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,115           | 28/05/2027        | 300                              | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,188           | 07/06/2027        | 300                              | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,840           | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,394           | 28/08/2026        | 400                              | 2      | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,693           | 27/08/2035        | 100                              | 9      | 8            | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,693           | 27/08/2035        | 100                              | 9      | 8            | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 04/09/2026        | 300                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 19/10/2026        | 300                              | 1      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 23/10/2026        | 200                              | 0      | 0            | 0,00                |
| BPS          |                                                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,300           | 28/05/2027        | 200                              | 1      | 1            | 0,01                |
| BRC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,110           | 23/08/2027        | 100                              | 8      | 5            | 0,04                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,110           | 23/08/2027        | 100                              | 8      | 6            | 0,04                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,163           | 23/08/2027        | 7 700                            | 39     | 12           | 0,09                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,163           | 23/08/2027        | 7 700                            | 39     | 68           | 0,51                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,158           | 01/06/2027        | 400                              | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,161           | 01/06/2027        | 400                              | 1      | 2            | 0,01                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,628           | 20/08/2035        | 200                              | 17     | 16           | 0,12                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,628           | 21/08/2035        | 100                              | 9      | 8            | 0,06                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 09/10/2026        | 400                              | 1      | 1            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 5,000           | 11/06/2027        | 1 000                            | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,206           | 04/09/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,216           | 06/08/2026        | 100                              | 1      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,394           | 28/08/2026        | 400                              | 2      | 1            | 0,01                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,525           | 06/08/2026        | 700                              | 4      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 07/12/2026        | 300                              | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,110           | 23/08/2027        | 300                              | 24     | 14           | 0,11                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,110           | 23/08/2027        | 400                              | 32     | 24           | 0,18                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,750           | 03/08/2026        | 400                              | 0      | 0            | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,485           | 31/07/2035        | 200                              | 18     | 15           | 0,12                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,485           | 31/07/2035        | 200                              | 18     | 16           | 0,12                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,296           | 04/02/2028        | 100                              | 7      | 7            | 0,05                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,296           | 04/02/2028        | 100                              | 7      | 6            | 0,04                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,857           | 07/10/2026        | 1 400                            | 1      | 5            | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,082           | 04/01/2027        | 1 400                            | 1      | 4            | 0,03                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote   | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,141           | 30/12/2026        | 1 400                            | 1      | 3            | 0,02                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,819           | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,303           | 08/07/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,373           | 10/08/2026        | 200                              | 1      | 0            | 0,00                |
|              |                                                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,075           | 28/05/2027        | 400                              | 1      | 1            | 0,01                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | 6 mois                  | À payer                          | 2,075           | 28/05/2027        | 400                              | 1      | 1            | 0,01                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 269 | \$ 241       | 1,81                |

#### OPTIONS VENDUES

##### SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

| Contrepartie | Description                                                | Achat/vente de protection | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|---------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GST          | Option d'achat - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote  | Achat                     | 0,500 %         | 15/07/2026        | 200                              | \$ 0   | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option d'achat - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote  | Achat                     | 0,525           | 19/08/2026        | 400                              | 0      | (1)          | (0,01)              |
|              | Option de vente - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote | Vente                     | 0,600           | 15/07/2026        | 200                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote | Vente                     | 0,650           | 19/08/2026        | 400                              | (1)    | 0            | 0,00                |
| RBC          | Option de vente - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote | Vente                     | 0,525           | 19/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote | Vente                     | 0,550           | 19/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote | Vente                     | 0,600           | 19/08/2026        | 500                              | (1)    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans hors cote | Vente                     | 0,700           | 15/07/2026        | 200                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              |                                                            |                           |                 |                   |                                  | \$ (2) | \$ (1)       | (0,01)              |



## OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 25                               | \$ 0   | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 15                               | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre ZAR hors cote | ZAR 17,000      | 19/08/2026        | 110                              | (2)    | (5)          | (0,03)              |
| JPM          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 04/09/2026        | 20                               | 0      | 0            | 0,00                |
| UAG          | Option d'achat - EUR contre HUF hors cote  | HUF 375,000     | 10/11/2026        | 30                               | (1)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (3) | \$ (5)       | (0,03)              |

## SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| CKL          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,280 %         | 28/08/2026        | 200                              | \$ (2) | \$ (1)       | (0,01)              |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SONIA GBP à 6 mois      | À recevoir                       | 4,280           | 28/08/2026        | 100                              | (1)    | (1)          | (0,01)              |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,877           | 10/08/2026        | 200                              | (1)    | (1)          | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,903           | 08/07/2026        | 200                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              |                                                            |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (4) | \$ (3)       | (0,03)              |

## OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                        | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056 | \$ 100,625      | 06/08/2026        | 100                              | \$ (1) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 101,031         | 04/09/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
| GSC          | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/07/2056  | 93,969          | 06/07/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 95,188          | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056  | 95,383          | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
| JPM          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 101,000         | 04/09/2026        | 200                              | 0      | (1)          | (0,01)              |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056  | 101,469         | 08/09/2026        | 100                              | (1)    | (1)          | (0,01)              |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/09/2056 | 101,469         | 08/09/2026        | 100                              | (1)    | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,500 % éch. 01/08/2056  | 103,344         | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,500 % éch. 01/08/2056 | 103,344         | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
| MSC          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 6,000 % éch. 01/08/2056 | 101,000         | 06/08/2026        | 100                              | 0      | 0            | 0,00                |
| SAL          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 89,641          | 06/08/2026        | 700                              | (4)    | 0            | 0,00                |
|              |                                                                                                                    |                 |                   |                                  | \$ (7) | \$ (2)       | (0,02)              |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 70                             | \$ 16                  | \$ (1)                           | \$ 15        | 0,11                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 70                               | 16                     | (1)                              | 15           | 0,11                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 140                              | 33                     | (3)                              | 30           | 0,23                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 65                  | \$ (5)                           | \$ 60        | 0,45                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                             | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À recevoir         | Indice S&P 500 Total Return Index | 66                           | 4,170 %       | \$ 1 118          | 04/11/2026      | \$ 0                   | \$ (15)                          | \$ (15)      | (0,11)              |
| MBC          | À recevoir         | Indice S&P 500 Total Return Index | 7                            | 4,240         | 118               | 05/08/2026      | 0                      | (1)                              | (1)          | (0,01)              |
|              |                    |                                   |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ (16)                          | \$ (16)      | (0,12)              |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 63                | \$ 45              | \$ 1                  | \$ 0                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | NZD             | 80                | 47                 | 3                     | 0                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 12                | 10                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | CAD 2              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 41                | NZD 72             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 2                 | \$ 1               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 72                | 41                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | \$              | 7                 | € 6                | 0                     | 0                                      | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BPS          | 07/2026           | \$              | 1                 | KRW 2 021          | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 9                 | NOK 85             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 19                | \$ 7               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 28                | MXN 484            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 65                | \$ 10              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 30                | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 41                | BRL 209            | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 52                | £ 39               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4                 | INR 404            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2                 | ¥ 283              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 733               | \$ 45              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 9                 | BRL 45             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 12                | ZAR 199            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 21 917            | \$ 6               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 199 949           | 11                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 09/2026           | THB             | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 31                | IDR 544 833        | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 5                 | INR 451            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 4                 | IDR 63 741         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 82 911            | \$ 24              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 22                | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 116               | 69                 | 4                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 22                | COP 82 911         | 2                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 52                | TRY 2 458          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 3 619             | \$ 223             | 2                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 09/2026           | \$              | 24                | COP 82 911         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 10                | \$ 12              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 34                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 11                | CNH 75             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 5                 | COP 16 633         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 12                | HUF 3 585          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11                | PLN 40             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 64                | \$ 22              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN             | 17                | 5                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 4                 | ZAR 71             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP             | 112 586           | \$ 126             | 4                     | 0                                       | 0,03                |
|              | 09/2026           | COP             | 38 559            | 10                 | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | IDR             | 271 206           | 15                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 31                | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 261               | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 67                | CLP 57 831         | 0                     | (5)                                     | (0,03)              |
|              | 09/2026           |                 | 9                 | IDR 162 646        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1                 | PEN 5              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP             | 14 637            | \$ 4               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | PEN             | 333               | 96                 | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
| DUB          | 11/2026           | COP             | 2 402             | 1                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 160               | 47                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 737               | 211                | 0                     | (5)                                     | (0,03)              |
|              | 12/2026           | \$              | 15                | IDR 273 022        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN             | 58                | \$ 17              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 674               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 5                 | INR 460            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11                | PLN 41             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 1 683             | \$ 104             | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 0                 | PEN 1              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 112 880           | \$ 6               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 7                 | INR 679            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 64                | \$ 10              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 310               | 417                | 6                     | 0                                       | 0,04                |
|              | 07/2026           | ¥               | 4 427             | 27                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD             | 244               | 191                | 3                     | 0                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 31                | CNH 213            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 27                | HUF 8 252          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 17                | ¥ 2 678            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 39                | PLN 143            | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | ZAR             | 2 398             | \$ 145             | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CNH             | 213               | 31                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 28                | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 6                 | £ 5                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 27                | ¥ 4 415            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 465               | \$ 14              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 4                 | INR 361            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 54                | \$ 8               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 127               | CAD 181            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2                 | COP 6 866          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           |                 | 102               | ZAR 1 680          | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 181               | \$ 127             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 162               | BRL 825            | 0                     | (4)                                     | (0,03)              |
|              | 08/2026           |                 | 4                 | INR 361            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 72 260            | \$ 20              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 162 176           | 9                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 907               | 28                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM          | 09/2026           | \$              | 19                | BRL 98             | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 11                | IDR 199 151        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 16                | INR 1 540          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP             | 7 064             | \$ 2               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 274               | 195                | 7                     | 7                                       | 0,04                |
|              | 07/2026           | BRL             | 210               | 41                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 6                 | 4                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 70                | 23                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 64                | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 35                | HUF 10 823         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 19                | PLN 70             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 107               | \$ 37              | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|              | 08/2026           | \$              | 6                 | NOK 64             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 479               | \$ 15              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 7                 | INR 696            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 09/2026           |                 | 203               | MXN 3 534          | 0                     | (2)                                     | (0,02)              |
|              | 10/2026           |                 | 41                | BRL 214            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD             | 1                 | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 92                | 117                | 3                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           | COP             | 25 074            | 7                  | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 677               | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 21                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 137               | AUD 199            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 11                | INR 1 065          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2                 | ¥ 348              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 23                | KRW 34 773         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 172               | \$ 118             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2                 | NOK 21             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 122               | \$ 7               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 455               | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 09/2026           | \$              | 25                | INR 2 438          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 16                | KRW 24 706         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 24                | \$ 7               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | \$              | 11                | INR 1 075          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 60                | TRY 2 812          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 09/2026           |                 | 5                 | IDR 81 766         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 15                | INR 1 409          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 9                 | 896                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG          | 09/2026           | IDR             | 27 134            | \$ 2               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 329               | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 6                 | IDR 103 750        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 105               | \$ 16              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 552               | 644                | 14                    | 14                                      | 0,10                |
|              | 07/2026           | £               | 5                 | 7                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 96                | AUD 139            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 113               | CHF 92             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 633               | € 556              | 3                     | 3                                       | 0,02                |
|              | 07/2026           |                 | 7                 | ¥ 1 119            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           |                 | 198               | SGD 256            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 139               | \$ 96              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 91                | 113                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 556               | 634                | 0                     | (4)                                     | (0,02)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 256               | 198                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 7                 | £ 5                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 503 188           | \$ 28              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 180               | 130                | 5                     | 5                                       | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$              | 1                 | CAD 2              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 376               | £ 285              | 2                     | 2                                       | 0,01                |
| UAG          | 08/2026           | CAD             | 2                 | \$ 1               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP             | 542 014           | 142                | 0                     | (14)                                    | (0,10)              |
|              | 08/2026           | £               | 285               | 376                | 0                     | (1)                                     | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$              | 11                | PLN 41             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 58                | CLP 51 313         | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 37                | INR 3 522          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | HUF             | 2 487             | € 7                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | 788 604           | \$ 202             | 0                     | (19)                                    | (0,13)              |
|              |                   |                 |                   | \$ 64              | \$ (67)               | \$ (3)                                  | (0,02)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 277 2,07

## TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Ginnie Mae, TBA<br>3,000 % éch. 01/07/2056                     | \$ 400                        | \$ (355)                   | (2,65)              |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 2,000 % éch. 01/07/2056                                        | 240                           | (192)                      | (1,43)              |
| 2,500 % éch. 01/07/2056                                        | 350                           | (292)                      | (2,19)              |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)

| DESCRIPTION                                   |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------|----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 3,500 % éch. 01/08/2056                       | \$ | 600                                 | \$ (544)                         | (4,07)                    |
| 4,500 % éch. 01/08/2056                       |    | 50                                  | (48)                             | (0,36)                    |
| <b>Total des Titres vendus à découvert</b>    |    |                                     | <b>\$ (1 431)</b>                | <b>(10,70)</b>            |
| <b>Total des Investissements</b>              |    |                                     | <b>\$ 18 806</b>                 | <b>140,66</b>             |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b> |    |                                     | <b>\$ (5 436)</b>                | <b>(40,66)</b>            |
| <b>Actif net</b>                              |    |                                     | <b>\$ 13 370</b>                 | <b>100,00</b>             |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (d) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 1 215 \$ (31 décembre 2025 : 482 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 15 401                                                  | \$ 0                                                       | \$ 15 401        |
| Fonds d'investissement                        | 1 221                                                                                      | 0                                                          | 0                                                          | 1 221            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 3 300                                                      | 0                                                          | 3 300            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 82                                                                                         | 233                                                        | 0                                                          | 315              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (1 431)                                                    | 0                                                          | (1 431)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 303</b>                                                                            | <b>\$ 17 503</b>                                           | <b>\$ 0</b>                                                | <b>\$ 18 806</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 14 301                                                  | \$ 0                                                       | \$ 14 301        |
| Fonds d'investissement                        | 1 109                                                                                      | 0                                                          | 0                                                          | 1 109            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 4 400                                                      | 0                                                          | 4 400            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (1)                                                                                        | 66                                                         | 0                                                          | 65               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (1 402)                                                    | 0                                                          | (1 402)          |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 1 108</b>                                                                            | <b>\$ 17 365</b>                                           | <b>\$ 0</b>                                                | <b>\$ 18 473</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

|              | Au 30 juin 2026                                                  |                            |                                      | Au 31 décembre 2025                                           |                            |                                      |
|--------------|------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|
| Contrepartie | Total de la juste valeur<br>des instruments dérivés<br>hors cote | Garantie<br>(reçue)/nantie | Expositions<br>nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des<br>instruments dérivés hors cote | Garantie<br>(reçue)/nantie | Expositions<br>nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 4                                                             | \$ 0                       | \$ 4                                 | \$ S/O                                                        | \$ S/O                     | \$ S/O                               |
| BOA          | 23                                                               | 0                          | 23                                   | 15                                                            | 0                          | 15                                   |
| BPS          | 14                                                               | 0                          | 14                                   | 16                                                            | 0                          | 16                                   |
| BRC          | 19                                                               | 0                          | 19                                   | 6                                                             | 0                          | 6                                    |
| CBK          | 8                                                                | 0                          | 8                                    | 6                                                             | 0                          | 6                                    |
| CIB          | S/O                                                              | S/O                        | S/O                                  | (19)                                                          | 0                          | (19)                                 |
| CKL          | (1)                                                              | 0                          | (1)                                  | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |
| DUB          | 109                                                              | 0                          | 109                                  | 81                                                            | 0                          | 81                                   |
| FAR          | (8)                                                              | 0                          | (8)                                  | (52)                                                          | 0                          | (52)                                 |
| GLM          | 38                                                               | 0                          | 38                                   | 45                                                            | 0                          | 45                                   |
| GST          | (1)                                                              | 0                          | (1)                                  | (5)                                                           | 0                          | (5)                                  |
| JPM          | 75                                                               | 0                          | 75                                   | 63                                                            | 0                          | 63                                   |
| MBC          | 1                                                                | 0                          | 1                                    | (3)                                                           | 0                          | (3)                                  |
| MYC          | 12                                                               | 0                          | 12                                   | 3                                                             | 0                          | 3                                    |
| RBC          | S/O                                                              | S/O                        | S/O                                  | (4)                                                           | 0                          | (4)                                  |
| SOG          | 13                                                               | 0                          | 13                                   | (10)                                                          | 0                          | (10)                                 |
| SSB          | (8)                                                              | 0                          | (8)                                  | 1                                                             | 0                          | 1                                    |
| UAG          | (21)                                                             | 0                          | (21)                                 | (7)                                                           | 0                          | (7)                                  |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 5,57             | 5,52                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 43,84            | 38,35                |
| Autres valeurs mobilières                                        | S/O              | 0,02                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,92             | 3,40                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 10,59            | 13,50                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,33             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,46             | 0,29                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,19             | 0,90                 |
| Autres actifs                                                    | 34,10            | 37,99                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                                            | 1,07             | 1,22                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 83,98            | 86,86                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 1,09             | 1,24                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 5,04             | 6,35                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 10,33            | 12,74                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 8,25             | 10,84                |
| Instruments à court terme                                                                                | 5,44             | 0,88                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 9,13             | 9,32                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 24,68            | 36,96                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,68             | (0,07)               |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | S/O              | (0,01)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | 0,00             | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,08             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,47)           | (0,53)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit                                                               | S/O              | 0,03                 |
| Options de change                                                                                        | 0,04             | 0,05                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 1,81             | 1,70                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit                                                               | (0,01)           | (0,06)               |
| Options de change                                                                                        | (0,03)           | (0,04)               |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,03)           | (0,08)               |
| Options sur titres                                                                                       | (0,02)           | S/O                  |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,45             | 0,55                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | (0,12)           | (0,51)               |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,02)           | (0,50)               |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (10,70)          | (11,78)              |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (40,66)          | (55,17)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |





| DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                                                      |                                     |                                  |                           | American Home Mortgage Assets Trust                  | \$ 4 369                            | \$ 994                           | 0,04                      | Domi BV                                               | € 773                               | \$ 889                           | 0,03                      |
| Fannie Mae                                                                                    |                                     |                                  |                           | 4,664 % éch. 25/11/2046                              | 35                                  | 32                               | 0,00                      | 3,372 % éch. 15/02/2055                               |                                     |                                  |                           |
| 2,258 % éch. 25/11/2049 (a)                                                                   | \$ 85                               | \$ 10                            | 0,00                      | 6,750 % éch. 25/11/2046                              |                                     |                                  |                           | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust |                                     |                                  |                           |
| 3,908 % éch. 25/07/2033 (a)                                                                   | 21                                  | 2                                | 0,00                      | American Home Mortgage Investment Trust              | 9 129                               | 2 647                            | 0,10                      | 3,944 % éch. 19/10/2036                               | \$ 69                               | 65                               | 0,00                      |
| Freddie Mac                                                                                   |                                     |                                  |                           | 5,895 % éch. 25/12/2035                              |                                     |                                  |                           | Dutch Property Finance BV                             |                                     |                                  |                           |
| 2,843 % éch. 15/06/2042 (a)                                                                   | 28                                  | 4                                | 0,00                      | Aran Funding DAC                                     | € 9 230                             | 10 570                           | 0,38                      | 2,913 % éch. 28/10/2059                               | € 983                               | 1 125                            | 0,04                      |
| 4,750 % éch. 25/08/2057                                                                       | 7 944                               | 7 709                            | 0,28                      | 3,379 % éch. 24/12/2065                              |                                     |                                  |                           | 3,063 % éch. 28/04/2062                               | 824                                 | 944                              | 0,03                      |
| Ginnie Mae                                                                                    |                                     |                                  |                           | Avon Finance PLC                                     | £ 1 742                             | 2 313                            | 0,08                      | Edenbrook Mortgage Funding PLC                        | £ 2 585                             | 3 435                            | 0,13                      |
| 3,000 % éch. 20/07/2052                                                                       | 17 419                              | 15 509                           | 0,56                      | 4,646 % éch. 28/12/2049                              |                                     |                                  |                           | 4,616 % éch. 22/03/2057                               |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 20/03/2052 - 20/01/2056                                                          | 49 946                              | 44 984                           | 1,63                      | Banc of America Funding Corp.                        | \$ 1 192                            | 1 137                            | 0,04                      | EMF-UK PLC                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 20/07/2040 - 20/07/2043                                                          | 7 252                               | 7 174                            | 0,26                      | 4,371 % éch. 25/09/2048                              |                                     |                                  |                           | 4,846 % éch. 13/03/2046                               | 583                                 | 775                              | 0,03                      |
| 6,500 % éch. 20/01/2055 - 20/02/2055                                                          | 633                                 | 657                              | 0,02                      | Banc of America Funding Trust                        | 30                                  | 26                               | 0,00                      | Eurosail PLC                                          | 1 120                               | 1 471                            | 0,05                      |
| Ginnie Mae, TBA                                                                               |                                     |                                  |                           | 3,832 % éch. 20/05/2036                              | 5 100                               | 3 646                            | 0,13                      | 4,566 % éch. 13/09/2045                               | 220                                 | 293                              | 0,01                      |
| 3,000 % éch. 01/07/2056                                                                       | 50 000                              | 44 383                           | 1,61                      | Banc of America Merrill Lynch Trust                  |                                     |                                  |                           | 4,816 % éch. 13/06/2045                               |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                                                       | 29 200                              | 27 148                           | 0,98                      | 2,848 % éch. 14/08/2034                              | 90                                  | 90                               | 0,00                      | Frontier Mortgage Funding PLC                         | 9 900                               | 13 151                           | 0,48                      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056                                                                       | 8 800                               | 8 454                            | 0,31                      | BCAP LLC Trust                                       | 125                                 | 114                              | 0,00                      | 4,532 % éch. 20/12/2066                               | 100                                 | 133                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056                                                                       | 36 100                              | 35 596                           | 1,29                      | 4,440 % éch. 26/03/2037                              |                                     |                                  |                           | 4,732 % éch. 28/12/2066                               | 100                                 | 133                              | 0,01                      |
| 5,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                          | 3 300                               | 3 316                            | 0,12                      | 5,063 % éch. 25/09/2047                              |                                     |                                  |                           | 5,082 % éch. 20/12/2066                               | 100                                 | 133                              | 0,01                      |
| 6,000 % éch. 01/09/2056                                                                       | 14 500                              | 14 770                           | 0,54                      | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust          | 348                                 | 305                              | 0,01                      | 5,482 % éch. 20/12/2066                               | 100                                 | 133                              | 0,01                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                          | 46 000                              | 47 657                           | 1,73                      | 3,656 % éch. 25/07/2036                              |                                     |                                  |                           | 6,232 % éch. 20/12/2066                               | 100                                 | 132                              | 0,01                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                                     |                                     |                                  |                           | Bear Stearns ALT-A Trust                             | 4 678                               | 2 175                            | 0,08                      | GreenPoint Mortgage Funding Trust                     | \$ 358                              | 352                              | 0,01                      |
| 3,000 % éch. 01/03/2050 - 01/05/2052                                                          | 1 160                               | 1 016                            | 0,04                      | 4,119 % éch. 25/09/2047                              | 1 225                               | 1 167                            | 0,04                      | 4,003 % éch. 25/10/2045                               | 287                                 | 279                              | 0,01                      |
| 3,500 % éch. 01/04/2048 - 01/02/2050                                                          | 394                                 | 363                              | 0,01                      | 4,283 % éch. 25/11/2035                              | 95                                  | 126                              | 0,01                      | 4,163 % éch. 25/10/2046                               |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/08/2039 - 01/05/2047                                                          | 867                                 | 835                              | 0,03                      | 5,488 % éch. 25/07/2034                              |                                     |                                  |                           | Grifonas Finance PLC                                  | € 85                                | 96                               | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 01/11/2054                                                                       | 25 017                              | 24 694                           | 0,89                      | Bear Stearns Mortgage Funding Trust                  | 702                                 | 676                              | 0,03                      | 2,419 % éch. 28/08/2039                               |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 01/03/2045 - 01/06/2055                                                          | 1 221                               | 1 293                            | 0,05                      | 4,203 % éch. 25/08/2036                              |                                     |                                  |                           | GS Mortgage Securities Corp. Trust                    | \$ 0                                | 0                                | 0,00                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA                                |                                     |                                  |                           | Benchmark Mortgage Trust                             | 1 892                               | 1 888                            | 0,07                      | 4,003 % éch. 10/07/2051                               |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/07/2041 - 01/08/2056                                                          | 143 000                             | 124 854                          | 4,52                      | 4,077 % éch. 15/07/2051                              | 7 000                               | 6 988                            | 0,25                      | GS Mortgage Securities Corp. Trust                    | 16 400                              | 16 078                           | 0,58                      |
| 3,500 % éch. 01/08/2056                                                                       | 12 150                              | 11 016                           | 0,40                      | 4,377 % éch. 15/05/2053                              |                                     |                                  |                           | 3,721 % éch. 10/02/2037                               | 7 355                               | 1 712                            | 0,06                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/09/2056                                                          | 75 400                              | 70 428                           | 2,55                      | Blechny Park Funding PLC                             | £ 910                               | 1 210                            | 0,04                      | 5,102 % éch. 26/04/2037                               |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                          | 25 890                              | 24 796                           | 0,90                      | 4,604 % éch. 27/07/2070                              |                                     |                                  |                           | GSMPs Mortgage Loan Trust                             | 1 444                               | 1 364                            | 0,05                      |
| 5,000 % éch. 01/08/2056                                                                       | 283 264                             | 278 042                          | 8                         | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates | \$ 306                              | 298                              | 0,01                      | 4,113 % éch. 25/03/2035                               | 832                                 | 783                              | 0,03                      |
| 5,500 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                          | 61 125                              | 61 263                           | 2,22                      | 3,963 % éch. 25/01/2036                              | 4 344                               | 4 328                            | 0,16                      | 7,052 % éch. 20/10/2032                               |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/08/2056 - 01/09/2056                                                          | 227 125                             | 231 282                          | 8,38                      | Citigroup Commercial Mortgage Trust                  |                                     |                                  |                           | GSR Mortgage Loan Trust                               | 1 964                               | 471                              | 0,02                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2056                                                                       | 76 775                              | 79 426                           | 2,88                      | 4,242 % éch. 10/11/2051                              |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/08/2036                               |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 01/08/2056                                                                       | 400                                 | 420                              | 0,01                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                  | 36                                  | 35                               | 0,00                      | HarborView Mortgage Loan Trust                        | 464                                 | 421                              | 0,02                      |
|                                                                                               | <b>1 167 101</b>                    | <b>42,29</b>                     |                           | 4,445 % éch. 25/09/2037                              |                                     |                                  |                           | 4,164 % éch. 19/12/2036                               | 2 894                               | 2 766                            | 0,10                      |
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                        |                                     |                                  |                           | CitiMortgage Alternative Loan Trust                  | 145                                 | 130                              | 0,01                      | 4,174 % éch. 19/11/2036                               | 73                                  | 33                               | 0,00                      |
| Obligations du Trésor américain                                                               |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/12/2036                              |                                     |                                  |                           | 5,744 % éch. 19/10/2035                               |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/11/2045                                                                       | 6 219                               | 5 974                            | 0,22                      | Commercial Mortgage Trust                            | 1 800                               | 1 777                            | 0,07                      | Harvest Funding PLC                                   | £ 4 600                             | 6 106                            | 0,22                      |
| 4,625 % éch. 15/02/2046                                                                       | 1 000                               | 960                              | 0,03                      | 3,140 % éch. 10/10/2036                              |                                     |                                  |                           | 4,643 % éch. 15/11/2069                               |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 15/02/2056                                                                       | 31 179                              | 30 295                           | 1,10                      | Countrywide Alternative Loan Trust                   | 1 362                               | 1 265                            | 0,05                      | HomeBanc Mortgage Trust                               | \$ 9                                | 9                                | 0,00                      |
| 4,875 % éch. 15/08/2045                                                                       | 1 057                               | 1 049                            | 0,04                      | 4,043 % éch. 25/06/2037                              | 42                                  | 39                               | 0,00                      | 4,274 % éch. 25/04/2037                               |                                     |                                  |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (g)                                    |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/02/2047                              | 226                                 | 225                              | 0,01                      | Household Capital RMBS                                | AUD 8 224                           | 5 683                            | 0,21                      |
| 0,125 % éch. 15/01/2031                                                                       | 128                                 | 118                              | 0,00                      | 4,173 % éch. 25/06/2037                              | 1 294                               | 950                              | 0,03                      | 6,231 % éch. 21/07/2087                               |                                     |                                  |                           |
| 0,125 % éch. 15/07/2031                                                                       | 124                                 | 114                              | 0,00                      | 4,263 % éch. 25/05/2035                              | 1 379                               | 1 111                            | 0,04                      | Impac CMB Trust                                       | \$ 31                               | 31                               | 0,00                      |
| 0,625 % éch. 15/07/2032                                                                       | 3 438                               | 3 185                            | 0,12                      | 4,314 % éch. 25/03/2047                              | 394                                 | 369                              | 0,01                      | 4,403 % éch. 25/03/2035                               |                                     |                                  |                           |
| 0,750 % éch. 15/02/2042                                                                       | 147                                 | 113                              | 0,00                      | 4,363 % éch. 25/08/2035                              | 72                                  | 69                               | 0,00                      | IndyMac Mortgage Loan Trust                           | 2 509                               | 1 607                            | 0,06                      |
| 0,875 % éch. 15/02/2047                                                                       | 1 379                               | 970                              | 0,04                      | 4,394 % éch. 20/12/2035                              | 254                                 | 172                              | 0,01                      | 3,465 % éch. 25/08/2037                               | 1 366                               | 1 138                            | 0,04                      |
| 1,000 % éch. 15/02/2046                                                                       | 21 076                              | 15 486                           | 0,56                      | 5,063 % éch. 25/10/2035                              | 2 601                               | 2 478                            | 0,09                      | 3,805 % éch. 25/06/2036                               | 65                                  | 61                               | 0,00                      |
| 1,000 % éch. 15/02/2049                                                                       | 4 247                               | 2 984                            | 0,11                      | 5,223 % éch. 25/11/2035                              | 1 027                               | 895                              | 0,03                      | 4,123 % éch. 25/02/2037                               | 449                                 | 301                              | 0,01                      |
| 1,375 % éch. 15/07/2033                                                                       | 49 768                              | 47 753                           | 1,73                      | 5,454 % éch. 20/11/2035                              | 1 544                               | 1 062                            | 0,04                      | 4,343 % éch. 25/01/2036                               |                                     |                                  |                           |
| 1,375 % éch. 15/02/2044                                                                       | 143                                 | 117                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/09/2035                              | 237                                 | 114                              | 0,00                      | Jeronimo Funding DAC                                  | € 6 241                             | 7 171                            | 0,26                      |
| 1,750 % éch. 15/01/2034                                                                       | 1 300                               | 1 270                            | 0,05                      | 6,000 % éch. 25/01/2037                              | 104                                 | 52                               | 0,00                      | 3,415 % éch. 25/10/2064                               |                                     |                                  |                           |
| 1,875 % éch. 15/07/2034                                                                       | 22 918                              | 22 594                           | 0,82                      | 6,000 % éch. 25/07/2037                              |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust   | \$ 1 000                            | 946                              | 0,03                      |
| 2,125 % éch. 15/04/2029                                                                       | 33 905                              | 34 010                           | 1,23                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.    | 242                                 | 224                              | 0,01                      | 4,248 % éch. 05/07/2033                               | 510                                 | 494                              | 0,02                      |
| 2,125 % éch. 15/02/2041                                                                       | 152                                 | 145                              | 0,01                      | 4,243 % éch. 25/04/2036                              |                                     |                                  |                           | 4,802 % éch. 05/07/2033                               |                                     |                                  |                           |
| 2,375 % éch. 15/10/2028                                                                       | 37 935                              | 38 352                           | 1,39                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust    | 57                                  | 54                               | 0,00                      | JPMorgan Mortgage Trust                               | 23                                  | 17                               | 0,00                      |
| du Trésor américain                                                                           |                                     |                                  |                           | 4,309 % éch. 25/11/2037                              | 1 099                               | 1 064                            | 0,04                      | 4,645 % éch. 25/08/2036                               | 60                                  | 51                               | 0,00                      |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                       | 1 010                               | 986                              | 0,03                      | 4,343 % éch. 25/04/2035                              | 97                                  | 87                               | 0,00                      | 5,234 % éch. 25/01/2037                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                               | <b>206 475</b>                      | <b>7,48</b>                      |                           | 4,363 % éch. 25/05/2035                              | 446                                 | 350                              | 0,01                      | Jubilee Place BV                                      | € 10 414                            | 11 921                           | 0,43                      |
| <b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/02/2035                              | 63                                  | 28                               | 0,00                      | 3,127 % éch. 18/09/2062                               |                                     |                                  |                           |
| Adjustable Rate Mortgage Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/07/2036                              | 94                                  | 34                               | 0,00                      | Lehman XS Trust                                       | \$ 1 055                            | 1 044                            | 0,04                      |
| 5,043 % éch. 25/04/2035                                                                       | 19                                  | 19                               | 0,00                      | 6,500 % éch. 25/12/2037                              |                                     |                                  |                           | 4,263 % éch. 25/08/2037                               |                                     |                                  |                           |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                                   |                                     |                                  |                           | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust       | 466                                 | 423                              | 0,02                      | Liberty Trust                                         | AUD 11 412                          | 7 914                            | 0,29                      |
| 3,509 % éch. 30/11/2037                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,710 % éch. 25/01/2034                              | 85                                  | 84                               | 0,00                      | 5,305 % éch. 25/04/2058                               |                                     |                                  |                           |
| CSAIL Commercial Mortgage Trust                                                               |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/11/2034                              |                                     |                                  |                           | London Wall Mortgage Capital PLC                      | £ 11 463                            | 15 248                           | 0,55                      |
| 4,142 % éch. 15/08/2051                                                                       | 14 335                              | 14 307                           | 0,52                      | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates          | 2 909                               | 2 702                            | 0,10                      | 4,738 % éch. 15/05/2057                               |                                     |                                  |                           |
| DBGS Mortgage Trust                                                                           |                                     |                                  |                           | 3,509 % éch. 30/11/2037                              |                                     |                                  |                           | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                 | \$ 6 638                            | 2 576                            | 0,09                      |
| 4,358 % éch. 15/10/2051                                                                       | 111                                 | 111                              | 0,00                      | CSAIL Commercial Mortgage Trust                      |                                     |                                  |                           | 4,863 % éch. 25/09/2037                               |                                     |                                  |                           |
| Dilosk RMBS DAC                                                                               |                                     |                                  |                           | 4,142 % éch. 15/08/2051                              |                                     |                                  |                           | Merrion Square Residential DAC                        | € 2 137                             | 2 451                            | 0,09                      |
| 3,080 % éch. 24/09/2060                                                                       | € 13 847                            | 15 843                           | 0,57                      | DBGS Mortgage Trust                                  |                                     |                                  |                           | 3,378 % éch. 24/03/2081                               |                                     |                                  |                           |
| 3,204 % éch. 20/10/2062                                                                       | 1 776                               | 2 035                            | 0,07                      | 4,358 % éch. 15/10/2051                              |                                     |                                  |                           | Mill City Mortgage Loan Trust                         | \$ 7 400                            | 6 295                            | 0,23                      |
|                                                                                               |                                     |                                  |                           | Dilosk RMBS DAC                                      |                                     |                                  |                           | 3,810 % éch. 25/11/2058                               |                                     |                                  |                           |

# Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust<br>4,023 % éch. 25/04/2035                         | \$ 31                               | \$ 32                            | 0,00                      | Golden Bar Securitisation SRL<br>5,286 % éch. 22/09/2043                                             | € 674                               | \$ 787                           | 0,03                      | 4,103 % éch. 25/12/2036                                                                       | \$ 23 798                           | \$ 5 733                         | 0,21                      |
| Mortgage Equity Conversion Asset Trust<br>4,510 % éch. 25/05/2042                     | 29                                  | 26                               | 0,00                      | Hill FL BV<br>2,909 % éch. 18/10/2033                                                                | 7 700                               | 8 804                            | 0,32                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.<br>4,348 % éch. 25/05/2035                                | 511                                 | 509                              | 0,02                      |
| Mortimer BTL PLC<br>4,916 % éch. 22/12/2056                                           | £ 545                               | 724                              | 0,03                      | Metro Finance Trust<br>5,370 % éch. 16/02/2033                                                       | AUD 11 167                          | 7 738                            | 0,28                      | 4,513 % éch. 25/06/2035                                                                       | 451                                 | 449                              | 0,02                      |
| New Residential Mortgage Loan Trust<br>4,500 % éch. 25/05/2058                        | \$ 689                              | 666                              | 0,02                      |                                                                                                      |                                     | 52 101                           | 1,89                      | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust<br>4,033 % éch. 25/07/2036                                | 2 782                               | 2 535                            | 0,09                      |
| Polaris PLC<br>4,555 % éch. 26/02/2068                                                | £ 4 428                             | 5 878                            | 0,21                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/03/2037                                                                       | 9 800                               | 9 539                            | 0,35                      |
| RBSGC Mortgage Loan Trust<br>6,000 % éch. 25/01/2037                                  | \$ 12                               | 10                               | 0,00                      |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | 4,183 % éch. 25/10/2036                                                                       | 11                                  | 11                               | 0,00                      |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust<br>4,143 % éch. 25/09/2036                   | 2 606                               | 2 470                            | 0,09                      | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES COMMERCIALES<br>AUTRES                                    |                                     |                                  |                           | Long Beach Mortgage Loan Trust<br>4,123 % éch. 25/03/2046                                     | 2 381                               | 2 102                            | 0,08                      |
| 4,655 % éch. 25/10/2037                                                               | 261                                 | 206                              | 0,01                      | Dwight Issuer LLC<br>5,000 % éch. 18/01/2044 (b)                                                     | \$ 10 100                           | 10 113                           | 0,37                      | 4,363 % éch. 25/01/2036                                                                       | 2 047                               | 1 857                            | 0,07                      |
| 6,500 % éch. 25/07/2036                                                               | 60                                  | 50                               | 0,00                      | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                                                  |                                     |                                  |                           | MASTR Asset-Backed Securities Trust<br>4,283 % éch. 25/06/2036                                | 1 147                               | 1 085                            | 0,04                      |
| RMAC PLC<br>4,947 % éch. 15/02/2047                                                   | £ 679                               | 901                              | 0,03                      | Ames Mortgage Investment Trust<br>4,543 % éch. 25/10/2035                                            | 41                                  | 41                               | 0,00                      | 4,543 % éch. 25/02/2034                                                                       | 877                                 | 947                              | 0,03                      |
| Sandwell Commercial Finance PLC<br>5,854 % éch. 30/09/2037                            | 20                                  | 9                                | 0,00                      | Accredited Mortgage Loan Trust<br>4,033 % éch. 25/09/2036                                            | 16 826                              | 16 292                           | 0,59                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust<br>4,063 % éch. 25/08/2037                             | 442                                 | 429                              | 0,02                      |
| Sapphire Trust Central Finance<br>4,999 % éch. 12/02/2067                             | AUD 433                             | 300                              | 0,01                      | 4,223 % éch. 25/12/2035                                                                              | 2 500                               | 2 107                            | 0,08                      | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>3,546 % éch. 25/01/2035                             | 725                                 | 674                              | 0,02                      |
| Stratton Mortgage Funding PLC<br>4,649 % éch. 28/06/2050                              | £ 2 391                             | 3 175                            | 0,12                      | 4,633 % éch. 25/09/2035                                                                              | 919                                 | 899                              | 0,03                      | 3,873 % éch. 25/02/2037                                                                       | 1 137                               | 497                              | 0,02                      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust<br>4,298 % éch. 25/09/2035             | \$ 43                               | 29                               | 0,00                      | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust<br>4,063 % éch. 25/04/2036                               | 89                                  | 87                               | 0,00                      | 3,913 % éch. 25/02/2037                                                                       | 1 972                               | 862                              | 0,03                      |
| 5,144 % éch. 25/05/2035                                                               | 94                                  | 74                               | 0,00                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                                                              | 223                                 | 73                               | 0,00                      | 4,013 % éch. 25/07/2036                                                                       | 100                                 | 91                               | 0,00                      |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust<br>4,363 % éch. 25/08/2036                | 3 709                               | 3 046                            | 0,11                      | 4,243 % éch. 25/04/2036                                                                              | 5 068                               | 4 642                            | 0,17                      | 4,013 % éch. 25/03/2037                                                                       | 7 331                               | 2 951                            | 0,11                      |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>4,672 % éch. 20/07/2053                            | £ 758                               | 1 007                            | 0,04                      | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates<br>4,408 % éch. 25/12/2035    | 1 782                               | 1 698                            | 0,06                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                                                       | 237                                 | 84                               | 0,00                      |
| 4,984 % éch. 20/04/2051                                                               | 2 106                               | 2 797                            | 0,10                      | 4,763 % éch. 25/03/2035                                                                              | 226                                 | 217                              | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/04/2036                                                                       | 1 534                               | 1 482                            | 0,05                      |
| 5,284 % éch. 20/04/2051                                                               | 1 264                               | 1 680                            | 0,06                      | Amerique Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates<br>4,738 % éch. 25/07/2035 | 3 990                               | 3 863                            | 0,14                      | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust<br>3,863 % éch. 25/04/2037                              | 88                                  | 45                               | 0,00                      |
| 5,984 % éch. 20/04/2051                                                               | 1 053                               | 1 402                            | 0,05                      | 4,738 % éch. 25/09/2035                                                                              | 1 635                               | 1 570                            | 0,06                      | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust<br>6,077 % éch. 25/10/2046                                 | 3 761                               | 841                              | 0,03                      |
| 6,984 % éch. 20/04/2051                                                               | 843                                 | 1 121                            | 0,04                      | Argent Securities Trust<br>3,983 % éch. 25/05/2036                                                   | 287                                 | 67                               | 0,00                      | New Century Home Equity Loan Trust<br>4,543 % éch. 25/03/2035                                 | 72                                  | 71                               | 0,00                      |
| 7,984 % éch. 20/04/2051                                                               | 526                                 | 701                              | 0,03                      | 4,063 % éch. 25/07/2036                                                                              | 3 986                               | 3 634                            | 0,13                      | 4,738 % éch. 25/06/2035                                                                       | 3 383                               | 3 343                            | 0,12                      |
| Twin Bridges PLC<br>4,927 % éch. 15/05/2056                                           | 210                                 | 279                              | 0,01                      | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust<br>4,723 % éch. 25/11/2035                      | 1 670                               | 1 480                            | 0,05                      | NovaStar Mortgage Funding Trust<br>3,963 % éch. 25/09/2037                                    | 63                                  | 62                               | 0,00                      |
| Vecht Residential BV<br>3,181 % éch. 22/05/2058                                       | € 803                               | 921                              | 0,03                      | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>4,813 % éch. 25/08/2037                                | 131                                 | 119                              | 0,00                      | Option One Mortgage Loan Trust<br>3,903 % éch. 25/03/2037                                     | 127                                 | 115                              | 0,00                      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>3,748 % éch. 25/12/2046              | \$ 1 553                            | 1 380                            | 0,05                      | Carrington Mortgage Loan Trust<br>4,363 % éch. 25/01/2036                                            | 4 846                               | 4 764                            | 0,17                      | 3,983 % éch. 25/04/2037                                                                       | 395                                 | 280                              | 0,01                      |
| 3,977 % éch. 25/05/2046                                                               | 2 885                               | 2 597                            | 0,09                      | 4,813 % éch. 25/05/2035                                                                              | 876                                 | 855                              | 0,03                      | 4,203 % éch. 25/05/2037                                                                       | 293                                 | 177                              | 0,01                      |
| 3,986 % éch. 25/02/2037                                                               | 26                                  | 25                               | 0,00                      | CIT Mortgage Loan Trust<br>5,263 % éch. 25/10/2037                                                   | 283                                 | 286                              | 0,01                      | 4,303 % éch. 25/01/2036                                                                       | 1 297                               | 1 234                            | 0,05                      |
| 4,343 % éch. 25/07/2045                                                               | 470                                 | 454                              | 0,02                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>7,250 % éch. 25/10/2037                                       | 607                                 | 529                              | 0,02                      | 4,543 % éch. 25/11/2034                                                                       | 81                                  | 86                               | 0,00                      |
| 4,563 % éch. 25/06/2044                                                               | 194                                 | 196                              | 0,01                      | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>4,013 % éch. 25/02/2036                         | 63                                  | 60                               | 0,00                      | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates<br>4,588 % éch. 25/07/2035 | 2 120                               | 2 049                            | 0,07                      |
| 4,663 % éch. 25/10/2045                                                               | 4 127                               | 3 668                            | 0,13                      | 4,023 % éch. 25/12/2036                                                                              | 1 538                               | 1 444                            | 0,05                      | 5,083 % éch. 25/01/2036                                                                       | 4 409                               | 4 247                            | 0,15                      |
| 4,792 % éch. 25/08/2046                                                               | 7 451                               | 6 569                            | 0,24                      | 4,043 % éch. 25/04/2047                                                                              | 104                                 | 101                              | 0,00                      | Renaissance Home Equity Loan Trust<br>5,285 % éch. 25/01/2037                                 | 227                                 | 66                               | 0,00                      |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>4,213 % éch. 25/05/2035 | 214                                 | 184                              | 0,01                      | 4,203 % éch. 25/09/2037                                                                              | 31                                  | 34                               | 0,00                      | 5,545 % éch. 25/01/2037                                                                       | 334                                 | 102                              | 0,00                      |
| 5,750 % éch. 25/01/2036                                                               | 583                                 | 520                              | 0,02                      | 4,263 % éch. 25/10/2034                                                                              | 2 453                               | 2 411                            | 0,09                      | 5,580 % éch. 25/11/2036                                                                       | 683                                 | 203                              | 0,01                      |
| Wells Fargo Alternative Loan Trust<br>6,250 % éch. 25/07/2037                         | 599                                 | 530                              | 0,02                      | 4,263 % éch. 25/11/2047                                                                              | 3 992                               | 3 737                            | 0,14                      | Residential Asset Securities Corp. Trust<br>4,443 % éch. 25/05/2037                           | 183                                 | 182                              | 0,01                      |
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust<br>4,058 % éch. 15/08/2051                      | 7 870                               | 7 853                            | 0,29                      | 4,283 % éch. 25/09/2046                                                                              | 161                                 | 157                              | 0,01                      | 4,798 % éch. 25/10/2035                                                                       | 284                                 | 282                              | 0,01                      |
| Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust<br>6,486 % éch. 25/10/2036               | 7                                   | 6                                | 0,00                      | 5,505 % éch. 25/07/2035                                                                              | 743                                 | 731                              | 0,03                      | Saxon Asset Securities Trust<br>1,661 % éch. 25/05/2035                                       | 54                                  | 53                               | 0,00                      |
| Winchester PLC<br>4,637 % éch. 21/10/2056                                             | £ 3 912                             | 5 198                            | 0,19                      | Ellington Loan Acquisition Trust<br>4,863 % éch. 25/05/2037                                          | 45                                  | 43                               | 0,00                      | 4,198 % éch. 25/09/2036                                                                       | 4 134                               | 3 998                            | 0,15                      |
|                                                                                       |                                     | 263 620                          | 9,55                      | Fieldstone Mortgage Investment Trust<br>3,939 % éch. 25/11/2036                                      | 1 569                               | 1 040                            | 0,04                      | 5,513 % éch. 25/12/2037                                                                       | 1 084                               | 1 033                            | 0,04                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | Fremont Home Loan Trust<br>4,043 % éch. 25/01/2037                                                   |                                     |                                  |                           | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust<br>4,043 % éch. 25/01/2037                     | 3 339                               | 2 919                            | 0,11                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,063 % éch. 25/01/2037                                                                              | 1 286                               | 583                              | 0,02                      | Soundview Home Loan Trust<br>3,913 % éch. 25/06/2037                                          | 326                                 | 227                              | 0,01                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,828 % éch. 25/06/2035                                                                              | 239                                 | 237                              | 0,01                      | 3,933 % éch. 25/07/2037                                                                       | 563                                 | 494                              | 0,02                      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                            |                                     |                                  |                           | GSAA Home Equity Trust<br>3,863 % éch. 25/09/2036                                                    | 13 594                              | 2 842                            | 0,10                      | 3,933 % éch. 25/08/2037                                                                       | 692                                 | 607                              | 0,02                      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES                                         |                                     |                                  |                           | 3,863 % éch. 25/12/2046                                                                              | 783                                 | 377                              | 0,01                      | 4,063 % éch. 25/03/2037                                                                       | 34                                  | 32                               | 0,00                      |
| Angle Asset Finance Radian Trust<br>5,500 % éch. 16/03/2033                           | AUD 14 250                          | 9 896                            | 0,36                      | 4,363 % éch. 25/03/2037                                                                              | 162                                 | 64                               | 0,00                      | 4,228 % éch. 25/06/2036                                                                       | 7 547                               | 6 814                            | 0,25                      |
| Auto1 Car Funding SARL<br>2,829 % éch. 15/12/2033                                     | € 161                               | 184                              | 0,01                      | 5,985 % éch. 25/06/2036                                                                              | 1 070                               | 231                              | 0,01                      | 4,263 % éch. 25/10/2036                                                                       | 101                                 | 98                               | 0,00                      |
| Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC<br>2,779 % éch. 15/08/2033                   | 5 367                               | 6 148                            | 0,22                      | GSAMP Trust<br>4,503 % éch. 25/03/2047                                                               | 8 078                               | 5 959                            | 0,22                      | 4,663 % éch. 25/10/2037                                                                       | 1 547                               | 1 232                            | 0,04                      |
| Driver Australia Ten<br>5,450 % éch. 21/02/2033                                       | AUD 1 916                           | 1 330                            | 0,05                      | Home Equity Asset Trust<br>4,438 % éch. 25/02/2036                                                   | 129                                 | 127                              | 0,00                      | 4,763 % éch. 25/09/2037                                                                       | 4 946                               | 3 720                            | 0,14                      |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                                 | € 8 993                             | 10 296                           | 0,37                      | 4,708 % éch. 25/12/2035                                                                              | 780                                 | 765                              | 0,03                      | 4,798 % éch. 25/05/2035                                                                       | 631                                 | 631                              | 0,02                      |
| FTA Santander Consumer Spain Auto<br>3,236 % éch. 22/09/2039                          | 6 034                               | 6 918                            | 0,25                      | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust<br>3,923 % éch. 25/11/2036                              | 2 302                               | 2 148                            | 0,08                      | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust<br>4,263 % éch. 25/11/2037              | 2 600                               | 2 449                            | 0,09                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,003 % éch. 25/04/2037                                                                              | 1 618                               | 1 141                            | 0,04                      | 4,888 % éch. 25/07/2035                                                                       | 1 220                               | 1 258                            | 0,05                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 25/04/2037                                                                              | 1 538                               | 1 085                            | 0,04                      |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           | HSI Asset Securitization Corp. Trust<br>4,043 % éch. 25/01/2037                                      | 4 184                               | 3 208                            | 0,12                      |                                                                                               |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER PAR TRANCHES                                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC<br>3,089 % éch. 25/01/2037                  | 155                                 | 42                               | 0,00                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust<br>4,183 % éch. 25/03/2037              | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
|                                                                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                                                                               |                                     | 44                               | 0,00                      |

|                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| DESCRIPTION                                       |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION                                 |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION                                                           |                                     |                                  |                           |      |
| AUTRES TITRES ADOSSES A DES ACTIFS                |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           |                                                                       |                                     |                                  |                           |      |
| AlbaCore Euro CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 28/05/2042                                               | COP                                 | 2 745 300                        | \$ 648                    | 0,02 |
| 3,194 % éch. 15/07/2035                           | €                                   | 980                              | \$ 1 123                  | 3,414 % éch. 15/07/2039                     | €                                   | 9 900                            | \$ 11 333                 | 11,000 % éch. 22/08/2029                                              |                                     | 12 999 800                       | 3 660                     | 0,13 |
| Aqueduct European CLO DAC                         |                                     |                                  |                           | OCF Euro CLO DAC                            |                                     | 8 800                            | 10 061                    | 11,500 % éch. 25/07/2046                                              |                                     | 1 611 400                        | 453                       | 0,02 |
| 3,511 % éch. 15/07/2039 (b)                       | 10 100                              | 11 547                           | 0,42                      | 3,513 % éch. 15/04/2037                     |                                     | 4 063                            | 5 031                     | 11,750 % éch. 24/01/2035                                              |                                     | 23 946 000                       | 6 822                     | 0,25 |
| 4,121 % éch. 15/07/2039 (b)                       | 5 000                               | 5 716                            | 0,21                      | 4,063 % éch. 15/04/2037                     |                                     | 4 400                            | 5 031                     | 12,000 % éch. 13/03/2058                                              |                                     | 656 600                          | 188                       | 0,01 |
| Arbour CLO DAC                                    |                                     |                                  |                           | Palmer Square BDC CLO Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 12,500 % éch. 27/02/2030                                              |                                     | 9 637 500                        | 2 813                     | 0,10 |
| 3,433 % éch. 15/11/2037                           | 3 500                               | 4 007                            | 0,15                      | 5,273 % éch. 15/07/2037                     | \$                                  | 1 600                            | 1 601                     | 12,750 % éch. 28/11/2040                                              |                                     | 17 836 400                       | 5 397                     | 0,20 |
| 3,581 % éch. 15/12/2038                           | 1 600                               | 1 832                            | 0,07                      | Palmer Square European Loan Funding DAC     |                                     |                                  |                           | 13,250 % éch. 09/02/2033                                              |                                     | 27 054 400                       | 8 280                     | 0,30 |
| Ares European CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | 3,253 % éch. 15/05/2033                     | €                                   | 323                              | 370                       | Obligation internationale du gouvernement costaricain                 |                                     |                                  |                           |      |
| 2,984 % éch. 15/10/2031                           | 522                                 | 597                              | 0,02                      | 3,273 % éch. 15/05/2034                     |                                     | 1 084                            | 1 240                     | 5,500 % éch. 21/11/2030                                               | €                                   | 1 250                            | 1 504                     | 0,06 |
| 3,160 % éch. 17/04/2032                           | 9 515                               | 10 888                           | 0,39                      | 3,283 % éch. 15/05/2034                     |                                     | 1 041                            | 1 191                     | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine   |                                     |                                  |                           |      |
| 3,512 % éch. 15/07/2037                           | 9 900                               | 11 319                           | 0,41                      | 3,754 % éch. 15/10/2034                     |                                     | 5 000                            | 5 716                     | 10,500 % éch. 15/03/2037                                              | DOP                                 | 30 300                           | 543                       | 0,02 |
| Barings Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | 4,133 % éch. 15/05/2034                     |                                     | 1 650                            | 1 895                     | 10,750 % éch. 01/06/2036                                              |                                     | 8 000                            | 146                       | 0,01 |
| 3,444 % éch. 21/10/2038                           | 6 900                               | 7 901                            | 0,29                      | Providus CLO DAC                            |                                     |                                  |                           | Eagle Funding Luxco SARL                                              |                                     |                                  |                           |      |
| BCRED PC Static LLC                               |                                     |                                  |                           | 3,415 % éch. 20/11/2038                     |                                     | 8 100                            | 9 265                     | 5,500 % éch. 17/08/2030                                               | \$                                  | 8 800                            | 8 847                     | 0,32 |
| 4,974 % éch. 27/04/2036                           | \$                                  | 9 700                            | 9 700                     | RIN LLC                                     |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement égyptien                    |                                     |                                  |                           |      |
| Black Diamond CLO DAC                             |                                     |                                  |                           | 5,194 % éch. 20/07/2037 (b)                 | \$                                  | 1 500                            | 1 500                     | 19,698 % éch. 14/10/2030                                              | EGP                                 | 223 500                          | 4 331                     | 0,16 |
| 3,263 % éch. 15/05/2032                           | €                                   | 937                              | 1 071                     | 5,344 % éch. 20/07/2037 (b)                 |                                     | 2 000                            | 2 000                     | 21,954 % éch. 04/03/2028                                              |                                     | 200 400                          | 3 954                     | 0,14 |
| 4,133 % éch. 15/05/2032                           | 5 000                               | 5 736                            | 0,21                      | 5,594 % éch. 20/07/2037 (b)                 |                                     | 2 000                            | 1 997                     | Obligation internationale du gouvernement de l'Emirat d'Abou Dabi     |                                     |                                  |                           |      |
| BlueMountain Fuji Euro CLO DAC                    |                                     |                                  |                           | SLM Student Loan Trust                      |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 20/04/2033                                               | \$                                  | 3 500                            | 3 489                     | 0,13 |
| 3,114 % éch. 15/01/2033                           | 478                                 | 548                              | 0,02                      | 4,542 % éch. 25/01/2075                     |                                     | 2 054                            | 2 052                     | 4,875 % éch. 30/04/2029                                               |                                     | 1 500                            | 1 511                     | 0,06 |
| BNPP AM Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           | Taco Bell Funding LLC                       |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/04/2034                                               |                                     | 1 500                            | 1 526                     | 0,06 |
| 2,804 % éch. 15/04/2031                           | 185                                 | 211                              | 0,01                      | 1,946 % éch. 25/08/2051                     | 8 351                               | 8 205                            | 0,30                      | Obligation internationale du gouvernement israélien                   |                                     |                                  |                           |      |
| 2,854 % éch. 15/10/2031                           | 135                                 | 155                              | 0,01                      | Titkehou U.S. CLO Ltd.                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 30/10/2026                                               | €                                   | 2 000                            | 2 302                     | 0,08 |
| Boyce Park CLO Ltd.                               |                                     |                                  |                           | 4,767 % éch. 18/01/2035                     | 9 800                               | 9 805                            | 0,36                      | 5,375 % éch. 19/02/2030                                               | \$                                  | 2 100                            | 2 130                     | 0,08 |
| 4,672 % éch. 21/04/2035                           | \$                                  | 9 300                            | 9 306                     | Toro European CLO DAC                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais                    |                                     |                                  |                           |      |
| Cairn CLO DAC                                     |                                     |                                  |                           | 3,070 % éch. 12/01/2032                     | €                                   | 879                              | 1 006                     | 1,800 % éch. 20/03/2054                                               | ¥                                   | 79 000                           | 312                       | 0,01 |
| 2,820 % éch. 31/01/2030                           | €                                   | 223                              | 255                       | 3,093 % éch. 15/02/2034                     |                                     | 3 855                            | 4 411                     | 2,100 % éch. 20/09/2054                                               |                                     | 287 000                          | 1 218                     | 0,04 |
| 3,434 % éch. 15/01/2040                           | 7 100                               | 8 124                            | 0,29                      |                                             |                                     |                                  |                           | 2,200 % éch. 20/06/2054                                               |                                     | 35 000                           | 152                       | 0,01 |
| Capital Four U.S. CLO Ltd.                        |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 20/12/2054                                               |                                     | 268 100                          | 1 194                     | 0,04 |
| 4,879 % éch. 15/07/2037 (b)                       | \$                                  | 9 800                            | 9 800                     |                                             |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2045                                               |                                     | 169 000                          | 877                       | 0,03 |
| Carlyle Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2055                                               |                                     | 326 100                          | 1 487                     | 0,05 |
| 2,200 % éch. 15/08/2032                           | €                                   | 1 000                            | 1 116                     |                                             |                                     |                                  |                           | 2,700 % éch. 20/09/2045                                               |                                     | 231 950                          | 1 254                     | 0,05 |
| 3,173 % éch. 15/08/2032                           | 274                                 | 313                              | 0,01                      |                                             |                                     |                                  |                           | 3,200 % éch. 20/09/2055                                               |                                     | 1 750 550                        | 9 457                     | 0,34 |
| 3,493 % éch. 15/08/2038                           | 900                                 | 1 031                            | 0,04                      |                                             |                                     |                                  |                           | 3,400 % éch. 20/12/2055                                               |                                     | 658 650                          | 3 699                     | 0,13 |
| Castlelake Aircraft Structured Trust              |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 20/03/2056                                               |                                     | 170 000                          | 1 011                     | 0,04 |
| 4,125 % éch. 15/06/2043                           | \$                                  | 155                              | 153                       |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement du Koweït                   |                                     |                                  |                           |      |
| 5,783 % éch. 15/02/2050                           | 3 541                               | 3 556                            | 0,13                      |                                             |                                     |                                  |                           | 4,016 % éch. 09/10/2028                                               | \$                                  | 1 900                            | 1 876                     | 0,07 |
| CQS U.S. CLO Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 4,804 % éch. 20/04/2033 (i)                                           |                                     | 4 300                            | 4 293                     | 0,16 |
| 5,101 % éch. 17/01/2039                           | 10 200                              | 10 214                           | 0,37                      |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain                    |                                     |                                  |                           |      |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC            |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 03/12/2026 (g)                                           | MXN                                 | 88                               | 5                         | 0,00 |
| 3,823 % éch. 15/08/2033                           | €                                   | 6 000                            | 6 875                     |                                             |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 24/08/2034 (g)                                           |                                     | 176                              | 10                        | 0,00 |
| Dryden Euro CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 04/05/2033                                               | €                                   | 700                              | 817                       | 0,03 |
| 2,864 % éch. 15/04/2033                           | 1 543                               | 1 765                            | 0,06                      |                                             |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 27/08/2037                                               | \$                                  | 1 500                            | 1 502                     | 0,05 |
| 3,143 % éch. 15/05/2034                           | 1 639                               | 1 874                            | 0,07                      |                                             |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 26/05/2033                                               | MXN                                 | 4 500                            | 241                       | 0,01 |
| Euro-Galaxy CLO DAC                               |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 29/05/2031                                               |                                     | 1 100                            | 61                        | 0,00 |
| 2,781 % éch. 24/04/2034                           | 2 086                               | 2 384                            | 0,09                      |                                             |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 01/03/2029                                               |                                     | 6 800                            | 395                       | 0,01 |
| Fair Oaks Loan Funding DAC                        |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 31/05/2029                                               |                                     | 11 100                           | 644                       | 0,02 |
| 3,204 % éch. 15/10/2034                           | 7 800                               | 8 931                            | 0,32                      |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien                    |                                     |                                  |                           |      |
| Flexicommercial ABS Trust                         |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 12/08/2034                                               | PEN                                 | 7 722                            | 2 214                     | 0,08 |
| 5,550 % éch. 14/06/2031                           | AUD                                 | 8 889                            | 6 174                     |                                             |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 12/08/2032                                               |                                     | 13 789                           | 4 380                     | 0,16 |
| Fondo de Titulización Santander Consumo           |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 6,850 % éch. 12/08/2035                                               |                                     | 25 432                           | 7 850                     | 0,29 |
| 2,865 % éch. 25/10/2040                           | €                                   | 7 600                            | 8 704                     |                                             |                                     |                                  |                           | 6,900 % éch. 12/08/2037                                               |                                     | 3 382                            | 1 016                     | 0,04 |
| FTA Santander Consumo                             |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 12/08/2031                                               |                                     | 7 762                            | 2 590                     | 0,09 |
| 3,236 % éch. 21/03/2036                           | 576                                 | 659                              | 0,02                      |                                             |                                     |                                  |                           | 7,300 % éch. 12/08/2033                                               |                                     | 13 728                           | 4 510                     | 0,16 |
| GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A. |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 7,600 % éch. 12/08/2039                                               |                                     | 5 230                            | 1 648                     | 0,06 |
| 2,918 % éch. 25/10/2035                           | 10 343                              | 11 836                           | 0,43                      |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement qatari                      |                                     |                                  |                           |      |
| 3,095 % éch. 25/02/2034                           | 9 904                               | 11 367                           | 0,41                      |                                             |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 08/04/2033                                               | \$                                  | 3 000                            | 3 016                     | 0,11 |
| Golden Bar Securitisation SRL                     |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | République d'Allemagne                                                |                                     |                                  |                           |      |
| 3,216 % éch. 22/09/2043                           | 9 586                               | 11 007                           | 0,40                      |                                             |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 15/02/2033                                               | €                                   | 5 600                            | 6 251                     | 0,23 |
| Harvest CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique |                                     |                                  |                           |      |
| 3,054 % éch. 15/01/2032                           | 9 081                               | 10 387                           | 0,38                      |                                             |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 30/01/2028                                               |                                     | 58                               | 67                        | 0,00 |
| 3,523 % éch. 25/07/2037 (b)                       | 8 800                               | 10 061                           | 0,36                      |                                             |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 30/01/2033                                               |                                     | 61                               | 73                        | 0,00 |
| 4,063 % éch. 25/07/2037 (b)                       | 4 400                               | 5 030                            | 0,18                      |                                             |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 30/01/2037                                               |                                     | 36                               | 43                        | 0,00 |
| Invesco Euro CLO DAC                              |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 30/01/2042                                               |                                     | 11                               | 13                        | 0,00 |
| 3,134 % éch. 15/04/2033                           | 3 339                               | 3 822                            | 0,14                      |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain                     |                                     |                                  |                           |      |
| 3,260 % éch. 30/10/2038                           | 1 000                               | 1 145                            | 0,04                      |                                             |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 24/09/2031                                               |                                     | 1 200                            | 1 403                     | 0,05 |
| 3,454 % éch. 22/10/2036                           | 7 000                               | 8 012                            | 0,29                      |                                             |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 30/05/2032                                               |                                     | 2 600                            | 3 035                     | 0,11 |
| Lyra Music Assets Delaware LP                     |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 22/03/2031                                               |                                     | 2 800                            | 3 319                     | 0,12 |
| 5,760 % éch. 22/12/2064                           | \$                                  | 647                              | 652                       |                                             |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 07/06/2033                                               |                                     | 2 100                            | 2 426                     | 0,09 |
| Madison Park Euro Funding DAC                     |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 18/09/2033                                               |                                     | 1 800                            | 2 195                     | 0,08 |
| 3,004 % éch. 15/07/2032                           | €                                   | 3 156                            | 3 612                     |                                             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain                |                                     |                                  |                           |      |
| Marble Point CLO Ltd.                             |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/03/2036                                               | ZAR                                 | 11 800                           | 617                       | 0,02 |
| 4,667 % éch. 16/11/2034                           | \$                                  | 9 800                            | 9 811                     |                                             |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 28/02/2031                                               |                                     | 67 000                           | 3 949                     | 0,14 |
| Marzio Finance SRL                                |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 31/01/2030                                               |                                     | 3 500                            | 215                       | 0,01 |
| 2,751 % éch. 28/09/2049                           | €                                   | 622                              | 713                       |                                             |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 31/01/2037                                               |                                     | 30 500                           | 1 854                     | 0,07 |
|                                                   |                                     |                                  |                           |                                             |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 28/02/2035                                               |                                     | 171 230                          | 10 827                    | 0,39 |

| DESCRIPTION                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE EN % DE<br>VALEUR L'ACTIF<br>(en milliers) NET | DESCRIPTION                             | ACTIONS   | JUSTE EN % DE<br>VALEUR L'ACTIF<br>(en milliers) NET | DESCRIPTION                                  | ACTIONS    | JUSTE EN % DE<br>VALEUR L'ACTIF<br>(en milliers) NET |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------------------------------|-----------|------------------------------------------------------|----------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------|
| 9,000 % éch. 31/01/2040                               | ZAR 53 750                          | \$ 3 317 0,12                                        | Subaru Corp. (d)                        | 65 700    | \$ 962 0,04                                          | <b>SERVICES FINANCIERS</b>                   |            |                                                      |
| 9,875 % éch. 31/03/2039                               | 10 500                              | 693 0,03                                             | Suzuki Motor Corp. (d)                  | 159 700   | 1 932 0,07                                           | Absa Group Ltd.                              | 107 075    | \$ 1 491 0,05                                        |
| Obligation internationale du gouvernement turc        |                                     |                                                      | Technronic Industries Co. Ltd.          | 116 000   | 1 931 0,07                                           | AIB Group PLC                                | 269 272    | 3 167 0,12                                           |
| 7,625 % éch. 26/04/2029                               | \$ 6 200                            | 6 482 0,24                                           | TJX Cos., Inc. (d)                      | 18 481    | 2 800 0,10                                           | Ameriprise Financial, Inc.                   | 11 553     | 5 300 0,19                                           |
| 40,305 % éch. 06/09/2028                              | TRY 1 200                           | 26 0,00                                              |                                         |           |                                                      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.         | 156 268    | 3 937 0,14                                           |
| 40,760 % éch. 19/08/2026                              | 100                                 | 2 0,00                                               |                                         |           |                                                      | Banco BPM SpA                                | 143 206    | 2 478 0,09                                           |
| 40,760 % éch. 17/05/2028                              | 25 200                              | 545 0,02                                             |                                         |           |                                                      | Banco de Chile                               | 5 815 680  | 1 138 0,04                                           |
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien |                                     |                                                      | <b>BIENS DE CONSOMMATION COURANTE</b>   |           |                                                      | Banco de Sabadell S.A.                       | 607 766    | 2 155 0,08                                           |
| 6,000 % éch. 09/12/2020 ^                             | \$ 289                              | 124 0,00                                             | Altria Group, Inc.                      | 212 903   | 15 318 0,56                                          | Bank Central Asia Tbk PT                     | 6 275 500  | 1 955 0,07                                           |
| 7,000 % éch. 31/03/2038 ^                             | 107                                 | 47 0,00                                              | Ambev S.A.                              | 551 300   | 1 735 0,06                                           | Bank Hapoalim B.M.                           | 167 050    | 3 848 0,14                                           |
| 7,650 % éch. 21/04/2025 ^                             | 266                                 | 120 0,00                                             | Archer-Daniels-Midland Co.              | 61 387    | 4 690 0,17                                           | Bank Leumi Le-Israel B.M.                    | 175 666    | 3 926 0,14                                           |
| 8,250 % éch. 13/10/2024 ^                             | 269                                 | 122 0,00                                             | Carrefour S.A.                          | 74 192    | 1 378 0,05                                           | Bank Mandiri Persero Tbk PT                  | 4 464 500  | 963 0,04                                             |
| 9,000 % éch. 07/05/2023 ^                             | 144                                 | 68 0,00                                              | Colgate-Palmolive Co. (d)               | 30 540    | 2 800 0,10                                           | Bank of New York Mellon Corp.                | 19 077     | 2 759 0,10                                           |
| 9,250 % éch. 15/09/2027 ^                             | 801                                 | 395 0,01                                             | Dollar General Corp. (d)                | 28 054    | 3 229 0,12                                           | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT         | 7 715 300  | 1 181 0,04                                           |
| 9,250 % éch. 07/05/2028 ^                             | 656                                 | 316 0,01                                             | Imperial Brands PLC (d)                 | 93 173    | 3 446 0,12                                           | Cairo Mezz PLC (d)                           | 59 349     | 16 0,00                                              |
| 11,750 % éch. 21/10/2026 ^                            | 40                                  | 22 0,00                                              | ITC Ltd.                                | 374 036   | 1 135 0,04                                           | China Construction Bank Corp. « H » (d)      | 10 719 000 | 11 057 0,40                                          |
| 11,950 % éch. 05/08/2031 ^                            | 500                                 | 272 0,01                                             | Kimberly-Clark Corp.                    | 41 806    | 4 589 0,17                                           | China Merchants Bank Co. Ltd. « H » (d)      | 195 500    | 1 123 0,04                                           |
| 12,750 % éch. 23/08/2022 ^                            | 180                                 | 101 0,00                                             | Koninklijke Ahold Delhaize NV           | 112 306   | 4 522 0,16                                           | China Pacific Insurance Group Co. Ltd. « H » | 309 400    | 1 064 0,04                                           |
|                                                       |                                     | <b>197 222 7,15</b>                                  | Philip Morris International, Inc.       | 65 172    | 11 790 0,43                                          | Credicorp Ltd.                               | 8 636      | 3 364 0,12                                           |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>                             | <b>ACTIONS</b>                      |                                                      | Procter & Gamble Co.                    | 60 605    | 8 887 0,32                                           | FirstRand Ltd.                               | 636 222    | 3 779 0,14                                           |
| <b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>                      |                                     |                                                      | Target Corp. (d)                        | 57 688    | 7 535 0,27                                           | Intesa Sanpaolo SpA                          | 1 364 852  | 9 387 0,34                                           |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)              | 320 208                             | 775 0,03                                             | Wal-Mart de Mexico S.A.B. de C.V. (d)   | 661 000   | 1 943 0,07                                           | Israel Discount Bank Ltd. « A »              | 156 012    | 1 543 0,06                                           |
| Comcast Corp. « A » (d)                               | 455 085                             | 11 172 0,40                                          | WH Group Ltd.                           | 980 500   | 1 040 0,04                                           | Mizrahi Tefahot Bank Ltd.                    | 11 381     | 753 0,03                                             |
| iHeartMedia, Inc. « A » (d)                           | 66 288                              | 284 0,01                                             |                                         |           |                                                      | NatWest Group PLC                            | 322 893    | 2 851 0,10                                           |
| iHeartMedia, Inc. « B » (d)                           | 58 371                              | 215 0,01                                             | <b>ÉNERGIE</b>                          |           |                                                      | Nedbank Group Ltd.                           | 58 410     | 962 0,04                                             |
| NetEase, Inc.                                         | 183 600                             | 4 716 0,17                                           | Aker BP ASA                             | 39 777    | 1 214 0,04                                           | Northern Trust Corp.                         | 22 394     | 3 893 0,14                                           |
| SES S.A. (d)                                          | 54 916                              | 831 0,03                                             | Antero Midstream Corp.                  | 22 409    | 510 0,02                                             | Partners Group Holding AG                    | 2 720      | 2 232 0,08                                           |
| Telkom Indonesia Persero Tbk PT                       | 6 271 200                           | 833 0,03                                             | Cheniere Energy, Inc.                   | 7 485     | 1 789 0,07                                           | Poste Italiane SpA                           | 38 464     | 1 260 0,05                                           |
| Uniti Group, Inc. (d)                                 | 1 068                               | 12 0,00                                              | China Shenhua Energy Co. Ltd. « H » (d) | 425 500   | 2 180 0,08                                           | Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A. (d)       | 69 090     | 1 208 0,04                                           |
| Verizon Communications, Inc. (d)                      | 385 934                             | 16 341 0,59                                          | Coal India Ltd. (d)                     | 197 903   | 919 0,03                                             | Progressive Corp. (d)                        | 26 005     | 5 681 0,21                                           |
|                                                       |                                     | <b>35 179 1,27</b>                                   | ConocoPhillips Co.                      | 42 818    | 4 451 0,16                                           | QBE Insurance Group Ltd.                     | 62 249     | 1 084 0,04                                           |
| <b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>          |                                     |                                                      | DTE Midstream LLC (d)                   | 16 907    | 2 481 0,09                                           | SpareBank Sor-Norge ASA                      | 1 345      | 26 0,00                                              |
| Aisin Corp. (d)                                       | 64 800                              | 880 0,03                                             | Enbridge, Inc.                          | 48 726    | 2 641 0,10                                           | Standard Bank Group Ltd.                     | 154 626    | 3 051 0,11                                           |
| Best Buy Co., Inc.                                    | 25 077                              | 1 903 0,07                                           | EOG Resources, Inc. (d)                 | 68 238    | 8 853 0,32                                           | State Street Corp. (d)                       | 33 115     | 5 616 0,20                                           |
| Bridgestone Corp. (d)                                 | 135 900                             | 2 867 0,10                                           | Equinor ASA (d)                         | 89 529    | 2 824 0,10                                           | Swiss Re AG                                  | 37 641     | 5 993 0,22                                           |
| Canadian Tire Corp. Ltd. « A » (d)                    | 6 504                               | 896 0,03                                             | Excelerate Energy, Inc. « A »           | 8 500     | 323 0,01                                             | Synchrony Financial                          | 43 377     | 3 299 0,12                                           |
| Cie Générale des Établissements Michelin S.C.A.       | 78 807                              | 3 046 0,11                                           | Expand Energy Corp.                     | 30 624    | 2 793 0,10                                           | T. Rowe Price Group, Inc.                    | 27 493     | 3 126 0,11                                           |
| Continental AG                                        | 13 862                              | 1 148 0,04                                           | Halliburton Co.                         | 72 773    | 2 471 0,09                                           | XBP Global Holdings, Inc. (d)                | 441        | 1 0,00                                               |
| Denso Corp. (d)                                       | 213 200                             | 2 456 0,09                                           | Hess Midstream LP « A »                 | 31 863    | 1 198 0,04                                           |                                              |            | <b>106 667 3,87</b>                                  |
| Expedia Group, Inc.                                   | 11 358                              | 2 906 0,11                                           | Kinder Morgan, Inc.                     | 88 820    | 2 840 0,10                                           |                                              |            |                                                      |
| Garmin Ltd. (d)                                       | 7 707                               | 1 831 0,07                                           | Kinetik Holdings, Inc.                  | 22 697    | 1 097 0,04                                           | <b>SOINS DE SANTÉ</b>                        |            |                                                      |
| Geely Automobile Holdings Ltd.                        | 805 000                             | 1 731 0,06                                           | Oil & Natural Gas Corp. Ltd. (d)        | 349 269   | 866 0,03                                             | AbbVie, Inc. (d)                             | 97 731     | 24 593 0,89                                          |
| Haier Smart Home Co. Ltd. « H » (d)                   | 318 400                             | 814 0,03                                             | OMV AG                                  | 17 722    | 1 114 0,04                                           | Amgen, Inc.                                  | 61 174     | 22 152 0,80                                          |
| Hennes & Mauritz AB « B » (d)                         | 58 807                              | 1 013 0,04                                           | ONEOK, Inc.                             | 30 286    | 2 633 0,10                                           | Amsurg Escrow (d)                            | 52 753     | 49 0,00                                              |
| Industria de Diseno Textil S.A. (d)                   | 84 716                              | 5 343 0,19                                           | Origin Energy Ltd.                      | 204 387   | 1 555 0,06                                           | Astellas Pharma, Inc. (d)                    | 219 000    | 2 931 0,11                                           |
| Isuzu Motors Ltd. (d)                                 | 70 300                              | 936 0,03                                             | ORLEN S.A.                              | 73 155    | 2 462 0,09                                           | Bristol-Myers Squibb Co. (d)                 | 260 090    | 14 986 0,54                                          |
| Kia Corp.                                             | 18 402                              | 1 662 0,06                                           | Pembina Pipeline Corp.                  | 30 899    | 1 429 0,05                                           | CSPC Pharmaceutical Group Ltd.               | 958 000    | 856 0,03                                             |
| Kingfisher PLC                                        | 220 118                             | 827 0,03                                             | PetroChina Co. Ltd. « H »               | 1 286 000 | 1 388 0,05                                           | Eisai Co. Ltd. (d)                           | 33 100     | 835 0,03                                             |
| Magna International, Inc.                             | 32 768                              | 2 154 0,08                                           | Petroleo Brasileiro S.A.                | 468 200   | 3 779 0,14                                           | Gilead Sciences, Inc.                        | 57 588     | 7 276 0,27                                           |
| Ross Stores, Inc.                                     | 8 660                               | 1 843 0,07                                           | Plains GP Holdings LP « A »             | 78 868    | 1 914 0,07                                           | Johnson & Johnson                            | 42 641     | 10 830 0,39                                          |
|                                                       |                                     |                                                      | PRIO S.A. (d)                           | 86 000    | 867 0,03                                             | Merck & Co., Inc.                            | 73 468     | 9 441 0,34                                           |
|                                                       |                                     |                                                      | Repsol S.A. (d)                         | 137 264   | 3 432 0,13                                           | Novartis AG                                  | 75 649     | 11 843 0,43                                          |
|                                                       |                                     |                                                      | South Bow Corp.                         | 7 446     | 262 0,01                                             | Novo Nordisk A/S « B »                       | 53 651     | 2 578 0,09                                           |
|                                                       |                                     |                                                      | Suncor Energy, Inc.                     | 81 264    | 4 370 0,16                                           | Pfizer, Inc. (d)                             | 288 366    | 6 944 0,25                                           |
|                                                       |                                     |                                                      | Sunoco Corp LLC                         | 17 488    | 1 183 0,04                                           | Regeneron Pharmaceuticals, Inc.              | 2 364      | 1 474 0,05                                           |
|                                                       |                                     |                                                      | Targa Resources Corp.                   | 5 195     | 1 393 0,05                                           | Roche Holding AG                             | 36 442     | 15 006 0,55                                          |
|                                                       |                                     |                                                      | TC Energy Corp.                         | 39 963    | 2 646 0,10                                           |                                              |            |                                                      |
|                                                       |                                     |                                                      | Tenaris S.A.                            | 40 955    | 1 134 0,04                                           |                                              |            |                                                      |
|                                                       |                                     |                                                      | Vedanta Oil and Gas Ltd. (d)            | 179 327   | 61 0,00                                              |                                              |            |                                                      |
|                                                       |                                     |                                                      | Williams Cos., Inc.                     | 41 847    | 3 111 0,11                                           |                                              |            |                                                      |
|                                                       |                                     |                                                      | Woodside Energy Group Ltd.              | 239 584   | 4 636 0,17                                           |                                              |            |                                                      |
|                                                       |                                     |                                                      |                                         |           | <b>78 819 2,86</b>                                   |                                              |            |                                                      |



| DESCRIPTION                                        | ACTIONS   | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | ACTIONS | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | ACTIONS                          | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|----------------------------------------------------|-----------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|---------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------------|------|
| Sanofi S.A.                                        | 138 312   | \$ 11 833                     | 0,43                      | Endeavour Mining PLC                         | 27 171  | \$ 1 332                      | 0,05                      | Gaming and Leisure Properties, Inc. | 209 160                          | \$ 9 314                      | 0,34                      |      |
|                                                    |           | 143 627                       | 5,20                      | Evraz PLC (d)                                | 72 869  | 0                             | 0,00                      | Healthpeak Properties, Inc.         | 669 256                          | 14 322                        | 0,52                      |      |
| INDUSTRIE                                          |           |                               |                           | Fortescue Ltd.                               | 205 778 | 2 741                         | 0,10                      | Highwoods Properties, Inc.          | 148 552                          | 4 480                         | 0,16                      |      |
| Astra International Tbk PT                         | 2 562 800 | 648                           | 0,02                      | Gold Fields Ltd.                             | 112 792 | 3 784                         | 0,14                      | Host Hotels & Resorts, Inc.         | 100 806                          | 2 390                         | 0,09                      |      |
| BAE Systems PLC                                    | 28 404    | 697                           | 0,03                      | Grupo Mexico S.A.B. de C.V. « B »            | 89 500  | 1 015                         | 0,04                      | Klepierre S.A.                      | 25 645                           | 1 073                         | 0,04                      |      |
| Bouygues S.A.                                      | 24 256    | 1 355                         | 0,05                      | Harmony Gold Mining Co. Ltd.                 | 72 988  | 1 116                         | 0,04                      | Link REIT                           | 317 600                          | 1 482                         | 0,05                      |      |
| Brambles Ltd.                                      | 171 876   | 2 322                         | 0,08                      | Kinross Gold Corp.                           | 76 238  | 1 804                         | 0,06                      | NNN REIT, Inc.                      | 54 870                           | 2 553                         | 0,09                      |      |
| Broadridge Financial Solutions, Inc.               | 6 400     | 876                           | 0,03                      | Northam Platinum Holdings Ltd.               | 53 528  | 773                           | 0,03                      | Omega Healthcare Investors, Inc.    | 220 476                          | 10 512                        | 0,38                      |      |
| Bureau Veritas S.A.                                | 40 384    | 1 238                         | 0,04                      | Nutrien Ltd.                                 | 60 880  | 3 834                         | 0,14                      | Sabra Health Care REIT, Inc.        | 673 130                          | 13 133                        | 0,48                      |      |
| Cummins, Inc.                                      | 12 699    | 9 057                         | 0,33                      | Sibanye Stillwater Ltd.                      | 354 103 | 752                           | 0,03                      | Ventas, Inc.                        | 10 004                           | 888                           | 0,03                      |      |
| Deutsche Post AG                                   | 72 638    | 4 419                         | 0,16                      | Vedanta Aluminium Metal Ltd. (d)             | 179 327 | 849                           | 0,03                      | VICI Properties, Inc.               | 465 871                          | 12 369                        | 0,45                      |      |
| GEA Group AG                                       | 17 567    | 1 207                         | 0,04                      | Vedanta Iron and Steel Ltd. (d)              | 179 327 | 67                            | 0,00                      | Welltower, Inc.                     | 3 943                            | 895                           | 0,03                      |      |
| General Dynamics Corp. (d)                         | 26 230    | 9 292                         | 0,34                      | Yara International ASA                       | 19 701  | 867                           | 0,03                      |                                     |                                  | 95 689                        | 3,47                      |      |
| Kone Oyj « B »                                     | 41 729    | 2 375                         | 0,09                      |                                              |         | 25 305                        | 0,92                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
| Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd. | 5 191     | 1 185                         | 0,04                      | IMMOBILIER                                   |         |                               |                           |                                     | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                               |                           |      |
| Makita Corp. (d)                                   | 26 600    | 957                           | 0,03                      | CK Asset Holdings Ltd.                       | 223 000 | 1 260                         | 0,05                      | INSTRUMENTS A COURT TERME           |                                  |                               |                           |      |
| Metso Oyj (d)                                      | 80 053    | 1 393                         | 0,05                      |                                              |         |                               |                           | BONS DU TRÉSOR ÉGYPTIEN             |                                  |                               |                           |      |
| Nippon Yusen KK (d)                                | 49 500    | 1 602                         | 0,06                      | Axia Energia S.A.                            | 129 000 | 1 355                         | 0,05                      | 23,650 % éch. 13/10/2026 (e)(f)     | EGP                              | 10 375                        | 198                       | 0,01 |
| Obayashi Corp. (d)                                 | 76 800    | 1 553                         | 0,06                      | CLP Holdings Ltd.                            | 207 000 | 1 935                         | 0,07                      | 24,000 % éch. 13/10/2026 (e)(f)     |                                  | 14 200                        | 271                       | 0,01 |
| Otis Worldwide Corp.                               | 17 828    | 1 276                         | 0,05                      | Consolidated Edison, Inc.                    | 19 345  | 2 140                         | 0,08                      | 24,060 % éch. 20/10/2026 (e)(f)     |                                  | 3 650                         | 69                        | 0,00 |
| PACCAR, Inc.                                       | 28 031    | 3 367                         | 0,12                      | Edison International (d)                     | 48 474  | 3 609                         | 0,13                      |                                     |                                  | 538                           | 0,02                      |      |
| Schindler Holding AG                               | 5 096     | 1 692                         | 0,06                      | EDP S.A.                                     | 288 214 | 1 507                         | 0,06                      | BONS DU TRÉSOR NIGÉRIEN             |                                  |                               |                           |      |
| SKF AB « B » (d)                                   | 42 289    | 1 088                         | 0,04                      | Endesa S.A. (d)                              | 38 712  | 1 760                         | 0,06                      | 21,097 % éch. 07/07/2026 (e)(f)     | NGN                              | 137 900                       | 100                       | 0,00 |
| SMC Corp. (d)                                      | 4 400     | 1 968                         | 0,07                      | Enel SpA (d)                                 | 971 027 | 11 145                        | 0,40                      | 21,137 % éch. 06/10/2026 (e)(f)     |                                  | 72 103                        | 50                        | 0,00 |
| Snap-on, Inc.                                      | 4 577     | 1 842                         | 0,07                      | National Grid PLC                            | 87 984  | 1 452                         | 0,05                      | 21,241 % éch. 14/07/2026 (e)(f)     |                                  | 180 259                       | 130                       | 0,01 |
| Taisei Corp. (d)                                   | 18 200    | 1 612                         | 0,06                      | Naturgy Energy Group S.A.                    | 52 478  | 1 646                         | 0,06                      | 21,322 % éch. 28/07/2026 (e)(f)     |                                  | 86 524                        | 62                        | 0,00 |
| United Parcel Service, Inc. « B »                  | 42 756    | 4 596                         | 0,17                      | Snam SpA                                     | 254 118 | 1 836                         | 0,07                      | 21,450 % éch. 07/07/2026 (e)(f)     |                                  | 172 300                       | 125                       | 0,01 |
| Vinci S.A.                                         | 59 319    | 8 669                         | 0,31                      | Tenaga Nasional Bhd.                         | 334 200 | 1 173                         | 0,04                      | 21,480 % éch. 28/07/2026 (e)(f)     |                                  | 108 200                       | 78                        | 0,00 |
| Wartsila Oyj Abp                                   | 35 425    | 1 354                         | 0,05                      | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA           | 156 878 | 1 833                         | 0,07                      | 21,587 % éch. 04/08/2026 (e)(f)     |                                  | 52 500                        | 37                        | 0,00 |
| Weichai Power Co. Ltd. « H » (d)                   | 243 000   | 1 066                         | 0,04                      | Vedanta Power Ltd. (d)                       | 179 327 | 76                            | 0,00                      | 21,625 % éch. 11/08/2026 (e)(f)     |                                  | 314 400                       | 223                       | 0,01 |
| Wolters Kluwer NV                                  | 13 211    | 855                           | 0,03                      |                                              |         | 31 467                        | 1,14                      | 21,638 % éch. 11/08/2026 (e)(f)     |                                  | 206 800                       | 147                       | 0,01 |
| Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.             | 326 900   | 867                           | 0,03                      |                                              |         | 669 853                       | 24,28                     | 21,659 % éch. 25/08/2026 (e)(f)     |                                  | 120 700                       | 85                        | 0,00 |
| ZTO Express Cayman, Inc. (i)                       | 48 500    | 1 073                         | 0,04                      | BONS DE SOUSCRIPTION                         |         |                               |                           | 21,675 % éch. 18/08/2026 (e)(f)     |                                  | 68 900                        | 49                        | 0,00 |
|                                                    |           | 71 501                        | 2,59                      | Windstream Holdings II LLC - Exp. 01/08/2035 | 604     | 7                             | 0,00                      | 21,676 % éch. 11/08/2026 (e)(f)     |                                  | 315 200                       | 224                       | 0,01 |
| TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION                      |           |                               |                           |                                              |         |                               |                           | 21,690 % éch. 07/07/2026 (e)(f)     |                                  | 157 200                       | 114                       | 0,01 |
| Apple, Inc.                                        | 30 565    | 8 844                         | 0,32                      | TITRES PRIVILÉGIÉS                           |         |                               |                           | 21,699 % éch. 25/08/2026 (e)(f)     |                                  | 94 300                        | 67                        | 0,00 |
| Canon, Inc. (d)                                    | 101 900   | 2 611                         | 0,10                      | Nationwide Building Society 10,250 %         | £       | 260                           | 0,00                      | 21,704 % éch. 01/09/2026 (e)(f)     |                                  | 94 300                        | 66                        | 0,00 |
| Cisco Systems, Inc. (d)                            | 7 719     | 907                           | 0,03                      | Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %             | BRL     | 554 100                       | 4 047                     | 0,15                                |                                  |                               | 1 557                     | 0,06 |
| HP, Inc. (d)                                       | 115 408   | 2 532                         | 0,09                      | Samsung Electronics Co. Ltd. 0,000 %         | KRW     | 32 403                        | 4 570                     | 0,16                                | BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAÏN      |                               |                           |      |
| Infosys Ltd.                                       | 162 335   | 1 721                         | 0,06                      | Windstream Holdings LLC 11,000 %             | \$      | 20                            | 0,00                      | 7,046 % éch. 27/01/2027 (e)(f)      | ZAR                              | 15 800                        | 927                       | 0,03 |
| Largan Precision Co. Ltd.                          | 11 000    | 1 490                         | 0,05                      |                                              |         |                               |                           | 7,066 % éch. 28/10/2026 (e)(f)      |                                  | 1 300                         | 78                        | 0,00 |
| Novatek Microelectronics Corp. (d)                 | 68 000    | 1 150                         | 0,04                      |                                              |         |                               |                           | 7,304 % éch. 19/08/2026 (e)(f)      |                                  | 7 400                         | 448                       | 0,02 |
| NVIDIA Corp.                                       | 66 284    | 13 263                        | 0,48                      |                                              |         |                               |                           | 7,305 % éch. 18/11/2026 (e)(f)      |                                  | 12 900                        | 768                       | 0,03 |
| Realtek Semiconductor Corp. (d)                    | 62 000    | 1 582                         | 0,06                      |                                              |         |                               |                           | 7,393 % éch. 22/07/2026 (e)(f)      |                                  | 15 000                        | 912                       | 0,03 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. (d)    | 17 000    | 1 341                         | 0,05                      | SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER         |         |                               |                           | 7,400 % éch. 05/08/2026 (e)(f)      |                                  | 2 100                         | 127                       | 0,01 |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson « B » (d)          | 336 437   | 3 780                         | 0,14                      | American Healthcare REIT, Inc.               | 17 342  | 904                           | 0,03                      | 7,400 % éch. 07/10/2026 (e)(f)      |                                  | 500                           | 30                        | 0,00 |
| Texas Instruments, Inc.                            | 16 924    | 5 045                         | 0,18                      | Annaly Capital Management, Inc.              | 91 513  | 2 046                         | 0,08                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
| Tokyo Electron Ltd. (d)                            | 16 800    | 8 149                         | 0,30                      | Apple Hospitality REIT, Inc.                 | 210 177 | 3 533                         | 0,13                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
| United Microelectronics Corp. (d)                  | 1 428 000 | 7 659                         | 0,28                      | Broadstone Net Lease, Inc.                   | 480 245 | 9 927                         | 0,36                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
| Unity Bancorp, Inc. (d)                            | 3 100     | 36                            | 0,00                      | CapitalLand Ascendas REIT                    | 434 200 | 837                           | 0,03                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
|                                                    |           | 60 110                        | 2,18                      | CareTrust REIT, Inc.                         | 21 556  | 870                           | 0,03                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
| MATÉRIAUX                                          |           |                               |                           | EPR Properties                               | 71 730  | 4 161                         | 0,15                      |                                     |                                  |                               |                           |      |
| Anglogold Ashanti PLC                              | 40 276    | 3 244                         | 0,12                      |                                              |         |                               |                           |                                     |                                  |                               |                           |      |
| CF Industries Holdings, Inc.                       | 19 091    | 2 067                         | 0,07                      |                                              |         |                               |                           |                                     |                                  |                               |                           |      |
| China Hongqiao Group Ltd.                          | 411 000   | 1 060                         | 0,04                      |                                              |         |                               |                           |                                     |                                  |                               |                           |      |

## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|---------|----------------------------------|---------------------------|
| 7,401 % éch. 05/08/2026 (e)(f)      | ZAR 8 400                           | \$ 509                           | 0,02                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>            |         |                                  |                           |
| 7,420 % éch. 04/11/2026 (e)(f)      | 200                                 | 12                               | 0,00                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |         |                                  |                           |
|                                     |                                     | 3 811                            | 0,14                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |         |                                  |                           |
| Total des Instruments à court terme |                                     | 5 906                            | 0,22                      | <b>PIMCO Select Funds plc -</b>          |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>Fonds PIMCO US Dollar</b>             |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>Short-Term Floating</b>               |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>NAV Fund (h)</b>                      |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | 19 582 221                               | \$      | 195 280                          | 7,08                      |
| Total des Valeurs mobilières        |                                     | \$ 3 492 811                     | 126,58                    | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>          |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>PIMCO ETFs plc - Fonds</b>            |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>PIMCO US Dollar Short</b>             |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>Maturity UCITS ETF (h)</b>            |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           | 44 807                                   |         | 4 502                            | 0,16                      |
|                                     |                                     |                                  |                           | <b>Total des Fonds d'investissement</b>  |         |                                  |                           |
|                                     |                                     |                                  |                           |                                          | \$      | 199 782                          | 7,24                      |

### CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                                 | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                            | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|--------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOS                                          | 3,690 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 29 200               | Billets du Trésor américain 3,375 % éch. 31/12/2027    | \$ (29 802)         | \$ 29 200                                      | \$ 29 203                                                                      | 1,06                   |
| BRC                                          | 3,720           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 82 000                  | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation |                     |                                                |                                                                                |                        |
|                                              |                 |                      |                    |                         | 1,625 % éch. 15/04/2030                                | (83 572)            | 82 000                                         | 82 008                                                                         | 2,96                   |
| FICC                                         | 3,620           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 4 000                   | Billets du Trésor américain 3,750 % éch. 15/05/2028    | (4 080)             | 4 000                                          | 4 000                                                                          | 0,15                   |
| <b>Total des Contrats de mise en pension</b> |                 |                      |                    |                         |                                                        | <b>\$ (117 454)</b> | <b>\$ 115 200</b>                              | <b>\$ 115 211</b>                                                              | <b>4,17</b>            |

<sup>(1)</sup> Comprend les intérêts courus.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2027              | 462                   | \$ (280)                                | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2028              | 124                   | (38)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2026              | 462                   | (54)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                          | Long  | 09/2027              | 124                   | (57)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars                                          | Long  | 06/2027              | 124                   | (69)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                     | Long  | 12/2026              | 462                   | (222)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                     | Long  | 12/2027              | 124                   | (46)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026              | 279                   | 305                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 33                    | (19)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 114                   | (175)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 1 130                 | (167)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 2 048                 | 549                                     | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026              | 615                   | (590)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026              | 231                   | (585)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 1 205                 | 3 441                                   | 0,13                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026              | 725                   | 2 060                                   | 0,07                   |
| <b>Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé</b>             |       |                      |                       | <b>\$ 4 053</b>                         | <b>0,15</b>            |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence   | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| AT&T, Inc.            | 1,000 %                 | 20/06/2028         | \$ 1 700                            | \$ 38                                   | 0,00                   |
| Bank of America Corp. | 1,000                   | 20/12/2026         | 1 200                               | (10)                                    | 0,00                   |
| Crédit Agricole S.A.  | 1,000                   | 20/12/2030         | € 3 900                             | 28                                      | 0,00                   |
|                       |                         |                    |                                     | <b>\$ 56</b>                            | <b>0,00</b>            |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 %                 | 20/12/2026         | \$ 4 508                            | \$ 209                                  | 0,01                   |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2027         | 600                                 | 55                                      | 0,00                   |



| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans             | 1,000 %                 | 20/06/2028         | \$ 100                              | \$ 8                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2028         | 1 500                               | 82                                      | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-41 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2029         | 500                                 | 23                                      | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-42 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2029         | 600                                 | 21                                      | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2030         | 300                                 | 6                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 300                                 | 8                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-37 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2026         | 855                                 | (30)                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-44 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2030         | 490                                 | 4                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/12/2030         | 16 464                              | (29)                                    | 0,00                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2031         | 45 738                              | 984                                     | 0,04                   |
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/12/2030         | 10 330                              | 4                                       | 0,00                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 27 890                              | 106                                     | 0,00                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | € 14 060                            | 101                                     | 0,00                   |
|                                            |                         |                    |                                     | \$ 1 552                                | 0,05                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux<br>variable<br>à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2028         | £ 44 400             | \$ 423                                  | 0,01                   |
| À payer                                    | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2031         | 44 840               | (508)                                   | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,700     | 28/03/2034         | 100                  | 5                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036         | 5 660                | 169                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000     | 15/03/2029         | ¥ 2 430 000          | 14                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,020     | 20/09/2028         | 2 950 000            | (2)                                     | 0,00                   |
| À payer                                    | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,176     | 27/04/2027         | 160 000              | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400     | 15/06/2032         | 248 400              | 20                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500     | 15/03/2042         | 121 000              | 36                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,711     | 27/04/2042         | 37 000               | 11                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 18/06/2035         | 382 000              | 76                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,500     | 16/06/2028         | \$ 26 200            | (447)                                   | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,750     | 16/06/2031         | 13 442               | (820)                                   | (0,03)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 0,750     | 16/06/2031         | 16 200               | 1 109                                   | 0,04                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 15/06/2027         | 16 900               | (209)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 15/06/2029         | 2 770                | (141)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,000     | 16/12/2030         | 1 766                | 224                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,235     | 12/05/2028         | 700                  | 42                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 15/12/2026         | 34 300               | 1 078                                   | 0,04                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 17/06/2027         | 12 000               | (832)                                   | (0,03)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 15/12/2028         | 3 900                | (320)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 17/06/2030         | 47 620               | 3 068                                   | 0,11                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 15/06/2032         | 5 950                | (429)                                   | (0,02)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 16/06/2051         | 4 300                | (1 398)                                 | (0,05)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,350     | 20/01/2027         | 3 400                | 60                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,360     | 20/07/2031         | 800                  | 106                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,370     | 19/07/2031         | 500                  | 66                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,380     | 04/01/2027         | 1 400                | (20)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,405     | 07/09/2031         | 1 300                | 173                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,425     | 18/01/2027         | 1 000                | (14)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,443     | 18/01/2027         | 1 100                | (15)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,450     | 17/02/2027         | 2 400                | 40                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,450     | 16/07/2031         | 1 200                | 157                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,491     | 21/01/2051         | 900                  | (408)                                   | (0,02)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 15/12/2028         | 7 130                | (609)                                   | (0,02)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 12/01/2029         | 578                  | 39                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 05/10/2031         | 600                  | (76)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,535     | 15/10/2031         | 600                  | (75)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,535     | 22/10/2031         | 400                  | (50)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,545     | 26/10/2031         | 400                  | (50)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,550     | 20/01/2027         | 15 100               | (184)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,570     | 11/01/2027         | 800                  | (10)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,580     | 16/02/2027         | 900                  | (12)                                    | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,590     | 09/02/2051         | 7 200                | (3 162)                                 | (0,12)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,625     | 16/01/2050         | 3 100                | 1 349                                   | 0,05                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,625     | 03/02/2050         | 3 900                | 1 700                                   | 0,06                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,700     | 17/02/2027         | 9 600                | (102)                                   | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,700     | 12/01/2029         | 2 100                | (122)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,740     | 16/12/2026         | 1 100                | 19                                      | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2027         | 26 000               | (821)                                   | (0,03)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2029         | 1 209                | 1                                       | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2032         | 1 878                | 57                                      | 0,00                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 15/06/2032         | 1 840                | (129)                                   | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 22/01/2050         | 7 600                | 3 191                                   | 0,11                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,768     | 02/02/2032         | 300                  | (35)                                    | 0,00                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,785     | 12/08/2051         | 700                  | 305                                     | 0,01                   |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,817     | 05/04/2032         | 2 200                | (236)                                   | (0,01)                 |
| À payer                                    | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,872     | 06/04/2032         | 1 100                | (115)                                   | (0,01)                 |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,875     | 07/02/2050         | 400                  | 159                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,895     | 18/10/2049         | 700                  | 293                                     | 0,01                   |
| À recevoir                                 | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,910     | 17/10/2049         | 700                  | 290                                     | 0,01                   |

## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,928 %   | 25/03/2027      | \$ 1 100          | \$ (19)                                 | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 21/12/2027      | 1 250             | (42)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 21/12/2029      | 5 740             | (105)                                   | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 18/02/2032      | 900               | (91)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 21/12/2032      | 9 130             | 28                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 15/01/2050      | 1 400             | 537                                     | 0,02                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 15/12/2051      | 6 500             | (3 029)                                 | (0,11)              |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250     | 11/12/2049      | 7 100             | 2 440                                   | 0,09                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250     | 12/03/2050      | 3 400             | 1 153                                   | 0,04                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,850     | 30/08/2027      | 1 000             | (17)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,955     | 04/10/2027      | 1 000             | (13)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 17/06/2028      | 97 600            | (626)                                   | (0,02)              |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 19/03/2030      | 133 600           | (1 905)                                 | (0,07)              |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2030      | 2 090             | 9                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2033      | 2 800             | 127                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000     | 21/06/2033      | 160               | (6)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050     | 07/09/2027      | 500               | (6)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050     | 08/09/2029      | 500               | (14)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050     | 06/09/2032      | 700               | (32)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080     | 23/02/2053      | 200               | (35)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100     | 09/09/2029      | 500               | (13)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,231     | 18/09/2034      | 200               | 12                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,232     | 10/09/2034      | 100               | 6                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,240     | 16/09/2034      | 100               | 6                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,248     | 18/09/2034      | 200               | 12                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 21/06/2028      | 1 280             | (11)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,278     | 16/09/2034      | 100               | 6                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,280     | 16/09/2034      | 400               | 23                                      | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 06/03/2033      | 300               | (10)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300     | 14/06/2033      | 1 000             | (34)                                    | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,325     | 31/08/2030      | 3 740             | 66                                      | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340     | 23/02/2030      | 600               | (11)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350     | 14/12/2032      | 200               | 8                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370     | 01/03/2033      | 400               | (12)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370     | 12/07/2053      | 200               | (27)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,375     | 15/10/2034      | 200               | (8)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400     | 23/02/2033      | 200               | (6)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405     | 01/03/2033      | 300               | (8)                                     | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,408     | 05/09/2034      | 100               | 5                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,410     | 05/09/2034      | 200               | 9                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425     | 01/03/2033      | 300               | (8)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430     | 27/02/2033      | 300               | (8)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,435     | 05/11/2034      | 400               | (15)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450     | 07/03/2033      | 600               | (15)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450     | 11/10/2034      | 200               | (7)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,455     | 01/11/2034      | 400               | (14)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,465     | 30/10/2034      | 500               | (17)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470     | 22/02/2030      | 600               | (8)                                     | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470     | 04/09/2034      | 100               | 4                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470     | 01/11/2034      | 400               | (14)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,485     | 30/10/2034      | 400               | (13)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,495     | 30/10/2034      | 200               | (7)                                     | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 22/06/2030      | 900               | (10)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2030      | 1 190             | (39)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/03/2031      | 13 220            | 336                                     | 0,01                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 22/05/2033      | 29 660            | 498                                     | 0,02                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 24 950            | (114)                                   | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/06/2033      | 3 760             | 35                                      | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 21/06/2033      | 600               | (13)                                    | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 20/12/2033      | 860               | (3)                                     | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 18/12/2054      | 29 500            | 2 963                                   | 0,11                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500     | 17/09/2055      | 12 500            | 259                                     | 0,01                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,514     | 04/09/2034      | 200               | 8                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525     | 02/03/2030      | 200               | (2)                                     | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525     | 04/09/2034      | 200               | 7                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,527     | 15/11/2049      | 140               | 15                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,532     | 20/08/2034      | 200               | 7                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,535     | 06/11/2034      | 800               | (23)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,550     | 21/08/2034      | 300               | 11                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,551     | 17/09/2035      | 1 100             | 44                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,555     | 28/08/2034      | 200               | 7                                       | 0,00                |
| À payer                              | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,555     | 05/03/2054      | 100               | (10)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,558     | 21/08/2034      | 200               | 7                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,564     | 31/01/2033      | 660               | 14                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,565     | 28/08/2034      | 200               | 7                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,569     | 14/08/2034      | 200               | 7                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,594     | 09/01/2034      | 200               | 5                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,595     | 19/08/2034      | 400               | 13                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,599     | 28/08/2034      | 200               | 6                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 17/01/2034      | 200               | 6                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,600     | 28/08/2034      | 400               | 13                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,605     | 28/08/2034      | 100               | 3                                       | 0,00                |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/(moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610 %   | 12/12/2032      | \$ 400            | \$ 9                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,611     | 28/08/2034      | 500               | 16                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,613     | 22/08/2034      | 200               | 6                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,620     | 31/01/2034      | 100               | (2)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,643     | 28/08/2034      | 200               | 6                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,645     | 07/08/2034      | 200               | 6                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,648     | 08/01/2034      | 200               | 5                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 10/07/2033      | 400               | (7)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650     | 05/03/2034      | 200               | (3)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,655     | 24/01/2034      | 100               | (2)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,665     | 24/01/2034      | 200               | (3)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,670     | 08/01/2034      | 200               | 5                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 13/08/2034      | 200               | 5                                | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,679     | 15/02/2036      | 680               | 18                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684     | 03/01/2034      | 100               | 2                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,685     | 24/01/2034      | 200               | (3)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 06/06/2033      | 16 970            | 381                              | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700     | 05/03/2034      | 100               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,710     | 05/03/2034      | 200               | (2)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,715     | 07/08/2034      | 200               | 5                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,725     | 07/02/2034      | 100               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730     | 03/08/2033      | 200               | (2)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 07/08/2033      | 200               | (2)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735     | 23/01/2034      | 100               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,738     | 23/01/2034      | 100               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2027      | 49 600            | (553)                            | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 13/12/2027      | 900               | 5                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/12/2028      | 1 080             | (33)                             | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2029      | 14 200            | 334                              | 0,01                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 8 920             | 170                              | 0,01                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2030      | 30 760            | (753)                            | (0,03)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2031      | 16 910            | (205)                            | (0,01)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 1 900             | 22                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/09/2032      | 160               | (5)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2032      | 23 570            | (636)                            | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/03/2033      | 96 734            | 2 194                            | 0,08                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 12/07/2033      | 400               | (4)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 02/01/2034      | 100               | 2                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 20/06/2034      | 4 200             | 45                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2034      | 70 880            | 680                              | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 07/05/2035      | 2 100             | (26)                             | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 16 000            | (445)                            | (0,02)              |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,755     | 15/02/2036      | 1 540             | 31                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760     | 23/08/2033      | 500               | (4)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,783     | 07/02/2034      | 100               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,793     | 19/11/2034      | 400               | (3)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,795     | 06/08/2034      | 200               | 3                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 10/03/2028      | 600               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 05/09/2028      | 800               | 2                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 22/08/2030      | 100               | 0                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800     | 30/08/2033      | 200               | (1)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810     | 02/01/2034      | 100               | 1                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830     | 12/10/2053      | 100               | (6)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,840     | 08/01/2035      | 1 200             | (8)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842     | 04/03/2030      | 2 800             | 12                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842     | 26/12/2033      | 100               | 1                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 05/08/2034      | 200               | 2                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,850     | 08/01/2035      | 600               | (4)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854     | 29/12/2033      | 200               | 2                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,855     | 19/11/2034      | 100               | 0                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 21/02/2034      | 400               | 0                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,860     | 14/11/2034      | 300               | (1)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,866     | 14/11/2034      | 700               | (2)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 05/03/2035      | 600               | 7                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870     | 17/10/2053      | 100               | (5)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,874     | 05/03/2035      | 1 100             | 12                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 10/07/2034      | 500               | 5                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880     | 16/10/2053      | 100               | (5)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,884     | 25/03/2035      | 1 100             | 11                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,885     | 12/07/2034      | 400               | 4                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,890     | 08/01/2035      | 600               | (2)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,890     | 03/03/2035      | 600               | 6                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,896     | 08/01/2035      | 1 200             | (2)                              | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 30/08/2033      | 600               | 1                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 10/04/2034      | 200               | 0                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 15/04/2034      | 100               | 0                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900     | 08/01/2035      | 1 200             | (2)                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,905     | 12/03/2035      | 1 100             | 9                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,908     | 04/03/2035      | 1 100             | 9                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,930     | 24/03/2035      | 2 200             | 14                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,933     | 06/01/2035      | 1 300             | 1                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,940     | 22/02/2029      | 700               | 2                                | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 %   | 13/09/2033      | \$ 600            | \$ 3                              | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 19/12/2033      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950     | 16/04/2034      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 27/02/2029      | 200               | 1                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,970     | 15/01/2035      | 600               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,975     | 21/03/2035      | 1 800             | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,975     | 15/11/2053      | 300               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,994     | 02/07/2034      | 300               | 0                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 220               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 5 930             | (2)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 26/02/2035      | 1 700             | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 15/02/2036      | 790               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,010     | 15/11/2053      | 17 030            | 562                               | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 30/12/2034      | 1 300             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,015     | 15/11/2053      | 16 970            | 546                               | 0,02                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 04/10/2033      | 500               | 5                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030     | 15/12/2033      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,052     | 15/02/2056      | 360               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,059     | 15/02/2056      | 360               | 8                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060     | 02/07/2034      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,066     | 15/02/2046      | 270               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,076     | 15/02/2046      | 630               | 13                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,078     | 29/04/2034      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 17/04/2034      | 200               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,080     | 05/06/2034      | 200               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,082     | 15/11/2053      | 300               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,083     | 15/11/2053      | 430               | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 22/04/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 15/11/2053      | 981               | 20                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,090     | 30/04/2034      | 700               | 9                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,105     | 24/04/2034      | 400               | 6                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,130     | 03/05/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 12/10/2033      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150     | 22/04/2034      | 200               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155     | 02/10/2033      | 400               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165     | 27/09/2033      | 600               | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170     | 03/10/2033      | 400               | 8                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175     | 10/10/2033      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200     | 18/10/2033      | 200               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220     | 20/10/2033      | 200               | 5                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230     | 23/10/2033      | 100               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 20/03/2029      | 620               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                       | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250     | 22/11/2033      | 200               | (4)                               | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255     | 23/10/2033      | 100               | 3                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393     | 25/10/2033      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435     | 01/11/2033      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 31/10/2033      | 100               | 4                                 | 0,00                |
| À payer                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450     | 01/11/2033      | 300               | 12                                | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 9,998     | 04/01/2027      | BRL 1 900         | (34)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,037    | 04/01/2027      | 500               | (9)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,041    | 04/01/2027      | 1 500             | (26)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,072    | 04/01/2027      | 1 490             | (22)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,090    | 04/01/2027      | 2 800             | (48)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,098    | 04/01/2027      | 4 490             | (67)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,138    | 04/01/2027      | 700               | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,165    | 04/01/2027      | 2 280             | (33)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,170    | 04/01/2027      | 3 800             | (55)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,183    | 04/01/2027      | 6 830             | (99)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,203    | 04/01/2027      | 5 320             | (77)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,210    | 04/01/2027      | 770               | (11)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,256    | 04/01/2027      | 5 310             | (75)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 10,328    | 04/01/2027      | 3 980             | (55)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,250    | 04/01/2027      | 1 500             | (23)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,275    | 04/01/2027      | 700               | (11)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,290    | 04/01/2027      | 800               | (12)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,731    | 04/01/2027      | 400               | (5)                               | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,746    | 04/01/2027      | 1 700             | (19)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 11,901    | 04/01/2027      | 4 000             | (39)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,800    | 02/01/2031      | 130 600           | (857)                             | (0,03)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 12,841    | 02/01/2031      | 48 400            | (312)                             | (0,01)              |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,172    | 02/01/2031      | 20 000            | (84)                              | 0,00                |
| À payer                          | CDI BRL à un an               | 13,180    | 02/01/2031      | 75 900            | (284)                             | (0,01)              |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,200    | 02/01/2031      | 1 600             | (6)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,235    | 02/01/2031      | 2 300             | (9)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,245    | 02/01/2031      | 1 100             | (4)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,250    | 02/01/2031      | 2 300             | (8)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,255    | 02/01/2031      | 9 700             | (34)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,260    | 02/01/2031      | 700               | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,300    | 02/01/2031      | 1 000             | (3)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,315    | 02/01/2031      | 2 400             | (8)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,330    | 02/01/2031      | 600               | (2)                               | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>           | CDI BRL à un an               | 13,350    | 02/01/2031      | 2 400             | (8)                               | 0,00                |

| Taux variable à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,435 %  | 02/01/2031      | BRL 850           | \$ (2)                                  | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,440    | 02/01/2031      | 850               | (2)                                     | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | CDI BRL à un an         | 13,520    | 02/01/2031      | 7 800             | (19)                                    | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | CDI BRL à un an         | 13,560    | 02/01/2031      | 3 900             | (9)                                     | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | CDI BRL à un an         | 13,670    | 02/01/2031      | 1 000             | (2)                                     | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,681    | 02/01/2031      | 16 100            | (16)                                    | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,694    | 02/01/2031      | 9 000             | (15)                                    | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,698    | 02/01/2031      | 3 700             | (6)                                     | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,724    | 02/01/2031      | 18 700            | (23)                                    | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,725    | 02/01/2031      | 500               | (1)                                     | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,790    | 02/01/2031      | 4 900             | (5)                                     | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,882    | 02/01/2031      | 24 300            | (12)                                    | 0,00                |
| À payer                              | CDI BRL à un an         | 13,899    | 02/01/2031      | 10 200            | (6)                                     | 0,00                |
| À payer                              | BBR NZD à 3 mois        | 4,750     | 19/06/2029      | NZD 2 000         | 30                                      | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | JIBAR ZAR à 3 mois      | 6,770     | 10/03/2028      | ZAR 6 900         | (4)                                     | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,740     | 15/04/2036      | 3 900             | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,800     | 16/04/2036      | 3 900             | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,800     | 21/04/2036      | 2 000             | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,820     | 16/04/2036      | 8 100             | 3                                       | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,822     | 08/04/2036      | 34 000            | 14                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,830     | 16/04/2036      | 4 000             | 2                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,855     | 16/04/2036      | 4 000             | 2                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,860     | 17/04/2036      | 4 300             | 2                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,885     | 17/04/2036      | 2 000             | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,910     | 22/04/2036      | 12 000            | 9                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,950     | 22/04/2036      | 1 790             | 2                                       | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,950     | 07/05/2036      | 6 200             | 6                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 7,960     | 22/04/2036      | 1 880             | 2                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,000     | 03/01/2031      | 5 700             | 10                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,000     | 23/04/2036      | 2 600             | 3                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,001     | 06/01/2031      | 5 700             | 10                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,010     | 07/01/2031      | 5 600             | 10                                      | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>               | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,010     | 08/05/2036      | 5 110             | 6                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,030     | 07/01/2031      | 5 600             | 10                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,053     | 07/01/2031      | 5 600             | 10                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,058     | 07/01/2031      | 5 600             | 10                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,063     | 08/01/2031      | 16 900            | 31                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,080     | 08/01/2031      | 7 900             | 15                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,080     | 24/04/2036      | 3 100             | 5                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,140     | 28/04/2036      | 2 800             | 5                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,150     | 28/04/2036      | 3 200             | 6                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,203     | 10/01/2031      | 28 200            | 62                                      | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,360     | 07/08/2028      | 500               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,380     | 04/08/2028      | 400               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,400     | 07/08/2028      | 500               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,410     | 31/07/2028      | 100               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,410     | 04/08/2028      | 1 100             | 2                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,410     | 07/08/2028      | 100               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,415     | 31/07/2028      | 100               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,415     | 04/08/2028      | 400               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,420     | 31/07/2028      | 300               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,421     | 04/08/2028      | 500               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,426     | 01/08/2028      | 100               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,428     | 31/07/2028      | 200               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,460     | 01/08/2028      | 200               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,460     | 02/08/2028      | 200               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,464     | 02/08/2028      | 200               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,543     | 04/08/2028      | 500               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | JIBAR ZAR à 3 mois      | 8,550     | 03/08/2028      | 800               | 1                                       | 0,00                |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 3,000     | 21/03/2027      | AUD 18 640        | (607)                                   | (0,02)              |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,000     | 18/09/2029      | 9 400             | (227)                                   | (0,01)              |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,000     | 17/09/2030      | 22 600            | (616)                                   | (0,02)              |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 20/09/2033      | 300               | (1)                                     | 0,00                |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 20/03/2034      | 2 600             | (18)                                    | 0,00                |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 18/09/2034      | 3 300             | (82)                                    | 0,00                |
| À payer                              | BBR-BBSW AUD à 6 mois   | 4,500     | 18/06/2035      | 69 450            | (1 826)                                 | (0,07)              |
| À payer <sup>(3)</sup>               | PRIBOR CZK à 6 mois     | 4,480     | 11/03/2036      | CZK 1 600         | 2                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,250     | 18/03/2050      | € 2 300           | 1 170                                   | 0,04                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 0,830     | 09/12/2052      | 6 800             | 884                                     | 0,03                |
| À payer                              | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,000     | 21/09/2032      | 11 880            | (642)                                   | (0,02)              |
| À payer                              | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,220     | 08/01/2035      | 700               | (37)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,280     | 04/03/2030      | 700               | 12                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,300     | 25/09/2029      | 200               | 1                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,350     | 29/04/2030      | 800               | 14                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,360     | 07/10/2029      | 200               | 0                                       | 0,00                |
| À payer                              | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,380     | 31/12/2034      | 700               | (18)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,390     | 01/10/2034      | 100               | 3                                       | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 09/04/2030      | 1 000             | 15                                      | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,400     | 12/02/2035      | 700               | 29                                      | 0,00                |
| À payer                              | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,420     | 07/03/2035      | 700               | (25)                                    | 0,00                |
| À recevoir                           | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,450     | 05/05/2035      | 600               | 25                                      | 0,00                |
| À payer                              | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,460     | 01/04/2035      | 700               | (24)                                    | 0,00                |



## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel |         | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,500 %   | 16/09/2031      | €                 | 18 500  | \$ (261)                          | (0,01)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,510     | 09/04/2035      |                   | 600     | 21                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 27/03/2035      |                   | 700     | (20)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,520     | 09/04/2035      |                   | 600     | 21                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,547     | 09/03/2033      |                   | 800     | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,550     | 16/04/2035      |                   | 600     | 19                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,580     | 29/08/2034      |                   | 100     | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,590     | 19/08/2034      |                   | 100     | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,610     | 24/03/2035      |                   | 700     | (13)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,650     | 14/08/2029      |                   | 200     | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,700     | 13/08/2029      |                   | 100     | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 05/03/2034      |                   | 200     | 0                                 | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,750     | 16/09/2036      |                   | 4 220   | (5)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,760     | 04/03/2034      |                   | 200     | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 16/04/2029      |                   | 200     | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,770     | 29/04/2034      |                   | 100     | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,780     | 02/05/2029      |                   | 200     | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,827     | 06/05/2029      |                   | 200     | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,860     | 24/04/2029      |                   | 200     | 1                                 | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 2,950     | 12/06/2029      |                   | 200     | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,000     | 16/09/2056      |                   | 16 170  | (2)                               | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,270     | 21/08/2033      |                   | 200     | 12                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,300     | 03/10/2033      |                   | 500     | 31                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,370     | 09/10/2028      |                   | 300     | 12                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois    | 3,450     | 20/10/2028      |                   | 300     | 13                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 7,220     | 14/06/2028      | MXN               | 134 400 | (50)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours     | 8,000     | 11/06/2031      |                   | 64 400  | (60)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 8,990     | 18/12/2029      |                   | 8 500   | 23                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,020     | 17/12/2029      |                   | 11 300  | 32                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,108     | 13/03/2030      |                   | 44 600  | 137                               | 0,01                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,135     | 27/12/2029      |                   | 10 400  | 31                                | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours     | 9,150     | 31/12/2029      |                   | 10 600  | 32                                | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,000     | 15/09/2031      | £                 | 300     | (42)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,020     | 15/10/2031      |                   | 400     | (52)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,055     | 15/09/2031      |                   | 400     | (55)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,066     | 15/09/2031      |                   | 600     | (72)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,140     | 15/10/2031      |                   | 1 000   | (114)                             | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,250     | 15/11/2031      |                   | 900     | (73)                              | 0,00                |
| À payer                                            | IPC Royaume-Uni         | 4,400     | 15/10/2031      |                   | 400     | (34)                              | 0,00                |
|                                                    |                         |           |                 |                   |         | \$ 3 249                          | 0,12                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                         |           |                 |                   |         | \$ 4 857                          | 0,17                |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 %              | 20/12/2027      | \$ 200                           | \$ (18)                | \$ 19                             | \$ 1         | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2026      | 300                              | (14)                   | 15                                | 1            | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 100                              | (3)                    | 4                                 | 1            | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 100                              | (3)                    | 3                                 | 0            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2027      | 100                              | (9)                    | 10                                | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain  | 1,000                | 20/12/2028      | 300                              | (3)                    | 7                                 | 4            | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 200                              | (7)                    | 8                                 | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2027      | 200                              | (18)                   | 19                                | 1            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain  | 1,000                | 20/12/2026      | 1 100                            | 3                      | 1                                 | 4            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain  | 1,000                | 20/06/2027      | 400                              | (1)                    | 4                                 | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain  | 1,000                | 20/06/2028      | 300                              | (6)                    | 9                                 | 3            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement mexicain  | 1,000                | 20/12/2028      | 1 300                            | (14)                   | 30                                | 16           | 0,00                |
|              |                                                     |                      |                 |                                  | \$ (93)                | \$ 129                            | \$ 36        | 0,00                |



SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index                       | 0,110 %              | 25/05/2046      | \$ 225                           | \$ (56 )               | \$ 38                             | \$ (18)      | 0,00                |
|              | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | € 2 170                          | 494                    | (32)                              | 462          | 0,02                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 1 010                            | 232                    | (17)                              | 215          | 0,01                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 340                              | 77                     | (5)                               | 72           | 0,00                |
| DUB          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | \$ 243                           | (4 )                   | 4                                 | 0            | 0,00                |
| GST          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 4 169                            | 9                      | (5)                               | 4            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 7 297                            | (38 )                  | 59                                | 21           | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.6 Index                        | 0,500                | 11/05/2063      | 1                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index                        | 0,500                | 17/10/2057      | 104                              | (2 )                   | 2                                 | 0            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index                        | 0,500                | 17/09/2058      | 7                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | € 1 780                          | 408                    | (29)                              | 379          | 0,01                |
| MEI          | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | \$ 500                           | (4 )                   | 5                                 | 1            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index                        | 0,500                | 17/10/2057      | 2                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index                        | 0,500                | 17/09/2058      | 13                               | (1 )                   | 1                                 | 0            | 0,00                |
| MYI          | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index                       | 0,110                | 25/05/2046      | 356                              | 0                      | (28)                              | (28)         | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 500                              | 0                      | 1                                 | 1            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.6 Index                        | 0,500                | 11/05/2063      | 1                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index                        | 0,500                | 17/10/2057      | 1                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| SAL          | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index                       | 0,500                | 17/11/2059      | 1 263                            | 14                     | (13)                              | 1            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index                       | 0,500                | 18/11/2054      | 1 200                            | 6                      | (2)                               | 4            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index                       | 0,500                | 17/08/2061      | 325                              | 0                      | 1                                 | 1            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.6 Index                        | 0,500                | 11/05/2063      | 1                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index                        | 0,500                | 17/09/2058      | 347                              | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
| UAG          | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index                        | 0,500                | 17/10/2057      | 1                                | 0                      | 0                                 | 0            | 0,00                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 1 135               | \$ (20)                           | \$ 1 115     | 0,04                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre        | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR          | À payer             | Nvidia Corp. | 10 186                       | 5,620 %       | \$ 1 961          | 29/07/2026      | \$ 0                   | \$ (76)                           | \$ (76)      | 0,00                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |             | Devise à recevoir |        | Plus-value latente |     | (Moins-value) latente |   | Plus-value/ (moins-value) latente nette |     | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|--------|--------------------|-----|-----------------------|---|-----------------------------------------|-----|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 15 739      | \$                | 11 255 | \$                 | 351 | \$                    | 0 | \$                                      | 351 | 0,01                |
|              | 07/2026           | CNH             | 1 491       |                   | 221    |                    | 1   |                       | 0 |                                         | 1   | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 9 218       |                   | 5 444  |                    | 200 |                       | 0 |                                         | 200 | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 529       | CAD               | 2 174  |                    | 3   |                       | 0 |                                         | 3   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 264       | NZD               | 7 548  |                    | 30  |                       | 0 |                                         | 30  | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 2 171       | \$                | 1 529  |                    | 0   | (3)                   |   | (3)                                     |     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 7 548       |                   | 4 268  |                    | 0   | (30)                  |   | (30)                                    |     | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL             | 209         |                   | 40     |                    | 0   |                       | 0 |                                         | 0   | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 122         |                   | 163    |                    | 1   |                       | 0 |                                         | 1   | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 530       |                   | 16     |                    | 0   |                       | 0 |                                         | 0   | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 134 199     |                   | 88     |                    | 1   |                       | 0 |                                         | 1   | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 3 970       |                   | 401    |                    | 0   |                       | 0 |                                         | 0   | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 16          |                   | 13     |                    | 0   |                       | 0 |                                         | 0   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1 284       | CNH               | 8 683  |                    | 0   | (5)                   |   | (5)                                     |     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 169       | €                 | 1 004  |                    | 0   | (21)                  |   | (21)                                    |     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 288         | ¥                 | 45 773 |                    | 0   | (6)                   |   | (6)                                     |     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 386       | NOK               | 12 883 |                    | 0   | (85)                  |   | (85)                                    |     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 136         | PLN               | 514    |                    | 1   |                       | 0 |                                         | 1   | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 352       | \$                | 791    |                    | 1   |                       | 0 |                                         | 1   | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 9 149       |                   | 523    |                    | 0   | (33)                  |   | (33)                                    |     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT             | 59 395      |                   | 118    |                    | 0   | (3)                   |   | (3)                                     |     | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 2 966       |                   | 167    |                    | 0   | (1)                   |   | (1)                                     |     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN             | 2 402       |                   | 699    |                    | 0   | (3)                   |   | (3)                                     |     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 59          | INR               | 5 575  |                    | 0   |                       | 0 |                                         | 0   | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR             | 1 258       | \$                | 77     |                    | 1   |                       | 0 |                                         | 1   | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 978         |                   | 284    |                    | 0   | (1)                   |   | (1)                                     |     | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR             | 206         |                   | 11     |                    | 0   | (1)                   |   | (1)                                     |     | 0,00                |
|              | 12/2026           | COP             | 4 397 572   |                   | 1 102  |                    | 0   | (125)                 |   | (125)                                   |     | (0,01)              |
|              | 01/2027           | ZAR             | 15 146      |                   | 921    |                    | 12  |                       | 0 |                                         | 12  | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL             | 3 956       |                   | 764    |                    | 2   | (2)                   |   |                                         | 0   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 1 074       |                   | 1 365  |                    | 34  |                       | 0 |                                         | 34  | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 11 339      |                   | 1 676  |                    | 5   |                       | 0 |                                         | 5   | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 11 962      |                   | 13 642 |                    | 0   | (34)                  |   | (34)                                    |     | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 9 689       |                   | 13 000 |                    | 140 |                       | 0 |                                         | 140 | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR             | 147 275 053 |                   | 8 218  |                    | 7   | (5)                   |   |                                         | 2   | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ ILS 3 727    | \$ 1 265          | \$ 13              | \$ 0                  | \$ 13                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 268 929     | 2 800             | 0                  | (41)                  | (41)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 628 150     | 412               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 38 314      | 1 168             | 16                 | (2)                   | 14                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 183          | \$ BRL 924        | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 737             | CNY 5 030         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 150           | € 3 637           | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 592           | £ 1 203           | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8 096           | INR 767 772       | 18                 | (15)                  | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 974             | ¥ 154 831         | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 951           | KRW 2 992 763     | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 28              | KWD 8             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 18              | TWD 582           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 578             | ZAR 9 487         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 1 241         | \$ 1 640          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 519         | 174               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 14 883 663  | 819               | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 33 499      | 1 033             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 4 852        | IDR 85 886 567    | 6                  | (97)                  | (91)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 573             | INR 54 478        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 200             | THB 6 544         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 12/2026           | 498             | IDR 9 075 157     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 06/2027           | 22              | KWD 7             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2029           | KWD 12          | \$ 40             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 05/2030           | 69              | 237               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 08/2030           | 69              | 233               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 01/2031           | 38              | 127               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| BRC          | 06/2031           | 51              | 173               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 4 616       | 1 560             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 13 390      | 7 918             | 302                | 0                     | 302                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | TRY 110 539     | 2 308             | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 711       | TRY 512 741       | 121                | 0                     | 121                                     | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | 2 885           | ZAR 46 853        | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 8 208       | \$ 464            | 0                  | (36)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 45            | 52                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 3 251       | 941               | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 160        | ¥ 820 476         | 0                  | (112)                 | (112)                                   | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | 7 386           | NZD 13 073        | 50                 | 0                     | 50                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 13 073      | \$ 7 395          | 0                  | (50)                  | (50)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 4 521        | BRL 23 188        | 0                  | (107)                 | (107)                                   | 0,00                |
|              | 02/2027           | PEN 9 112       | \$ 2 619          | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 4 155       | 1 430             | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 172 012     | 1 823             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 4 640       | 500               | 31                 | 0                     | 31                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 28 625      | 8 195             | 0                  | (197)                 | (197)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | PLN 114         | 31                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 123        | € 5 269           | 0                  | (99)                  | (99)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 566           | IDR 28 089 043    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 775           | INR 172 012       | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 207             | KRW 313 638       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 250           | PEN 17 909        | 2                  | (1)                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 020           | PLN 3 726         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 619             | SEK 5 717         | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 5 793       | \$ 2 003          | 57                 | 0                     | 57                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 405          | ILS 1 204         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 3 490 966   | \$ 902            | 0                  | (93)                  | (93)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 54 050 844  | 2 994             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 18 351      | 191               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 124 026     | 246               | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 17 954      | 5 247             | 1                  | (5)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 41 338      | 1 248             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 003        | IDR 17 895 723    | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 467             | MXN 8 348         | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 22              | PEN 74            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN 2 858       | \$ 835            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           | 25 852          | 7 396             | 0                  | (137)                 | (137)                                   | (0,01)              |
|              | 12/2026           | \$ 1 429        | IDR 25 972 609    | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | IDR 3 778 206   | \$ 211            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 65 155      | 690               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT 33 150      | 70                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 3 485       | 1 030             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 116         | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 460          | INR 44 412        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 136             | NOK 1 263         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 019           | PLN 3 780         | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 346           | ZAR 21 787        | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 6 025       | \$ 340            | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT 210 944     | 436               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 35 929 219  | 1 994             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 471         | 134               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 616          | IDR 11 184 376    | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 690             | INR 65 597        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 11/2026           | KZT 129 335     | \$ 261            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 11 281      | 1 667             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 51 157        | 68 793            | 895                | 0                     | 895                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | INR 64 760      | 686               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 4 149 740     | 25 647            | 114                | 0                     | 114                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 479         | 131               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 3 403       | 351               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| GLM          | 07/2026           | \$SGD           | 28 473            | \$ 22 318          | \$ 305                | \$ 305                                 | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 5 045             | \$CNH 34 319       | 10                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 679               | INR 64 760         | 6                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 353             | ¥ 373 867          | 0                     | (52)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 774             | PLN 13 872         | 0                     | (84)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 881             | ZAR 31 037         | 10                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 34 243            | \$ 5 045           | 0                     | (10)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 2 418             | 845                | 32                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 25 647            | ¥ 4 138 880        | 0                     | (115)                                  | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 351               | SEK 3 397          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 332               | INR 31 775         | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 379               | MXN 6 689          | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 182 733           | \$ 35 465          | 161                   | 0                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 597 693           | 387                | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 34 287            | BRL 183 637        | 1 258                 | (65)                                   | 0,04                |
|              | 07/2026           |                 | 19 805            | CAD 28 182         | 59                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 144             | COP 3 940 657      | 0                     | (7)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 498             | IDR 26 862 547     | 4                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 387               | KRW 597 608        | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 101               | ZAR 1 664          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 28 142            | \$ 19 805          | 0                     | (60)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | NGN             | 56 700            | 36                 | 0                     | (4)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 455               | INR 43 618         | 4                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR             | 8 572             | \$ 481             | 0                     | (41)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 3 940 657         | 1 129              | 6                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 27 019 857        | 1 498              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 4 144             | 237                | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 100 837           | 3 125              | 70                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 35 465            | BRL 185 462        | 0                     | (165)                                  | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 2 873             | IDR 51 579 703     | 6                     | (19)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 846             | INR 177 557        | 17                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 609               | MXN 10 617         | 0                     | (5)                                    | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD             | 68 126            | \$ 48 567          | 1 370                 | 1 370                                  | 0,05                |
|              | 07/2026           | ILS             | 11 785            | 3 947              | 0                     | (9)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 3 734             | 40                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 184 690           | 119                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KZT             | 16 935            | 35                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 6 401             | 647                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 286               | 169                | 6                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN             | 391               | 107                | 3                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 220               | CAD 306            | 0                     | (4)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 393             | € 2 052            | 0                     | (47)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 18                | £ 14               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 229               | IDR 4 116 288      | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 40                | INR 3 734          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 179               | KRW 274 317        | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 282             | NZD 2 273          | 11                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 367             | PLN 8 637          | 0                     | (69)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 837               | THB 27 975         | 5                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 185               | ZAR 3 007          | 0                     | (2)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 9 468             | \$ 3 252           | 72                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | KZT             | 78 737            | 162                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 647               | NOK 6 404          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 4 139 162         | 229                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 40 635            | 426                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 7 348             | 417                | 1                     | (2)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 80 204            | 2 457              | 36                    | (9)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 882               | INR 84 145         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 4 476             | MXN 78 156         | 0                     | (32)                                   | 0,00                |
|              | 11/2026           | ZAR             | 12 350            | \$ 705             | 0                     | (41)                                   | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$              | 29 574            | MXN 519 057        | 0                     | (268)                                  | (0,01)              |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 283               | \$ 203             | 6                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 10 387            | 13 186             | 320                   | (11)                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | €               | 19 484            | 22 564             | 285                   | 0                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | IDR             | 369 865           | 21                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 65 413            | 693                | 2                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 2 309 872         | 1 524              | 32                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK             | 2 101             | 212                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK             | 2 078             | 213                | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 35 151            | AUD 50 734         | 124                   | (126)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 2 165             | € 1 907            | 15                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 068             | INR 102 943        | 18                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4 812             | ¥ 764 516          | 0                     | (108)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 324               | NOK 3 002          | 0                     | (20)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD             | 41 184            | \$ 28 399          | 0                     | (116)                                  | (0,01)              |
|              | 08/2026           | \$              | 102               | NOK 1 017          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 213               | SEK 2 074          | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 24 675            | \$ 739             | 0                     | (8)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 908             | INR 278 235        | 14                    | (4)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 327               | MXN 5 703          | 0                     | (2)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR             | 469               | \$ 26              | 0                     | (2)                                    | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | €               | 6 049             | 6 908              | 2                     | (11)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 2                 | 2                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 17                | £ 13               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           |                 | 1 394             | IDR 24 864 509     | 0                     | (4)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 080             | INR 103 899        | 17                    | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 25 003 955        | \$ 1 394           | 8                     | 0                                      | 0,00                |
| SCX          | 09/2026           | \$              | 614               | IDR 10 925 734     | 0                     | (8)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP             | 3 940 657         | \$ 1 023           | 0                     | (114)                                  | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | € 812           | \$ 925            | \$ 0               | \$ (4)                | \$ (4)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 726        | \$CNY 11 782      | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 532             | IDR 9 547 512     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 421           | INR 136 238       | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 131           | 108 340           | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 28 336 285  | \$ 1 570          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | KZT 19 444      | 39                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 35 908      | 1 112             | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 565        | IDR 28 101 075    | 2                  | (10)                  | (8)                                     | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN 38 820      | 24                | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 5 296       | 3 836             | 103                | 0                     | 103                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 18 889      | 2 792             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 292 505       | 341 217           | 6 797              | 0                     | 6 797                                   | 0,25                |
|              | 07/2026           | SGD 42          | 32                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 23 056       | AUD 33 414        | 94                 | 0                     | 94                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 336             | CHF 272           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 336 828         | € 296 112         | 1 718              | 0                     | 1 718                                   | 0,06                |
|              | 07/2026           | 12 531          | ¥ 1 990 790       | 0                  | (283)                 | (283)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 22 032          | SGD 28 531        | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 33 414      | \$ 23 041         | 0                  | (95)                  | (95)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 271         | 336               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 296 112       | 337 285           | 0                  | (1 715)               | (1 715)                                 | (0,06)              |
|              | 08/2026           | KZT 20 077      | 41                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 28 467      | 22 032            | 0                  | (28)                  | (28)                                    | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | \$ 32           | SGD 42            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 29 276      | \$ 21 231         | 596                | 0                     | 596                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | CHF 369         | 470               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1 405        | CAD 1 992         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 78 983          | £ 59 751          | 322                | 0                     | 322                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 1 990       | \$ 1 405          | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | COP 18 581 150  | 4 871             | 0                  | (461)                 | (461)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | € 11 962        | 13 656            | 0                  | (38)                  | (38)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 59 751        | 78 982            | 0                  | (323)                 | (323)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | PLN 116         | 32                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | \$ 1 037        | PLN 3 789         | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 34 853 141  | \$ 9 083          | 0                  | (852)                 | (852)                                   | (0,03)              |
|              | 09/2026           | MXN 3 017       | 172               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 4 497       | 137               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$ 14 316       | CHF 11 558        | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 11 517      | \$ 14 316         | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 16 690          | \$ (7 178)            | \$ 9 512                                | 0,34                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution II, T en EUR (couverte) de capitalisation, T en EUR (couverte) de distribution et Z en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 2 064       | \$ 1 476          | \$ 46              | \$ 0                  | \$ 46                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 167          | CAD 238           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | CAD 238         | \$ 167            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 579 785     | 6 030             | 0                  | (94)                  | (94)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 146 475       | 921               | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 375         | 21                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 1 717       | 185               | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 524 320     | 16 660            | 204                | 0                     | 204                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 3 292        | € 2 828           | 0                  | (58)                  | (58)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 124           | INR 578 197       | 0                  | (18)                  | (18)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10 651          | ¥ 1 694 340       | 0                  | (227)                 | (227)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 5 138           | KRW 7 933 278     | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 735           | TWD 117 557       | 0                  | (46)                  | (46)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR 579 820     | \$ 6 124          | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW 7 932 199   | 5 138             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 21           | MXN 375           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CAD 3 762       | \$ 2 726          | 74                 | 0                     | 74                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 1 457         | 1 961             | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 13           | CNY 91            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 794 906         | € 682 631         | 63                 | (14 518)              | (14 455)                                | (0,52)              |
| BRC          | 08/2026           | HKD 56 398      | \$ 7 200          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 28 884      | 1 644             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
| BSH          | 08/2026           | \$ 1 640        | MXN 28 884        | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 510 476     | \$ 9 500          | 206                | 0                     | 206                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 663 368      | € 568 966         | 0                  | (12 870)              | (12 870)                                | (0,47)              |
| CBK          | 07/2026           | 3 574           | ZAR 58 750        | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR 58 902      | \$ 3 574          | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 1 873       | 292               | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 37 198 171  | 2 092             | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | SEK 45 806      | 4 958             | 226                | 0                     | 226                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 38 540       | € 33 044          | 0                  | (760)                 | (760)                                   | (0,03)              |
|              | 07/2026           | ZAR 62 646      | \$ 3 850          | 28                 | 0                     | 28                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNY 18 434      | 2 717             | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| FAR          | 07/2026           | \$NOK 4 265     | \$ 459            | \$ 28              | \$ 0                  | \$ 28                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12 922       | \$ HKD 101 343    | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 12 758          | TWD 406 533       | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 101 221     | \$ 12 922         | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD 407 120     | 12 758            | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 597 314       | 681 235           | 0                  | (1 675)               | (1 675)                                | (0,06)              |
|              | 07/2026           | £ 20 509        | 27 579            | 360                | 0                     | 360                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | HKD 157 808     | 20 162            | 38                 | 0                     | 38                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 60 899        | 383               | 9                  | 0                     | 9                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 251         | 14                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 8 734       | 6 846             | 94                 | 0                     | 94                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 32 709       | ¥ 5 292 272       | 0                  | (146)                 | (146)                                  | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 1 749           | MXN 30 736        | 10                 | 0                     | 10                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 816           | SEK 27 324        | 7                  | 0                     | 7                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 5 278 423     | \$ 32 709         | 147                | 0                     | 147                                    | 0,01                |
| GLM          | 08/2026           | MXN 30 736      | 1 744             | 0                  | (11)                  | (11)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 27 276      | 2 816             | 0                  | (7)                   | (7)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 682 154      | € 597 314         | 1 671              | 0                     | 1 671                                  | 0,06                |
|              | 07/2026           | 16 096          | CAD 22 905        | 48                 | 0                     | 48                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 16              | INR 1 535         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 22 872      | \$ 16 096         | 0                  | (48)                  | (48)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR 1 535       | 16                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 3 348       | 523               | 11                 | 0                     | 11                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 8 934       | 6 369             | 180                | 0                     | 180                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | BRL 11 614      | 2 297             | 53                 | 0                     | 53                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 262        | BRL 11 641        | 0                  | (13)                  | (13)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 221           | NOK 12 084        | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 11 731      | \$ 2 262          | 13                 | 0                     | 13                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 12 089      | 1 221             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 37          | 27                | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | BRL 27          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 693 738       | 788 034           | 56                 | (5 173)               | (5 117)                                | (0,18)              |
|              | 07/2026           | ILS 7 248       | 2 577             | 145                | 0                     | 145                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 604 421     | 10 096            | 225                | 0                     | 225                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW 21 913      | 15                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 10 135      | 1 093             | 69                 | 0                     | 69                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 101         | 11                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 204        | AUD 6 092         | 17                 | 0                     | 17                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 413           | DKK 22 371        | 9                  | 0                     | 9                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 25 597          | € 22 092          | 0                  | (339)                 | (339)                                  | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 2 069           | IDR 37 198 171    | 7                  | 0                     | 7                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 392             | NOK 3 897         | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 714           | SEK 16 686        | 10                 | 0                     | 10                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 6 092       | \$ 4 201          | 0                  | (17)                  | (17)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 22 332      | 3 413             | 0                  | (9)                   | (9)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR 37 198 171  | 2 064             | 0                  | (4)                   | (4)                                    | 0,00                |
| MYI          | 08/2026           | NOK 3 899       | 392               | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 16 657      | 1 714             | 0                  | (10)                  | (10)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 5            | BRL 27            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | 802 092         | € 705 176         | 5 217              | 0                     | 5 217                                  | 0,19                |
|              | 07/2026           | DKK 20 709      | \$ 3 233          | 65                 | 0                     | 65                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 293        | ZAR 37 683        | 6                  | 0                     | 6                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR 37 782      | \$ 2 293          | 0                  | (6)                   | (6)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 1            | INR 53            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 33 774      | \$ 2 076          | 15                 | 0                     | 15                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 3 515       | 547               | 10                 | 0                     | 10                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 683 762       | 777 779           | 0                  | (3 967)               | (3 967)                                | (0,14)              |
|              | 07/2026           | ¥ 3 664 996     | 23 070            | 520                | 0                     | 520                                    | 0,02                |
|              | 07/2026           | MXN 6           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 3 411        | AUD 4 943         | 14                 | 0                     | 14                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 32              | CHF 26            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 779 896         | € 668 555         | 0                  | (15 538)              | (15 538)                               | (0,56)              |
| SSB          | 07/2026           | 1 867           | MXN 32 819        | 11                 | 0                     | 11                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 754           | SGD 8 746         | 8                  | 0                     | 8                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 4 943       | \$ 3 409          | 0                  | (14)                  | (14)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 26          | 32                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 32 819      | 1 862             | 0                  | (11)                  | (11)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 8 727       | 6 754             | 0                  | (8)                   | (8)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 778 834      | € 683 762         | 3 959              | 0                     | 3 959                                  | 0,14                |
|              | 07/2026           | CAD 19 782      | \$ 14 346         | 404                | 0                     | 404                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | CHF 25 988      | 33 060            | 844                | 0                     | 844                                    | 0,03                |
|              | 07/2026           | € 3 303         | 3 766             | 0                  | (11)                  | (11)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 7 738       | 1 961             | 65                 | 0                     | 65                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 148          | CAD 210           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 29 036          | £ 21 966          | 118                | 0                     | 118                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 888           | MYR 7 729         | 5                  | 0                     | 5                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 209         | \$ 148            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 21 966        | 29 035            | 0                  | (118)                 | (118)                                  | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | MYR 7 727       | 1 888             | 0                  | (4)                   | (4)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 3 771        | € 3 303           | 11                 | 0                     | 11                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 7 909 515   | \$ 5 231          | 124                | 0                     | 124                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 34 038      | 1 960             | 12                 | 0                     | 12                                     | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| WST          | 07/2026           | \$ 32 155       | CHF 25 962        | \$ 29              | \$ 0                  | \$ 29                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 25 869      | \$ 32 155         | 0                  | (30)                  | (30)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 15 632          | \$ (55 791)           | \$ (40 159)                             | (1,46)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | INR 4 816       | \$ 50             | \$ 0               | \$ (1)                | \$ (1)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 199         | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 5           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 18          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 4 501       | 143               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 13           | £ 10              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 51              | INR 4 803         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 78              | ¥ 12 470          | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 34              | KRW 52 832        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 34              | TWD 1 063         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR 4 817       | \$ 51             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW 52 825      | 34                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 0            | MXN 5             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | CAD 29          | \$ 21             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 21          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 4 428         | 5 841             | 1                  | (37)                  | (36)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10           | € 9               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 834           | £ 5 099           | 0                  | (66)                  | (66)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 10            | \$ 13             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 5 240        | £ 3 974           | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | £ 48            | \$ 64             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 357         | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 20           | MXN 357           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | ¥ 12 366        | \$ 78             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | DKK 35          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 23            | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 403 317     | 23                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 509         | 55                | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 22           | € 19              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | CNY 166         | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 45          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 170          | HKD 1 332         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 108             | TWD 3 436         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 1 330       | \$ 170            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD 3 441       | 108               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | CNH 21          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 9             | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 499           | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 3           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 95          | 74                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 11           | CNH 77            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 018           | £ 4 475           | 0                  | (78)                  | (78)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 276             | ¥ 44 727          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 22              | MXN 380           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 31              | SEK 303           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 77          | \$ 11             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 4             | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 44 610        | 276               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 380         | 22                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 302         | 31                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 10           | € 9               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| IND          | 07/2026           | DKK 62          | \$ 10             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 90          | 64                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 122         | 24                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 3             | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 24           | BRL 122           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 538           | £ 4 872           | 0                  | (71)                  | (71)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 13              | NOK 128           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 20              | PLN 77            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 123         | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 128         | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN 77          | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 21          | 15                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 0           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 230         | 294               | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 19            | 25                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 1 332       | 170               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 49          | 17                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 13 135        | 83                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 107         | 12                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 77          | 21                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 42           | AUD 61            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19              | DKK 126           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ 267          | € 235             | \$ 2               | \$ 0                  | \$ 2                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 22              | IDR 403 317       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4               | NOK 41            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 19              | SEK 185           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ AUD 61       | \$ 42             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 126         | 19                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 235           | 267               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR 403 317     | 22                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 41          | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 185         | 19                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 0            | BRL 0             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 70              | £ 52              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 50              | ZAR 815           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR 817         | \$ 50             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 816           | 1 074             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 074        | £ 816             | 9                  | 0                     | 9                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 4 782         | \$ 6 331          | 1                  | (17)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 816         | 50                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 6 221        | £ 4 701           | 17                 | 0                     | 17                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | CNH 34          | \$ 5              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 66          | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 446           | 520               | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 4 684         | 6 188             | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 30 004        | 189               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 0           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 34           | AUD 50            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 219             | € 192             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6               | £ 4               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 23              | MXN 405           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 73              | SGD 95            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 50          | \$ 34             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 192           | 219               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 4             | 6                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 405         | 23                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 95          | 73                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 6 187        | £ 4 684           | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 170         | \$ 123            | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 101         | 26                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 46           | CAD 65            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 376             | £ 285             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 25              | MYR 101           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 65          | \$ 46             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 285           | 376               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | MYR 101         | 25                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | KRW 52 819      | 35                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 420         | 24                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| WST          | 07/2026           | \$ 285          | CHF 230           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF 229         | \$ 285            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 142             | \$ (317)              | \$ (175)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en ILS (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | INR 1 749       | \$ 18             | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 3 304         | 21                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 25          | 20                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 1 689       | 54                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 18           | INR 1 744         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 17              | KRW 25 680        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 0               | MXN 2             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | SGD 12            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 11              | TWD 343           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | INR 1 749       | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW 25 677      | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 2           | 0                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 12          | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 2               | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8            | MXN 134           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 134         | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | BRL 54          | 11                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 17          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 138 559     | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 42          | 14                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 143         | 15                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 17           | ILS 51            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 5               | 15                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | CNY 48          | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 9           | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 4           | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 65           | HKD 508           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| IND<br>MBC   | 07/2026           | \$ 7            | SGD 10            | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 42              | TWD 1 345         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 508         | \$ 65             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 10          | 7                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | TWD 1 347       | 42                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 10          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | AUD 44          | 31                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 86          | 110               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | HKD 508         | 65                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 253         | 89                | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 18 373        | 116               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 21          | 2                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PLN 13          | 4                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 30           | AUD 44            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10              | BRL 54            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 12              | DKK 76            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 191             | € 169             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 8               | IDR 138 559       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7 713           | ILS 21 709        | 0                  | (428)                 | (428)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | 3               | NOK 29            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 13              | SEK 128           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 44          | \$ 30             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | BRL 54          | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | DKK 75          | 12                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 169           | 192               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | IDR 138 559     | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 26          | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NOK 29          | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SEK 128         | 13                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 18           | ILS 52            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 70          | \$ 11             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 84          | 28                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12           | ZAR 204           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ZAR 205         | \$ 12             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | \$ 2            | SGD 3             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 3           | \$ 2              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 13          | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | € 169           | 196               | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 66            | 88                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 374         | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | \$ 143          | ¥ 23 030          | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 204         | \$ 12             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 17 443        | 108               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 64          | 47                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MYR 22          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 18           | CAD 26            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 96              | £ 73              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5               | MYR 22            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 25          | \$ 18             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 73            | 96                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | MYR 22          | 5                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 7             | 9                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 25 674      | 17                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | MXN 136         | 8                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4            | PLN 13            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | PLN 13          | \$ 4              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 22              | \$ (431)              | \$ (409)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | INR 23 531      | \$ 245            | \$ 0               | \$ (4)                | \$ (4)                                  | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 36 429        | 229               | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 15 858      | 12 252            | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | TWD 17 396      | 553               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 249          | INR 23 468        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 108             | KRW 166 205       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1               | MXN 14            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 23 776          | SGD 30 364        | 0                  | (301)                 | (301)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | INR 23 534      | \$ 249            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | KRW 166 183     | 108               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | MXN 14          | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 12 252       | SGD 15 821        | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 61              | MXN 1 065         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 28 137          | SGD 35 877        | 0                  | (401)                 | (401)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | MXN 1 065       | \$ 60             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | BRL 698         | 137               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 248         | 39                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 1 760 773   | 99                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| DUB                                                | 07/2026           | SEK             | 1 608             | \$ 174             | \$ 8                  | \$ 0                                    | 8 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | CNY             | 640               | 94                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | NOK             | 109               | 12                 | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | SGD             | 23 048            | 17 817             | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 729               | 5 714              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 19 936            | SGD 25 433         | 0                     | (273)                                   | (273) (0,01)        |
|                                                    | 07/2026           |                 | 546               | TWD 17 386         | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | HKD             | 5 707             | \$ 729             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | TWD             | 17 411            | 546                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 17 817            | SGD 22 995         | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
| IND                                                | 07/2026           | DKK             | 154               | \$ 24              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | AUD             | 440               | 315                | 10                    | 0                                       | 10 0,00             |
|                                                    | 07/2026           | CHF             | 999               | 1 276              | 37                    | 0                                       | 37 0,00             |
|                                                    | 07/2026           | HKD             | 5 713             | 730                | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | ILS             | 275               | 98                 | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | ¥               | 202 585           | 1 274              | 28                    | 0                                       | 28 0,00             |
|                                                    | 07/2026           | NOK             | 259               | 28                 | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | PLN             | 162               | 44                 | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 303               | AUD 440            | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 134               | BRL 698            | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
| MBC                                                | 07/2026           |                 | 128               | DKK 842            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 2 199             | € 1 936            | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|                                                    | 07/2026           |                 | 98                | IDR 1 760 773      | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 36                | NOK 356            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 148               | SEK 1 444          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 12 294            | SGD 15 675         | 0                     | (175)                                   | (175) (0,01)        |
|                                                    | 08/2026           | AUD             | 440               | \$ 303             | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|                                                    | 08/2026           | BRL             | 698               | 133                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|                                                    | 08/2026           | DKK             | 840               | 128                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | €               | 1 936             | 2 202              | 0                     | (15)                                    | (15) 0,00           |
| MYI                                                | 08/2026           | IDR             | 1 760 773         | 98                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | NOK             | 356               | 36                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | SEK             | 1 441             | 148                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|                                                    | 07/2026           | DKK             | 683               | 107                | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 153               | ZAR 2 508          | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | ZAR             | 2 515             | \$ 153             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | SGD             | 3 946             | 3 048              | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 3 048             | SGD 3 937          | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 130               | \$ 94              | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | €               | 1 936             | 2 252              | 39                    | 0                                       | 39 0,01             |
| SCX                                                | 07/2026           | £               | 807               | 1 081              | 10                    | 0                                       | 10 0,00             |
|                                                    | 07/2026           | ¥               | 15 145            | 95                 | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 1 577             | ¥ 253 942          | 0                     | (14)                                    | (14) 0,00           |
|                                                    | 07/2026           | ZAR             | 2 511             | \$ 153             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | ¥               | 194 379           | 1 206              | 7                     | 0                                       | 7 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 738               | 535                | 15                    | 0                                       | 15 0,00             |
|                                                    | 07/2026           | MYR             | 264               | 67                 | 2                     | 0                                       | 2 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 201               | CAD 284            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 1 067             | £ 807              | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 85                | KRW 127 993        | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
| SSB                                                | 07/2026           |                 | 64                | MYR 263            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 1 026             | SGD 1 309          | 0                     | (14)                                    | (14) 0,00           |
|                                                    | 08/2026           | CAD             | 284               | \$ 201             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | £               | 807               | 1 067              | 0                     | (4)                                     | (4) 0,00            |
|                                                    | 08/2026           | MYR             | 263               | 64                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | KRW             | 294 159           | 195                | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | MXN             | 1 079             | 62                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 43                | PLN 162            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    | 08/2026           | PLN             | 162               | \$ 43              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 230             | \$ (1 221)            | \$ (991)                                | (0,03)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (31 147)                             | (1,13)              |

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>                                |                               |                            |                     |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                     | \$ 600                        | \$ 212                     | 0,01                |
| Obligation internationale du gouvernement russe                |                               |                            |                     |
| 5,100 % éch. 28/03/2035                                        | 200                           | 0                          | 0,00                |
| 5,250 % éch. 23/06/2047                                        | 4 200                         | 0                          | 0,00                |
| Total des Autres actifs financiers                             |                               | \$ 212                     | 0,01                |
| <b>TITRES VENDUS À DÉCOUVERT</b>                               |                               |                            |                     |
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                               |                            |                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                               |                            |                     |
| 2,000 % éch. 01/07/2056                                        | 10 600                        | (8 467)                    | (0,31)              |
| 6,500 % éch. 01/08/2056                                        | 2 000                         | (2 066)                    | (0,07)              |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                               | \$ (10 533)                | (0,38)              |
| Total des Investissements                                      |                               | \$ 3 775 235               | 136,81              |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                               | \$ (1 015 788)             | (36,81)             |
| Actif net                                                      |                               | \$ 2 759 447               | 100,00              |

## Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.  
 ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.  
 (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).  
 (b) Titre vendu avant l'émission.  
 (c) Titre à rémunération en nature.  
 (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.  
 (e) Titre à coupon zéro.  
 (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.  
 (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.  
 (h) Affilié au Fonds.  
 (i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,14 %) :

| Description de l'émetteur                                    | Date d'achat | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Kuwait Government International Bond 4.804 % éch. 20/04/2033 | 13/04/2026   | \$ 4 300 | \$ 4 293     | 0,16                |
| Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032                       | 02/04/2020   | 635      | 522          | 0,02                |
| ZTO Express Cayman, Inc.                                     | 13/05/2026   | 1 195    | 1 073        | 0,04                |
|                                                              |              | \$ 6 130 | \$ 5 888     | 0,22                |

Un montant en numéraire de 41 295 \$ (31 décembre 2025 : 27 022 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 39 644 \$ (31 décembre 2025 : 4 564 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 773 027                                                                        | \$ 2 644 523                                         | \$ 75 261                                         | \$ 3 492 811        |
| Fonds d'investissement                        | 199 782                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 199 782             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 115 200                                              | 0                                                 | 115 200             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 2 171                                                                             | (24 362)                                             | (46)                                              | (22 237)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 212                                                  | 0                                                 | 212                 |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (10 533)                                             | 0                                                 | (10 533)            |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 974 980</b>                                                                 | <b>\$ 2 725 040</b>                                  | <b>\$ 75 215</b>                                  | <b>\$ 3 775 235</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 357 889                                                                        | \$ 2 754 376                                         | \$ 4 959                                          | \$ 3 117 224        |
| Fonds d'investissement                        | 167 557                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 167 557             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 3 800                                                | 0                                                 | 3 800               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 691                                                                               | 19 872                                               | 73                                                | 20 636              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                 | 177                                                  | 0                                                 | 177                 |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (8 571)                                              | 0                                                 | (8 571)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 526 137</b>                                                                 | <b>\$ 2 769 654</b>                                  | <b>\$ 5 032</b>                                   | <b>\$ 3 300 823</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 598                                                     | \$ (660)                | \$ (62)                           | \$ (13)                                                    | \$ 0                    | \$ (13)                           |
| BOA          | (309)                                                      | 260                     | (49)                              | 712                                                        | (580)                   | 132                               |
| BPS          | (14 152)                                                   | 15 030                  | 878                               | (358)                                                      | 300                     | (58)                              |
| BRC          | (64)                                                       | 30                      | (34)                              | 8 081                                                      | (8 920)                 | (839)                             |
| BSH          | (12 921)                                                   | 13 620                  | 699                               | 14                                                         | 10                      | 24                                |
| CBK          | (826)                                                      | 980                     | 154                               | 514                                                        | (700)                   | (186)                             |

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| DUB          | \$ (284)                                                   | \$ 260                  | \$ (24)                           | \$ (67)                                                    | \$ 0                    | \$ (67)                           |
| FAR          | 1 470                                                      | (1 690)                 | (220)                             | (3 200)                                                    | 3 740                   | 540                               |
| GLM          | 1 222                                                      | (1 180)                 | 42                                | (316)                                                      | 420                     | 104                               |
| GST          | 30                                                         | (80)                    | (50)                              | 158                                                        | (190)                   | (32)                              |
| IND          | 11                                                         | 0                       | 11                                | 141                                                        | 0                       | 141                               |
| JPM          | 1 565                                                      | 0                       | 1 565                             | 371                                                        | (40)                    | 331                               |
| MBC          | 129                                                        | 0                       | 129                               | 6 456                                                      | (7 070)                 | (614)                             |
| MEI          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 3                                                          | 0                       | 3                                 |
| MYC          | 28                                                         | 94                      | 122                               | 7                                                          | 94                      | 101                               |
| MYI          | 30                                                         | 20                      | 50                                | 234                                                        | (280)                   | (46)                              |
| NSL          | 13                                                         | 0                       | 13                                | 65                                                         | 0                       | 65                                |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 53                                                         | 0                       | 53                                |
| SAL          | 6                                                          | 0                       | 6                                 | 15                                                         | 0                       | 15                                |
| SCX          | (8)                                                        | 0                       | (8)                               | 20                                                         | 0                       | 20                                |
| SOG          | (8 375)                                                    | 8 620                   | 245                               | 3 750                                                      | (3 890)                 | (140)                             |
| SSB          | 1 427                                                      | (1 600)                 | (173)                             | 138                                                        | 0                       | 138                               |
| UAG          | (737)                                                      | 730                     | (7)                               | (112)                                                      | 0                       | (112)                             |
| WST          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 26,74            | 23,13                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 41,13            | 38,79                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,26             | 0,34                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,90             | 3,35                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 2,25             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,12             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,64             | 0,61                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,66             | 0,62                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,03             | 0,00                 |
| Autres actifs                                                    | 24,27            | 33,06                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,98             | 0,47                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 11,36            | 11,97                |
| Obligations et billets convertibles                                                                      | S/O              | 0,00                 |
| Obligations et billets municipaux                                                                        | S/O              | 0,00                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 42,29            | 44,75                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 7,48             | 7,89                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 9,55             | 12,13                |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 19,49            | 20,96                |
| Émissions souveraines                                                                                    | 7,15             | 5,31                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 24,28            | 23,92                |
| Bons de souscription                                                                                     | 0,00             | 0,00                 |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,31             | 0,34                 |
| Sociétés d'investissement immobilier                                                                     | 3,47             | 3,29                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,22             | 0,37                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 7,24             | 7,06                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 4,17             | 0,16                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,15             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,05             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,12             | 0,18                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,01                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,04             | 0,05                 |
| Swaps de rendement total sur titres                                                                      | 0,00             | S/O                  |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,34             | (0,36)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (1,51)           | 1,00                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,01             | 0,01                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (0,38)           | (0,36)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (36,81)          | (39,14)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund

| DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES              |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |      |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |      |
| Discovery Global Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | Capital One Financial Corp.                                 |                                     |                                  |                           | 3,615 % éch. 15/03/2028 |                                     |                                  |                           |      |
| TBD % éch. 03/06/2033           | €                                   | 1 400                            | \$ 1 605                  | 0,04                                                        | 5,700 % éch. 01/02/2030             | \$ 2 300                         | \$ 2 348                  | 0,06                    | 4,692 % éch. 23/10/2030             | \$ 8 600                         | \$ 8 561                  | 0,20 |
| TBD % éch. 03/06/2033           |                                     |                                  |                           | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan |                                     |                                  |                           | Golub Capital BDC, Inc. |                                     |                                  |                           |      |
| FPS Finance Co. LLC             |                                     |                                  |                           |                                                             | European Core Fund                  | € 13 300                         | 14 603                    | 0,35                    | 7,050 % éch. 05/12/2028             | 5 800                            | 5 959                     | 0,14 |
| 6,590 % éch. 26/05/2028         |                                     | 900                              | 900                       | 0,02                                                        | 0,500 % éch. 27/01/2028             | 7 600                            | 8 030                     | 0,19                    | 3,875 % éch. 29/04/2033             | € 3 800                          | 4 350                     | 0,10 |
| Project Dorchester              |                                     |                                  |                           | CIF Capital Markets Mechanism PLC                           |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 03/05/2030 |                                     |                                  |                           |      |
| 4,610 % éch. 04/01/2027 (i)     | €                                   | 1 800                            | 2 058                     | 0,05                                                        | 4,750 % éch. 22/01/2028             | \$ 3 000                         | 3 019                     | 0,07                    | GSG Bidco Ltd.                      |                                  |                           |      |
| Project Fenno                   |                                     |                                  |                           | Citibank N.A.                                               |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/06/2031 |                                     |                                  |                           |      |
| 0,600 % éch. 10/07/2028 µ(i)    |                                     | 706                              | 809                       | 0,02                                                        | 5,803 % éch. 29/09/2028             | 2 800                            | 2 881                     | 0,07                    | GSPA Monetization Trust             | \$ 6 010                         | 6 018                     | 0,14 |
| 4,641 % éch. 10/07/2028 (i)     |                                     | 1 356                            | 1 562                     | 0,04                                                        | Citigroup, Inc.                     | 6 600                            | 6 538                     | 0,15                    | 6,422 % éch. 09/10/2029             |                                  |                           |      |
| 4,680 % éch. 10/07/2028 (i)     |                                     | 644                              | 742                       | 0,01                                                        | 3,070 % éch. 24/02/2028             | 8 700                            | 8 794                     | 0,21                    | GTA Finance Co. Pty. Ltd.           |                                  |                           |      |
| Stepstone Group Midco GmbH      |                                     |                                  |                           | Citycon Treasury BV                                         |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 04/12/2029 |                                     |                                  |                           |      |
| 6,885 % éch. 26/04/2032         |                                     | 2 568                            | 2 410                     | 0,06                                                        | 1,625 % éch. 12/03/2028             | € 15 000                         | 16 241                    | 0,38                    | HAT Holdings LLC                    | \$ 2 150                         | 2 009                     | 0,05 |
| Virgin Media Bristol LLC        |                                     |                                  |                           | Clifford Capital Credit Solutions Pte. Ltd.                 |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC       |                                     |                                  |                           |      |
| 6,967 % éch. 31/03/2031         | \$                                  | 1 000                            | 890                       | 0,02                                                        | 4,781 % éch. 14/01/2030             | \$ 900                           | 915                       | 0,02                    | 5,130 % éch. 03/03/2031             | 2 400                            | 2 415                     | 0,06 |
|                                 |                                     |                                  | 16 378                    | 0,39                                                        | Cooperative Rabobank UA             |                                  |                           |                         | 5,290 % éch. 16/09/2032             |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,655 % éch. 22/08/2028                                     |                                     |                                  |                           | 10 500                  |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,447 % éch. 05/03/2030                                     |                                     |                                  |                           | 8 400                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Cousins Properties LP                                       |                                     |                                  |                           | 1 200                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/07/2030                                     |                                     |                                  |                           | 1 213                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | CPI Property Group S.A.                                     |                                     |                                  |                           | 1 210                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 14/01/2030 (j)                                 |                                     |                                  |                           | € 6 100                 |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 22/01/2028                                     |                                     |                                  |                           | € 400                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole S.A.                                        |                                     |                                  |                           | 3 300                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,848 % éch. 11/09/2028                                     |                                     |                                  |                           | \$ 3 320                |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6,316 % éch. 03/10/2029                                     |                                     |                                  |                           | 7 500                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Crown Castle, Inc.                                          |                                     |                                  |                           | 5 000                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 01/09/2028                                     |                                     |                                  |                           | 5 015                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | CTP NV                                                      |                                     |                                  |                           | 4 806                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,500 % éch. 27/09/2031                                     |                                     |                                  |                           | € 4 700                 |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Danske Bank A/S                                             |                                     |                                  |                           | € 5 000                 |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 23/08/2028                                     |                                     |                                  |                           | € 5 000                 |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Deutsche Bank AG                                            |                                     |                                  |                           | € 19 300                |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 19/11/2030                                     |                                     |                                  |                           | 20 895                  |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 23/02/2028                                     |                                     |                                  |                           | 3 600                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 05/09/2030                                     |                                     |                                  |                           | 1 600                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Digital Dutch Finco BV                                      |                                     |                                  |                           | 1 000                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,000 % éch. 15/01/2032                                     |                                     |                                  |                           | 991                     |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank,            |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Frankfort-sur-le-Main                                       |                                     |                                  |                           |                         |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,879 % éch. 16/11/2026                                     |                                     |                                  |                           | 5 600                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | EPR Properties                                              |                                     |                                  |                           | 6 412                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/11/2030                                     |                                     |                                  |                           | \$ 2 600                |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | EQT AB                                                      |                                     |                                  |                           | 2 545                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,375 % éch. 06/04/2028                                     |                                     |                                  |                           | € 10 000                |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 06/04/2032                                     |                                     |                                  |                           | 7 400                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Equinix Europe Financing Corp. LLC                          |                                     |                                  |                           | 8 089                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 15/11/2030                                     |                                     |                                  |                           | \$ 5 300                |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Equitable Financial Life Global Funding                     |                                     |                                  |                           | 5 240                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,450 % éch. 03/03/2028                                     |                                     |                                  |                           | 4 900                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Fédération des Caisses Desjardins du Québec                 |                                     |                                  |                           | 4 953                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,700 % éch. 14/03/2028                                     |                                     |                                  |                           | 6 600                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | First Abu Dhabi Bank PJSC                                   |                                     |                                  |                           | 6 728                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,789 % éch. 03/06/2031                                     |                                     |                                  |                           | 3 800                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 28/02/2029                                     |                                     |                                  |                           | 5 000                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Ford Motor Credit Co. LLC                                   |                                     |                                  |                           | 3 799                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,970 % éch. 06/04/2029                                     |                                     |                                  |                           | 5 024                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 05/03/2027                                     |                                     |                                  |                           | 10 500                  |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,918 % éch. 20/03/2028                                     |                                     |                                  |                           | 7 200                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 7,350 % éch. 04/11/2027                                     |                                     |                                  |                           | 1 200                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Gaci First Investment Co.                                   |                                     |                                  |                           | 1 215                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 14/02/2053                                     |                                     |                                  |                           | 1 028                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 29/01/2030                                     |                                     |                                  |                           | 9 600                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Generall                                                    |                                     |                                  |                           | 8 287                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,429 % éch. 14/07/2031                                     |                                     |                                  |                           | 5 048                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Globalworth Real Estate Investments Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 1 967                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/03/2030                                     |                                     |                                  |                           | 3 184                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | GLP Capital LP                                              |                                     |                                  |                           | 3 718                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/01/2030                                     |                                     |                                  |                           | \$ 2 600                |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/01/2029                                     |                                     |                                  |                           | 2 000                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                                   |                                     |                                  |                           | 2 501                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 1,948 % éch. 21/10/2027                                     |                                     |                                  |                           | 2 011                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 2,743 % éch. 17/02/2029                                     |                                     |                                  |                           | 4 366                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           | 3,509 % éch. 17/08/2033                                     |                                     |                                  |                           | 2 800                   |                                     |                                  |                           |      |
|                                 |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 4 000                   |                                     |                                  |                           |      |



| DESCRIPTION                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Morgan Stanley Private Bank N.A.<br>4,204 % éch. 17/11/2028                   | \$ 4 800                            | \$ 4 776                         | 0,11                      | UBS Group AG<br>3,869 % éch. 12/01/2029                         | \$ 12 000                           | \$ 11 864                        | 0,28                      | Choice Hotels International, Inc.<br>3,700 % éch. 01/12/2029       | \$ 1 500                            | \$ 1 440                         | 0,03                      |
| 4,213 % éch. 08/02/2030                                                       | 7 800                               | 7 699                            | 0,18                      | 4,125 % éch. 09/06/2033                                         | € 8 300                             | 9 781                            | 0,23                      | Coastal Gaslink Pipeline LP<br>4,691 % éch. 30/09/2029             | CAD 800                             | 586                              | 0,01                      |
| Mwof Finance Co. Pty. Ltd.<br>6,041 % éch. 06/05/2031                         | AUD 2 700                           | 1 913                            | 0,05                      | 5,125 % éch. 29/07/2026 (f)(h)                                  | \$ 1 300                            | 1 301                            | 0,03                      | 5,907 % éch. 30/06/2031                                            | 800                                 | 596                              | 0,01                      |
| 6,317 % éch. 06/05/2033                                                       | 2 800                               | 1 995                            | 0,05                      | 7,000 % éch. 30/09/2027                                         | £ 8 800                             | 11 750                           | 0,28                      | 5,395 % éch. 30/09/2036                                            | 2 000                               | 1 534                            | 0,04                      |
| Nationwide Building Society<br>5,167 % éch. 12/12/2033                        | £ 3 100                             | 4 074                            | 0,10                      | 2,200 % éch. 22/07/2027                                         | € 5 450                             | 6 232                            | 0,15                      | 5,538 % éch. 30/06/2039                                            | 2 400                               | 1 854                            | 0,04                      |
| 6,557 % éch. 18/10/2027                                                       | \$ 8 200                            | 8 247                            | 0,20                      | Volkswagen Financial Services AG<br>3,131 % éch. 10/06/2027     | 1 800                               | 2 063                            | 0,05                      | 5,606 % éch. 30/09/2042                                            | 1 700                               | 1 300                            | 0,03                      |
| NatWest Group PLC<br>3,375 % éch. 14/07/2027                                  | € 10 000                            | 10 733                           | 0,25                      | 3,750 % éch. 10/09/2026                                         | 3 000                               | 3 436                            | 0,08                      | 5,607 % éch. 30/03/2047                                            | 1 700                               | 1 303                            | 0,03                      |
| 3,575 % éch. 12/09/2032                                                       | 2 900                               | 3 343                            | 0,08                      | 3,875 % éch. 10/09/2030                                         | 800                                 | 927                              | 0,02                      | 5,857 % éch. 30/06/2044                                            | 1 700                               | 1 301                            | 0,03                      |
| NatWest Markets PLC<br>5,786 % éch. 05/06/2030                                | AUD 12 800                          | 8 988                            | 0,21                      | Volkswagen Leasing GmbH<br>3,625 % éch. 11/10/2026              | 4 600                               | 5 272                            | 0,12                      | 5,857 % éch. 30/03/2049 (i)                                        | 1 400                               | 1 100                            | 0,03                      |
| 6,171 % éch. 23/08/2028                                                       | 4 000                               | 2 826                            | 0,07                      | Wells Fargo & Co.<br>3,000 % éch. 23/10/2026                    | \$ 2 550                            | 2 540                            | 0,06                      | Constellation Brands, Inc.<br>4,800 % éch. 15/01/2029              | \$ 6 950                            | 6 972                            | 0,16                      |
| NE Property BV<br>1,875 % éch. 09/10/2026                                     | € 2 907                             | 3 314                            | 0,08                      | 3,584 % éch. 22/05/2028                                         | 1 600                               | 1 587                            | 0,04                      | CVS Health Corp.<br>5,000 % éch. 30/01/2029                        | 6 000                               | 6 055                            | 0,14                      |
| 3,375 % éch. 14/07/2027                                                       | 1 586                               | 1 811                            | 0,04                      | 4,700 % éch. 22/04/2028                                         | 1 200                               | 1 205                            | 0,03                      | Daimler Truck Finance North America LLC<br>5,000 % éch. 06/11/2030 | 3 000                               | 3 011                            | 0,07                      |
| 3,875 % éch. 30/09/2033                                                       | 1 300                               | 1 474                            | 0,03                      | 4,808 % éch. 25/07/2028                                         | 9 600                               | 9 627                            | 0,23                      | Delta Air Lines Pass-Through Trust<br>2,000 % éch. 10/12/2029      | 2 373                               | 2 292                            | 0,05                      |
| New Immo Holding S.A.<br>5,500 % éch. 23/04/2031                              | 4 600                               | 5 284                            | 0,13                      | 5,707 % éch. 22/04/2028                                         | 2 600                               | 2 624                            | 0,06                      | DSV Finance BV<br>3,125 % éch. 06/11/2028                          | € 1 700                             | 1 949                            | 0,05                      |
| Nexi SpA<br>3,875 % éch. 21/05/2031 (j)                                       | 2 200                               | 2 557                            | 0,06                      | 6,303 % éch. 23/10/2029                                         | 8 100                               | 8 380                            | 0,20                      | 3,250 % éch. 06/11/2030                                            | 3 200                               | 3 662                            | 0,09                      |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>5,300 % éch. 13/09/2027                    | \$ 7 400                            | 7 377                            | 0,17                      | Workspace Group PLC<br>2,250 % éch. 11/03/2028                  | £ 7 600                             | 9 599                            | 0,23                      | 3,375 % éch. 06/11/2032                                            | 2 900                               | 3 306                            | 0,08                      |
| Nomura Holdings, Inc.<br>2,172 % éch. 14/07/2028                              | 800                                 | 760                              | 0,02                      | Yorkshire Building Society<br>3,511 % éch. 11/10/2030           | 2 400                               | 3 053                            | 0,07                      | Emory University<br>2,143 % éch. 01/09/2030                        | \$ 10 400                           | 9 438                            | 0,22                      |
| 2,679 % éch. 16/07/2030                                                       | 7 300                               | 6 693                            | 0,16                      | <b>INDUSTRIE</b>                                                |                                     |                                  |                           | Energy Transfer LP<br>6,050 % éch. 01/12/2026                      | 4 100                               | 4 127                            | 0,10                      |
| 5,842 % éch. 18/01/2028                                                       | 7 500                               | 7 634                            | 0,18                      | Abu Dhabi National Energy Co. PJSC<br>4,375 % éch. 09/10/2031   | \$ 7 000                            | 6 825                            | 0,16                      | Entergy Louisiana LLC<br>2,350 % éch. 15/06/2032                   | 14 000                              | 12 275                           | 0,29                      |
| Nykredit Realkredit A/S<br>3,750 % éch. 26/09/2033                            | € 4 850                             | 5 533                            | 0,13                      | Adnoc Murban Rsc Ltd.<br>4,250 % éch. 11/09/2029                | 4 300                               | 4 239                            | 0,10                      | Equifax, Inc.<br>4,800 % éch. 15/09/2029                           | 5 000                               | 5 008                            | 0,12                      |
| Pacific Life Global Funding<br>5,500 % éch. 18/07/2028                        | \$ 6 000                            | 6 106                            | 0,14                      | Air Canada Pass-Through Trust<br>3,600 % éch. 15/09/2028        | 351                                 | 348                              | 0,01                      | 5,100 % éch. 15/12/2027                                            | 7 800                               | 7 854                            | 0,19                      |
| 5,592 % éch. 22/04/2031                                                       | AUD 4 400                           | 3 094                            | 0,07                      | Amdocs Ltd.<br>2,538 % éch. 15/06/2030                          | 5 800                               | 5 232                            | 0,12                      | Expedia Group, Inc.<br>3,800 % éch. 15/02/2028                     | 3 490                               | 3 447                            | 0,08                      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC<br>0,000 % éch. 05/04/2032 (c) | \$ 3 300                            | 2 688                            | 0,06                      | American Airlines Pass-Through Trust<br>5,250 % éch. 10/05/2040 | 1 900                               | 1 891                            | 0,04                      | Givaudan Finance Europe BV<br>2,875 % éch. 09/09/2029              | € 3 000                             | 3 400                            | 0,08                      |
| Prologis International Funding S.A.<br>1,625 % éch. 17/06/2032                | € 1 000                             | 1 028                            | 0,02                      | Amprion GmbH<br>2,750 % éch. 30/09/2029                         | € 2 400                             | 2 708                            | 0,06                      | Global Payments, Inc.<br>4,950 % éch. 15/08/2027                   | \$ 4 700                            | 4 710                            | 0,11                      |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                   | \$ 11 000                           | 10 997                           | 0,26                      | 3,000 % éch. 05/12/2029                                         | 4 600                               | 5 231                            | 0,12                      | Gray Oak Pipeline LLC<br>3,450 % éch. 15/10/2027                   | 9 300                               | 9 135                            | 0,22                      |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                                                       | 3 000                               | 3 015                            | 0,07                      | Amrize Finance U.S. LLC<br>4,700 % éch. 07/04/2028              | \$ 3 000                            | 3 005                            | 0,07                      | Greensaf Pipelines Bidco SARL<br>5,853 % éch. 23/02/2036           | 3 700                               | 3 780                            | 0,09                      |
| RBC International<br>4,660 % éch. 16/12/2028 (i)                              | 5 000                               | 4 918                            | 0,12                      | 4,950 % éch. 07/04/2030                                         | 4 900                               | 4 934                            | 0,12                      | GSG Bidco Ltd.<br>5,375 % éch. 15/06/2036                          | € 4 300                             | 4 880                            | 0,12                      |
| Royal Bank of Canada<br>4,400 % éch. 17/04/2030                               | 4 700                               | 4 662                            | 0,11                      | ams-OSRAM AG<br>10,500 % éch. 30/03/2029                        | € 2 476                             | 3 019                            | 0,07                      | HCA, Inc.<br>3,125 % éch. 15/03/2027                               | \$ 4 200                            | 4 162                            | 0,10                      |
| 4,900 % éch. 12/01/2028                                                       | 4 100                               | 4 130                            | 0,10                      | Aurizon Network Pty. Ltd.<br>6,200 % éch. 05/12/2033            | AUD 3 000                           | 2 109                            | 0,05                      | Hyundai Capital America<br>4,600 % éch. 06/04/2028                 | 3 600                               | 3 595                            | 0,08                      |
| Sagax AB<br>1,125 % éch. 30/01/2027                                           | € 9 000                             | 10 187                           | 0,24                      | Babcock International Group PLC<br>1,375 % éch. 13/09/2027      | € 2 700                             | 3 036                            | 0,07                      | 4,850 % éch. 25/03/2027                                            | 5 900                               | 5 919                            | 0,14                      |
| Santander UK Group Holdings PLC<br>2,421 % éch. 17/01/2029                    | £ 800                               | 1 024                            | 0,02                      | Barry Callebaut Services NV<br>3,750 % éch. 19/02/2028          | 900                                 | 1 037                            | 0,02                      | 5,250 % éch. 08/01/2027                                            | 6 000                               | 6 025                            | 0,14                      |
| 4,858 % éch. 11/09/2030                                                       | \$ 6 250                            | 6 246                            | 0,15                      | Bayer U.S. Finance LLC<br>4,375 % éch. 15/12/2028               | \$ 6 244                            | 6 178                            | 0,15                      | 5,950 % éch. 21/09/2026                                            | 3 600                               | 3 612                            | 0,09                      |
| 7,482 % éch. 29/08/2029                                                       | £ 1 500                             | 2 092                            | 0,05                      | 6,250 % éch. 21/01/2029                                         | 1 200                               | 1 239                            | 0,03                      | 6,500 % éch. 16/01/2029                                            | 1 100                               | 1 142                            | 0,03                      |
| Sirius Real Estate Ltd.<br>4,000 % éch. 22/01/2032                            | € 500                               | 568                              | 0,01                      | 6,375 % éch. 21/11/2030                                         | 6 900                               | 7 264                            | 0,17                      | IHG Finance LLC<br>3,375 % éch. 10/09/2030                         | € 7 700                             | 8 758                            | 0,21                      |
| Société Générale S.A.<br>6,446 % éch. 10/01/2029                              | \$ 700                              | 717                              | 0,02                      | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                 | 41 990                              | 42 857                           | 1,01                      | Imperial Brands Finance PLC<br>3,875 % éch. 02/08/2033             | 5 800                               | 6 577                            | 0,16                      |
| Standard Chartered PLC<br>0,800 % éch. 17/11/2029                             | € 3 600                             | 3 899                            | 0,09                      | BMW U.S. Capital LLC<br>4,750 % éch. 21/03/2028                 | 8 300                               | 8 331                            | 0,20                      | 6,125 % éch. 27/07/2027                                            | \$ 5 000                            | 5 078                            | 0,12                      |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>4,375 % éch. 15/01/2027                      | \$ 800                              | 800                              | 0,02                      | Boeing Co.<br>3,450 % éch. 01/11/2028                           | 4 200                               | 4 090                            | 0,10                      | Intel Corp.<br>5,125 % éch. 10/02/2030                             | 6 900                               | 6 985                            | 0,17                      |
| Stellantis Finance U.S., Inc.<br>5,350 % éch. 17/03/2028                      | 4 600                               | 4 614                            | 0,11                      | Broadcom, Inc.<br>4,150 % éch. 15/11/2030                       | 2 173                               | 2 128                            | 0,05                      | JSW Hydro Energy Ltd.<br>4,125 % éch. 18/05/2031                   | 1 829                               | 1 696                            | 0,04                      |
| Stellantis Financial Services U.S. Corp.<br>5,400 % éch. 15/06/2029           | 5 300                               | 5 282                            | 0,13                      | 4,300 % éch. 15/11/2032                                         | 4 800                               | 4 651                            | 0,11                      | Lonsdale Finance Pty. Ltd.<br>5,500 % éch. 19/11/2031              | AUD 2 800                           | 1 941                            | 0,05                      |
| Stifel Financial Corp.<br>4,000 % éch. 15/05/2030                             | 12 900                              | 12 478                           | 0,30                      | Burberry Group PLC<br>5,750 % éch. 20/06/2030                   | £ 10 000                            | 13 402                           | 0,32                      | Marriott International, Inc.<br>5,550 % éch. 15/10/2028            | \$ 6 900                            | 7 039                            | 0,17                      |
| Stockland Trust<br>5,420 % éch. 25/03/2032                                    | AUD 3 200                           | 2 195                            | 0,05                      | Centene Corp.<br>4,625 % éch. 15/12/2029                        | \$ 11 151                           | 10 823                           | 0,26                      | Mars, Inc.<br>4,800 % éch. 01/03/2030                              | 8 100                               | 8 126                            | 0,19                      |
| Sumisho Air Lease Corp.<br>4,500 % éch. 24/03/2029                            | \$ 4 600                            | 4 562                            | 0,11                      | CenterPoint Energy Resources Corp.<br>5,250 % éch. 01/03/2028   | 4 600                               | 4 662                            | 0,11                      | Mercedes-Benz Finance North America LLC<br>4,800 % éch. 30/03/2028 | 9 300                               | 9 328                            | 0,22                      |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>1,902 % éch. 17/09/2028              | 2 500                               | 2 359                            | 0,06                      | Chanel Ceres PLC<br>0,500 % éch. 31/07/2026                     | € 10 400                            | 11 866                           | 0,28                      | Motorola Solutions, Inc.<br>2,300 % éch. 15/11/2030                | 12 400                              | 11 189                           | 0,26                      |
| 4,804 % éch. 09/07/2029                                                       | 8 600                               | 8 686                            | 0,21                      | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC<br>5,125 % éch. 30/06/2027 | 4 600                               | 4 612                            | 0,11                      | Mundys SpA<br>1,875 % éch. 12/02/2028                              | € 16 463                            | 18 446                           | 0,44                      |
| 5,520 % éch. 13/01/2028                                                       | 4 700                               | 4 770                            | 0,11                      |                                                                 |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 29/09/2031                                            | 2 500                               | 2 816                            | 0,07                      |
| TP ICAP Finance PLC<br>7,875 % éch. 17/04/2030                                | £ 9 800                             | 13 963                           | 0,33                      |                                                                 |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Co. Ltd.<br>4,345 % éch. 17/09/2027                   | \$ 2 500                            | 2 461                            | 0,06                      |

## Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                                             | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)     | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                      | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |        |      |  |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-----------------------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------|--------|------|--|
| NSW Ports Finance Co. Pty. Ltd.<br>5,432 % éch. 19/09/2034         | AUD                                 | 2 400                            | \$ 1 619                  | 0,04        | 4,750 % éch. 30/04/2033                                                                         | \$ 1 400                         | \$ 1 370                  | 0,03        | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN       |                                                       |                           |        |      |  |
| NTT Finance Corp.<br>4,620 % éch. 16/07/2028                       | \$                                  | 1 276                            | 1 273                     | 0,03        | Avangrid, Inc.<br>3,800 % éch. 01/06/2029                                                       | 2 615                            | 2 547                     | 0,06        | Fannie Mae<br>3,787 % éch. 25/12/2036   | \$ 24                                                 | \$ 24                     | 0,00   |      |  |
| 4,828 % éch. 01/11/2029 (b)                                        |                                     | 5 400                            | 5 398                     | 0,13        | Constellation Energy Generation LLC<br>5,600 % éch. 01/03/2028                                  | 6 100                            | 6 197                     | 0,15        | 3,847 % éch. 25/03/2034                 | 1                                                     | 1                         | 0,00   |      |  |
| 5,012 % éch. 01/11/2031 (b)                                        |                                     | 6 300                            | 6 293                     | 0,15        | Edison International<br>5,000 % éch. 05/05/2028                                                 | 8 200                            | 8 212                     | 0,19        | 3,913 % éch. 25/07/2037                 | 105                                                   | 103                       | 0,00   |      |  |
| Oracle Corp.<br>4,500 % éch. 06/05/2028                            |                                     | 4 400                            | 4 373                     | 0,10        | 5,450 % éch. 15/06/2029                                                                         | 4 100                            | 4 142                     | 0,10        | 3,975 % éch. 25/06/2034                 | 76                                                    | 75                        | 0,00   |      |  |
| 4,650 % éch. 06/05/2030                                            |                                     | 4 400                            | 4 316                     | 0,10        | 6,250 % éch. 15/03/2030                                                                         | 6 800                            | 6 990                     | 0,16        | 4,077 % éch. 25/09/2042                 | 265                                                   | 265                       | 0,01   |      |  |
| Qantas Airways Ltd.<br>5,900 % éch. 19/09/2034                     | AUD                                 | 1 000                            | 683                       | 0,02        | EDP Finance BV<br>1,710 % éch. 24/01/2028                                                       | 12 700                           | 12 166                    | 0,29        | 4,292 % éch. 25/09/2041                 | 817                                                   | 816                       | 0,02   |      |  |
| QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                             | \$                                  | 2 690                            | 2 674                     | 0,06        | EDP Servicios Financieros Espana S.A.<br>3,500 % éch. 16/07/2030                                | € 2 400                          | 2 772                     | 0,07        | 5,300 % éch. 01/11/2029                 | 1 400                                                 | 1 388                     | 0,03   |      |  |
| QPH Finance Co. Pty. Ltd.<br>5,695 % éch. 05/03/2035               | AUD                                 | 2 000                            | 1 360                     | 0,03        | ENEL Finance International NV<br>0,625 % éch. 28/05/2029                                        | € 10 000                         | 12 612                    | 0,30        | 4,642 % éch. 25/04/2032                 | 1                                                     | 1                         | 0,00   |      |  |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045          | \$                                  | 24 850                           | 24 782                    | 0,59        | 2,875 % éch. 11/04/2029                                                                         | € 1 300                          | 1 517                     | 0,04        | 4,658 % éch. 25/12/2042                 | 36                                                    | 36                        | 0,00   |      |  |
| Rogers Communications, Inc.<br>3,650 % éch. 31/03/2027             | CAD                                 | 1 700                            | 1 203                     | 0,03        | EPH Financing International A/S<br>4,625 % éch. 02/07/2032                                      | € 1 300                          | 1 517                     | 0,04        | 4,728 % éch. 25/10/2055                 | 3 173                                                 | 3 190                     | 0,08   |      |  |
| Salesforce, Inc.<br>4,500 % éch. 15/03/2028                        | \$                                  | 5 050                            | 5 045                     | 0,12        | Exelon Corp.<br>5,150 % éch. 15/03/2028                                                         | \$ 4 660                         | 4 705                     | 0,11        | 4,967 % éch. 01/10/2044                 | 7                                                     | 7                         | 0,00   |      |  |
| 4,650 % éch. 15/03/2029                                            |                                     | 5 050                            | 5 048                     | 0,12        | Florida Power & Light Co.<br>5,050 % éch. 01/04/2028                                            | 3 200                            | 3 237                     | 0,08        | 5,000 % éch. 25/04/2033 -<br>25/06/2043 | 74                                                    | 73                        | 0,00   |      |  |
| Sandoz Finance BV<br>3,250 % éch. 12/09/2029                       | €                                   | 1 900                            | 2 176                     | 0,05        | Georgia Power Co.<br>4,600 % éch. 15/06/2029                                                    | 5 900                            | 5 911                     | 0,14        | 5,167 % éch. 01/10/2040                 | 4                                                     | 4                         | 0,00   |      |  |
| 4,220 % éch. 17/04/2030                                            |                                     | 1 800                            | 2 124                     | 0,05        | Iberdrola Finanzas S.A.<br>5,380 % éch. 28/11/2030                                              | AUD 5 000                        | 3 459                     | 0,08        | 5,178 % éch. 01/09/2034                 | 40                                                    | 40                        | 0,00   |      |  |
| Saudi Arabian Oil Co.<br>4,375 % éch. 02/02/2031                   | \$                                  | 4 500                            | 4 402                     | 0,10        | 5,870 % éch. 28/11/2034                                                                         | 800                              | 553                       | 0,01        | 5,538 % éch. 01/09/2035                 | 19                                                    | 19                        | 0,00   |      |  |
| SoftBank Group Corp.<br>7,625 % éch. 22/10/2029                    |                                     | 3 000                            | 3 083                     | 0,07        | National Grid North America, Inc.<br>3,631 % éch. 03/09/2031                                    | € 5 600                          | 6 468                     | 0,15        | 5,561 % éch. 01/12/2034                 | 19                                                    | 19                        | 0,00   |      |  |
| 8,250 % éch. 22/10/2031                                            |                                     | 1 500                            | 1 549                     | 0,04        | National Grid PLC<br>5,602 % éch. 12/06/2028                                                    | \$ 3 100                         | 3 156                     | 0,07        | 5,595 % éch. 01/07/2035                 | 9                                                     | 9                         | 0,00   |      |  |
| T-Mobile USA, Inc.<br>2,050 % éch. 15/02/2028                      |                                     | 2 000                            | 1 922                     | 0,05        | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>2,200 % éch. 02/12/2026                                | AUD 2 000                        | 1 371                     | 0,03        | 5,781 % éch. 01/04/2033                 | 2                                                     | 2                         | 0,00   |      |  |
| 4,200 % éch. 01/10/2029                                            |                                     | 4 000                            | 3 952                     | 0,09        | 4,900 % éch. 28/02/2028                                                                         | \$ 7 600                         | 7 642                     | 0,18        | 5,858 % éch. 01/07/2035                 | 2                                                     | 2                         | 0,00   |      |  |
| 4,800 % éch. 15/07/2028                                            |                                     | 3 600                            | 3 615                     | 0,09        | 6,051 % éch. 15/06/2067                                                                         | 791                              | 735                       | 0,02        | 5,893 % éch. 01/01/2036                 | 7                                                     | 7                         | 0,00   |      |  |
| 4,850 % éch. 15/01/2029                                            |                                     | 3 575                            | 3 597                     | 0,09        | Oncor Electric Delivery Co. LLC<br>4,300 % éch. 15/05/2028                                      | 4 600                            | 4 587                     | 0,11        | 5,894 % éch. 01/03/2036                 | 4                                                     | 4                         | 0,00   |      |  |
| Tornator Oyj<br>1,250 % éch. 14/10/2026                            | €                                   | 5 600                            | 6 374                     | 0,15        | ONEOK, Inc.<br>5,375 % éch. 01/06/2029                                                          | 1 700                            | 1 728                     | 0,04        | 5,900 % éch. 25/07/2042                 | 22                                                    | 22                        | 0,00   |      |  |
| Toyota Finance Australia Ltd.<br>3,386 % éch. 18/03/2030           |                                     | 500                              | 575                       | 0,01        | Pacific Gas & Electric Co.<br>2,100 % éch. 01/08/2027                                           | 3 200                            | 3 117                     | 0,07        | 5,927 % éch. 01/11/2035                 | 22                                                    | 23                        | 0,00   |      |  |
| Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.<br>6,350 % éch. 02/05/2030 | AUD                                 | 1 500                            | 1 070                     | 0,03        | 3,300 % éch. 15/03/2027                                                                         | 2 800                            | 2 776                     | 0,07        | 5,998 % éch. 01/03/2036                 | 7                                                     | 7                         | 0,00   |      |  |
| United Airlines Pass-Through Trust<br>2,700 % éch. 01/11/2033      | \$                                  | 879                              | 802                       | 0,02        | 3,300 % éch. 01/12/2027                                                                         | 4 800                            | 4 711                     | 0,11        | 6,039 % éch. 25/05/2035                 | 12                                                    | 12                        | 0,00   |      |  |
| 2,875 % éch. 07/04/2030                                            |                                     | 2 556                            | 2 462                     | 0,06        | 4,650 % éch. 01/08/2028                                                                         | 2 400                            | 2 394                     | 0,06        | 6,215 % éch. 01/09/2039                 | 6                                                     | 7                         | 0,00   |      |  |
| 3,450 % éch. 01/06/2029                                            |                                     | 2 906                            | 2 851                     | 0,07        | 5,000 % éch. 04/06/2028                                                                         | 4 900                            | 4 928                     | 0,12        | 6,224 % éch. 01/05/2038                 | 1 364                                                 | 1 415                     | 0,03   |      |  |
| 5,800 % éch. 15/07/2037                                            |                                     | 3 643                            | 3 792                     | 0,09        | 5,450 % éch. 15/06/2027                                                                         | 4 000                            | 4 031                     | 0,09        | 6,225 % éch. 01/11/2034 -<br>01/06/2035 | 151                                                   | 155                       | 0,00   |      |  |
| Universal Music Group NV<br>3,750 % éch. 30/06/2032                | €                                   | 7 800                            | 9 042                     | 0,21        | 6,000 % éch. 15/08/2035                                                                         | 2 100                            | 2 166                     | 0,05        | 6,290 % éch. 01/09/2035                 | 4                                                     | 4                         | 0,00   |      |  |
| 4,000 % éch. 13/06/2031                                            |                                     | 3 700                            | 4 353                     | 0,10        | PacifiCorp<br>5,100 % éch. 15/04/2031                                                           | 2 000                            | 2 019                     | 0,05        | 6,325 % éch. 01/09/2034                 | 7                                                     | 7                         | 0,00   |      |  |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,250 % éch. 15/01/2030       | \$                                  | 10 500                           | 10 759                    | 0,25        | 5,300 % éch. 15/02/2031                                                                         | 8 800                            | 8 936                     | 0,21        | 6,328 % éch. 01/05/2037                 | 18                                                    | 19                        | 0,00   |      |  |
| Venture Global LNG, Inc.<br>8,375 % éch. 01/06/2031                |                                     | 3 450                            | 3 593                     | 0,09        | Sempra<br>4,313 % éch. 07/01/2028                                                               | 9 800                            | 9 846                     | 0,23        | 6,422 % éch. 01/09/2035                 | 3                                                     | 3                         | 0,00   |      |  |
| 9,500 % éch. 01/02/2029                                            |                                     | 3 400                            | 3 661                     | 0,09        | Southern California Edison Co.<br>5,250 % éch. 15/03/2030                                       | 3 400                            | 3 439                     | 0,08        | 6,422 % éch. 01/09/2035                 | 3                                                     | 3                         | 0,00   |      |  |
| Virgin Media Secured Finance PLC<br>4,500 % éch. 15/08/2030        |                                     | 200                              | 170                       | 0,00        | Southwest Gas Corp.<br>5,450 % éch. 23/03/2028                                                  | 5 900                            | 5 979                     | 0,14        | 6,494 % éch. 25/10/2044 -<br>25/02/2045 | 43                                                    | 42                        | 0,00   |      |  |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>4,750 % éch. 15/07/2031                |                                     | 200                              | 165                       | 0,00        | SW Finance PLC<br>6,875 % éch. 07/08/2032                                                       | € 1 800                          | 2 407                     | 0,06        | 5,144 % éch. 25/07/2044                 | 69                                                    | 68                        | 0,00   |      |  |
| 5,625 % éch. 15/04/2032                                            | €                                   | 1 600                            | 1 612                     | 0,04        | 6,875 % éch. 14/11/2034                                                                         | 4 400                            | 5 846                     | 0,14        | 5,500 % éch. 01/06/2035 -<br>01/06/2039 | 1 172                                                 | 1 196                     | 0,03   |      |  |
| 6,250 % éch. 15/01/2033                                            | \$                                  | 200                              | 170                       | 0,00        | 7,750 % éch. 31/10/2031                                                                         | 9 400                            | 12 955                    | 0,31        | 5,869 % éch. 01/09/2028                 | 0                                                     | 0                         | 0,00   |      |  |
| 7,750 % éch. 15/04/2032                                            |                                     | 1 200                            | 1 085                     | 0,03        | TDC Net A/S<br>5,000 % éch. 09/08/2032                                                          | € 6 100                          | 7 240                     | 0,17        | 6,000 % éch. 01/10/2027 -<br>01/05/2040 | 2 699                                                 | 2 825                     | 0,07   |      |  |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>4,750 % éch. 13/11/2028 |                                     | 3 000                            | 2 992                     | 0,07        | 6,500 % éch. 01/06/2031                                                                         | 4 900                            | 6 174                     | 0,15        | 6,080 % éch. 01/09/2035                 | 13                                                    | 13                        | 0,00   |      |  |
| Yorkshire Water Finance PLC<br>6,375 % éch. 18/11/2034             | £                                   | 1 000                            | 1 359                     | 0,03        | WEC Energy Group, Inc.<br>1,375 % éch. 15/10/2027                                               | \$ 4 525                         | 4 353                     | 0,10        | 6,152 % éch. 01/07/2030                 | 0                                                     | 0                         | 0,00   |      |  |
|                                                                    |                                     | 539 483                          | 12,77                     |             |                                                                                                 |                                  |                           |             | 6,250 % éch. 01/07/2032                 | 1                                                     | 1                         | 0,00   |      |  |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS                                         |                                     |                                  |                           |             | Total des Obligations et billets privés                                                         |                                  |                           |             |                                         | 6,301 % éch. 01/11/2035                               | 23                        | 23     | 0,00 |  |
| Ameren Corp.<br>5,000 % éch. 15/01/2029                            | \$                                  | 8 500                            | 8 572                     | 0,20        | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX                                                               |                                  |                           |             |                                         | 6,357 % éch. 01/07/2027                               | 0                         | 0      | 0,00 |  |
| American Electric Power Co., Inc.<br>5,200 % éch. 15/01/2029       |                                     | 1 800                            | 1 828                     | 0,04        | Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp.<br>Revenue Bonds, Series 2021 |                                  |                           |             |                                         | 6,419 % éch. 01/01/2028                               | 0                         | 0      | 0,00 |  |
| Anglian Water Services Financing PLC<br>4,250 % éch. 23/06/2036    | €                                   | 5 500                            | 6 296                     | 0,15        | 3,714 % éch. 01/06/2041                                                                         |                                  |                           |             |                                         | 6,500 % éch. 15/09/2028                               | 4                         | 4      | 0,00 |  |
| 5,875 % éch. 20/06/2031                                            | £                                   | 8 500                            | 11 474                    | 0,27        | 3,850 % éch. 01/06/2050                                                                         |                                  |                           |             |                                         | Ginnie Mae<br>3,000 % éch. 15/10/2049 -<br>15/11/2049 | 702                       | 624    | 0,02 |  |
| AT&T, Inc.<br>4,400 % éch. 30/04/2031                              | \$                                  | 5 400                            | 5 311                     | 0,13        | Obligations Tobacco Settlement Finance Authority,<br>West Virginia Revenue Bonds, Series 2020   |                                  |                           |             |                                         | 3,500 % éch. 20/03/2052 -<br>20/07/2055               | 44 706                    | 40 197 | 0,95 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             | 3,301 % éch. 01/06/2033                                                                         |                                  |                           |             |                                         | 4,000 % éch. 15/02/2052 -<br>15/03/2052               | 7 304                     | 6 841  | 0,16 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,109 % éch. 20/01/2072                               | 4 121                     | 4 119  | 0,10 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,245 % éch. 20/09/2065                               | 246                       | 246    | 0,01 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,281 % éch. 20/08/2062                               | 148                       | 148    | 0,00 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,359 % éch. 20/10/2072                               | 1 748                     | 1 754  | 0,04 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,361 % éch. 20/08/2065 -<br>20/09/2065               | 4 039                     | 4 045  | 0,10 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,409 % éch. 20/01/2073                               | 7 247                     | 7 309  | 0,17 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,479 % éch. 20/01/2073 -<br>20/02/2073               | 12 584                    | 12 735 | 0,30 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         | 4,489 % éch. 20/02/2073 -<br>20/03/2073               | 16 314                    | 16 478 | 0,39 |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |
|                                                                    |                                     |                                  |                           |             |                                                                                                 |                                  |                           |             |                                         |                                                       |                           |        |      |  |

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,509 % éch. 20/01/2073                                        | \$ 25 409                           | \$ 25 732                        | 0,61                      | 3,125 % éch. 15/05/2048                                    | \$ 2 500                            | \$ 1 879                         | 0,04                      | 4,642 % éch. 25/09/2035                                              | \$ 321                              | \$ 165                           | 0,00                      |
| 4,561 % éch. 20/01/2066                                        | 1 766                               | 1 775                            | 0,04                      | 3,250 % éch. 15/05/2042                                    | 1 500                               | 1 236                            | 0,03                      | 5,044 % éch. 25/05/2035                                              | 174                                 | 168                              | 0,00                      |
| 4,629 % éch. 20/12/2072                                        | 4 989                               | 5 078                            | 0,12                      | 3,375 % éch. 15/08/2042                                    | 43 318                              | 36 160                           | 0,86                      | Benchmark Mortgage Trust                                             |                                     |                                  |                           |
| 4,749 % éch. 20/11/2072                                        | 9 497                               | 9 705                            | 0,23                      | 3,375 % éch. 15/05/2044                                    | 30 300                              | 24 711                           | 0,59                      | 3,666 % éch. 15/01/2051                                              | 11 100                              | 10 932                           | 0,26                      |
| 5,000 % éch. 20/02/2028 - 15/07/2052                           | 12 868                              | 12 744                           | 0,30                      | 3,375 % éch. 15/11/2048                                    | 28 400                              | 22 222                           | 0,53                      | 3,965 % éch. 10/04/2051                                              | 2 052                               | 2 040                            | 0,05                      |
| 5,077 % éch. 20/11/2067                                        | 2 439                               | 2 465                            | 0,06                      | 3,625 % éch. 15/08/2043                                    | 16 100                              | 13 720                           | 0,33                      | 3,976 % éch. 15/07/2051                                              | 989                                 | 987                              | 0,02                      |
| 5,125 % éch. 20/10/2026 - 20/12/2034                           | 14                                  | 14                               | 0,00                      | 3,625 % éch. 15/02/2044                                    | 24 700                              | 20 934                           | 0,50                      | 4,077 % éch. 15/07/2051                                              | 6 263                               | 6 249                            | 0,15                      |
| 5,197 % éch. 20/06/2067                                        | 1 088                               | 1 099                            | 0,03                      | 3,750 % éch. 15/08/2041                                    | 18 600                              | 16 539                           | 0,39                      | BPCE Home Loans FCT                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 20/07/2030 - 20/07/2034                           | 23                                  | 23                               | 0,00                      | 3,750 % éch. 15/11/2043                                    | 5 000                               | 4 323                            | 0,10                      | 2,750 % éch. 31/10/2058                                              | € 1 860                             | 2 129                            | 0,05                      |
| 5,625 % éch. 20/04/2030                                        | 2                                   | 2                                | 0,00                      | 3,875 % éch. 15/05/2043                                    | 30 859                              | 27 285                           | 0,65                      | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 20/09/2038                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,000 % éch. 15/11/2042                                    | 54 028                              | 48 771                           | 1,15                      | 4,445 % éch. 25/09/2037                                              | \$ 69                               | 66                               | 0,00                      |
| 8,000 % éch. 20/05/2031                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,000 % éch. 15/11/2052                                    | 24 500                              | 20 967                           | 0,50                      | 5,750 % éch. 25/09/2035                                              | 382                                 | 390                              | 0,01                      |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/11/2039                                    | 10 100                              | 9 814                            | 0,23                      | 6,480 % éch. 25/10/2035                                              | 20                                  | 20                               | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 01/07/2056                                        | 15 100                              | 12 372                           | 0,29                      | 4,375 % éch. 15/05/2041                                    | 3 191                               | 3 059                            | 0,07                      | Countrywide Alternative Loan Trust                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,000 % éch. 01/07/2056                                        | 44 600                              | 41 466                           | 0,98                      | 4,375 % éch. 15/08/2043                                    | 22 101                              | 20 789                           | 0,49                      | 5,223 % éch. 25/11/2035                                              | 5 336                               | 5 083                            | 0,12                      |
| 4,500 % éch. 01/07/2056                                        | 37 100                              | 35 641                           | 0,85                      | 4,500 % éch. 15/11/2054                                    | 5 500                               | 5 121                            | 0,12                      | 5,500 % éch. 25/02/2036                                              | 2 261                               | 1 769                            | 0,04                      |
| 5,000 % éch. 01/07/2056                                        | 57 615                              | 56 810                           | 1,35                      | 4,625 % éch. 15/05/2044                                    | 13 800                              | 13 336                           | 0,32                      | 5,500 % éch. 25/05/2036                                              | 1 438                               | 1 167                            | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 101 800                             | 103 762                          | 2,46                      | 4,625 % éch. 15/05/2054                                    | 18 400                              | 17 478                           | 0,41                      | 5,750 % éch. 25/02/2037                                              | 3 033                               | 1 447                            | 0,03                      |
| Administration des petites entreprises                         |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/11/2055 (j)                                | 14 800                              | 14 082                           | 0,33                      | 6,000 % éch. 25/02/2036                                              | 4 363                               | 2 308                            | 0,06                      |
| 5,870 % éch. 01/07/2028                                        | 3                                   | 3                                | 0,00                      | 4,750 % éch. 15/05/2055 (j)                                | 18 034                              | 17 496                           | 0,41                      | 6,000 % éch. 25/04/2036                                              | 175                                 | 74                               | 0,00                      |
| 6,220 % éch. 01/12/2028                                        | 136                                 | 138                              | 0,00                      | 4,750 % éch. 15/08/2045 (j)                                | 28 352                              | 28 144                           | 0,67                      | 6,000 % éch. 25/08/2036                                              | 5 251                               | 3 046                            | 0,07                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)      |                                     |                                  |                           | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/11/2036                                              | 234                                 | 116                              | 0,00                      |
| 2,500 % éch. 01/12/2032 - 01/02/2035                           | 4 449                               | 4 280                            | 0,10                      | 0,125 % éch. 15/02/2051                                    | 61 380                              | 32 503                           | 0,77                      | 6,000 % éch. 25/08/2037                                              | 3 429                               | 1 953                            | 0,05                      |
| 3,000 % éch. 01/03/2028 - 01/06/2052                           | 28 918                              | 25 323                           | 0,60                      | 0,250 % éch. 15/02/2050                                    | 8 806                               | 4 966                            | 0,12                      | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                    |                                     |                                  |                           |
| 3,500 % éch. 01/01/2047 - 01/05/2047                           | 97                                  | 91                               | 0,00                      | 0,625 % éch. 15/02/2043                                    | 145                                 | 106                              | 0,00                      | 4,163 % éch. 25/04/2046                                              | 662                                 | 613                              | 0,02                      |
| 4,000 % éch. 01/01/2027 - 01/10/2052                           | 13 613                              | 12 894                           | 0,31                      | 0,750 % éch. 15/02/2045                                    | 28 135                              | 19 996                           | 0,47                      | 4,487 % éch. 20/10/2035                                              | 615                                 | 611                              | 0,02                      |
| 4,500 % éch. 01/10/2026 - 01/05/2053                           | 13 204                              | 12 762                           | 0,30                      | 0,875 % éch. 15/02/2047                                    | 11 171                              | 7 859                            | 0,19                      | 4,669 % éch. 25/11/2034                                              | 220                                 | 211                              | 0,01                      |
| 5,000 % éch. 01/10/2031 - 01/09/2053                           | 35 613                              | 35 339                           | 0,84                      | 1,000 % éch. 15/02/2046                                    | 1 405                               | 1 032                            | 0,02                      | 4,959 % éch. 20/02/2035                                              | 19                                  | 19                               | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/02/2032 - 01/11/2053                           | 2 141                               | 2 180                            | 0,05                      | 1,000 % éch. 15/02/2049                                    | 2 911                               | 2 045                            | 0,05                      | 5,625 % éch. 19/07/2031                                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
| 6,000 % éch. 01/07/2029 - 01/02/2041                           | 916                                 | 956                              | 0,02                      | 1,375 % éch. 15/02/2044                                    | 857                                 | 700                              | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/07/2037                                              | 247                                 | 104                              | 0,00                      |
| 6,500 % éch. 01/07/2034 - 01/03/2037                           | 40                                  | 42                               | 0,00                      | 1,500 % éch. 15/02/2053                                    | 10 813                              | 8 223                            | 0,19                      | 6,224 % éch. 20/02/2036                                              | 26                                  | 23                               | 0,00                      |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 30/07/2034 (j)                                | 7 215                               | 7 113                            | 0,17                      | Countrywide Home Loan Repurchasing REMIC Trust                       |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 01/08/2056                                        | 213 891                             | 186 419                          | 4,41                      | 2,125 % éch. 15/02/2054                                    | 12 909                              | 11 285                           | 0,27                      | 4,103 % éch. 25/06/2035                                              | 45                                  | 44                               | 0,00                      |
| 3,500 % éch. 01/07/2056                                        | 17 200                              | 15 608                           | 0,37                      | 2,375 % éch. 15/02/2055                                    | 3 165                               | 2 915                            | 0,07                      | 4,710 % éch. 25/01/2034                                              | 11                                  | 10                               | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 122 070                             | 114 037                          | 2,70                      | Billets du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 25/11/2034                                              | 10                                  | 10                               | 0,00                      |
| 4,500 % éch. 01/07/2041 - 01/08/2056                           | 203 150                             | 194 580                          | 4,61                      | 3,500 % éch. 31/01/2030                                    | 4 150                               | 4 057                            | 0,10                      | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                 |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                           | 569 815                             | 559 454                          | 13,25                     | 3,875 % éch. 30/04/2030                                    | 3 875                               | 3 834                            | 0,09                      | 5,149 % éch. 25/06/2033                                              | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 5,500 % éch. 01/08/2056                                        | 152 900                             | 153 185                          | 3,63                      | 4,000 % éch. 31/01/2031                                    | 4 225                               | 4 189                            | 0,10                      | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/08/2056                                        | 130 258                             | 132 744                          | 3,14                      | 4,125 % éch. 31/03/2031                                    | 3 301                               | 3 289                            | 0,08                      | 6,000 % éch. 25/11/2035                                              | 2 312                               | 510                              | 0,01                      |
|                                                                | 1 899 438                           | 44,97                            |                           | 4,250 % éch. 28/02/2031                                    | 4 125                               | 4 133                            | 0,10                      | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/05/2036 (j)                                | 6 037                               | 6 005                            | 0,14                      | 3,500 % éch. 25/04/2038                                              | 171                                 | 170                              | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 30/04/2031                                    | 7 218                               | 7 348                            | 0,17                      | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust                 |                                     |                                  |                           |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN                                |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 15/08/2040 (c)                                | 14 400                              | 7 248                            | 0,17                      | 5,750 % éch. 25/06/2036                                              | 699                                 | 312                              | 0,01                      |
| Obligations du Trésor américain                                |                                     |                                  |                           | 0,000 % éch. 15/02/2041 (c)                                | 1 900                               | 928                              | 0,02                      | 6,000 % éch. 25/05/2036                                              | 1 757                               | 876                              | 0,02                      |
| 1,375 % éch. 15/11/2040                                        | 196 650                             | 127 196                          | 3,01                      | 0,000 % éch. 15/05/2041 (c)                                | 600                                 | 289                              | 0,01                      | 6,000 % éch. 25/04/2037                                              | 558                                 | 169                              | 0,00                      |
| 1,625 % éch. 15/11/2050                                        | 18 100                              | 9 465                            | 0,22                      | 0,000 % éch. 15/08/2041 (c)                                | 900                                 | 427                              | 0,01                      | CSAIL Commercial Mortgage Trust                                      |                                     |                                  |                           |
| 1,750 % éch. 15/08/2041                                        | 26 000                              | 17 436                           | 0,41                      | 0,000 % éch. 15/05/2042 (c)                                | 7 900                               | 3 583                            | 0,08                      | 3,458 % éch. 15/11/2050                                              | 4 600                               | 4 487                            | 0,11                      |
| 1,875 % éch. 15/02/2041                                        | 11 975                              | 8 313                            | 0,20                      |                                                            |                                     |                                  |                           | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                        |                                     |                                  |                           |
| 1,875 % éch. 15/02/2051                                        | 35 925                              | 19 977                           | 0,47                      |                                                            |                                     |                                  |                           | 4,423 % éch. 25/08/2037                                              | 1 982                               | 1 667                            | 0,04                      |
| 1,875 % éch. 15/11/2051                                        | 11 200                              | 6 157                            | 0,15                      | TITRES ADOSSES A DES CREANCES HYPOTHECAIRES NON EMIS       |                                     |                                  |                           | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 15/11/2041                                        | 6 500                               | 4 504                            | 0,11                      | PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX                         |                                     |                                  |                           | 4,815 % éch. 19/07/2044                                              | 7                                   | 7                                | 0,00                      |
| 2,000 % éch. 15/02/2050                                        | 30 900                              | 18 014                           | 0,43                      | American Home Mortgage Investment Trust                    |                                     |                                  |                           | Eurohome UK Mortgages PLC                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 15/08/2051                                        | 22 800                              | 12 986                           | 0,31                      | 4,123 % éch. 25/12/2046                                    | 103                                 | 89                               | 0,00                      | 4,016 % éch. 15/06/2044                                              | £ 52                                | 68                               | 0,00                      |
| 2,250 % éch. 15/05/2041                                        | 34 200                              | 24 943                           | 0,59                      | Angel Oak Mortgage Trust                                   |                                     |                                  |                           | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust                  |                                     |                                  |                           |
| 2,250 % éch. 15/08/2049                                        | 63 510                              | 39 518                           | 0,94                      | 1,469 % éch. 25/06/2065                                    | 269                                 | 263                              | 0,01                      | 4,698 % éch. 25/10/2034                                              | \$ 44                               | 43                               | 0,00                      |
| 2,375 % éch. 15/11/2049                                        | 56 648                              | 36 098                           | 0,85                      | Banc of America Funding Trust                              |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/06/2037                                              | 1 081                               | 317                              | 0,01                      |
| 2,375 % éch. 15/05/2051                                        | 12 225                              | 7 649                            | 0,18                      | 4,970 % éch. 20/09/2035                                    | 484                                 | 398                              | 0,01                      | GSR Mortgage Loan Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 15/02/2045                                        | 6 100                               | 4 280                            | 0,10                      | 5,365 % éch. 25/05/2035                                    | 674                                 | 652                              | 0,02                      | 4,075 % éch. 25/06/2034                                              | 31                                  | 30                               | 0,00                      |
| 2,750 % éch. 15/08/2047                                        | 8 000                               | 5 658                            | 0,13                      | Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.    |                                     |                                  |                           | 4,479 % éch. 25/01/2036                                              | 843                                 | 797                              | 0,02                      |
| 2,875 % éch. 15/05/2049                                        | 33 000                              | 23 443                           | 0,56                      | 4,231 % éch. 15/09/2060                                    | 10 900                              | 10 760                           | 0,26                      | 4,601 % éch. 25/06/2034                                              | 15                                  | 15                               | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 15/11/2044                                        | 138 800                             | 106 209                          | 2,51                      | Banc of America Mortgage Trust                             |                                     |                                  |                           | 4,837 % éch. 25/09/2035                                              | 894                                 | 859                              | 0,02                      |
| 3,000 % éch. 15/02/2048                                        | 9 100                               | 6 702                            | 0,16                      | 5,438 % éch. 25/07/2035                                    | 116                                 | 111                              | 0,00                      | 5,500 % éch. 25/01/2037                                              | 2                                   | 14                               | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 15/08/2048                                        | 5 100                               | 3 738                            | 0,09                      | 5,508 % éch. 25/07/2034                                    | 73                                  | 69                               | 0,00                      | HarborView Mortgage Loan Trust                                       |                                     |                                  |                           |
| 3,000 % éch. 15/02/2049                                        | 11 700                              | 8 534                            | 0,20                      | BankUnited Trust                                           |                                     |                                  |                           | 4,014 % éch. 19/03/2037                                              | 2 475                               | 2 322                            | 0,06                      |
| 3,125 % éch. 15/11/2041                                        | 2 200                               | 1 797                            | 0,04                      | 4,363 % éch. 25/09/2045                                    | 361                                 | 347                              | 0,01                      | 4,194 % éch. 19/05/2035                                              | 123                                 | 120                              | 0,00                      |
| 3,125 % éch. 15/02/2043                                        | 4 900                               | 3 919                            | 0,09                      | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust              |                                     |                                  |                           | IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust                               |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 15/08/2044                                        | 18 600                              | 14 560                           | 0,34                      | 4,314 % éch. 15/12/2051                                    | 8 000                               | 7 883                            | 0,19                      | 5,653 % éch. 25/01/2032                                              | 0                                   | 0                                | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                |                                     |                                  |                           | IndyMac Mortgage Loan Trust                                          |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,294 % éch. 25/04/2034                                    | 115                                 | 107                              | 0,00                      | 4,243 % éch. 25/06/2037                                              | 765                                 | 726                              | 0,02                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,498 % éch. 25/07/2034                                    | 4                                   | 4                                | 0,00                      | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust                  |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,641 % éch. 25/11/2030                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      | 4,128 % éch. 05/07/2031                                              | 4 400                               | 3 710                            | 0,09                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,713 % éch. 25/04/2034                                    | 67                                  | 61                               | 0,00                      | 4,882 % éch. 15/06/2035                                              | 10 951                              | 7 282                            | 0,17                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,757 % éch. 25/04/2034                                    | 43                                  | 42                               | 0,00                      | JPMorgan Mortgage Trust                                              |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 5,498 % éch. 25/02/2034                                    | 42                                  | 39                               | 0,00                      | 4,834 % éch. 25/07/2035                                              | 65                                  | 62                               | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 25/04/2033                                    | 8                                   | 9                                | 0,00                      | 5,750 % éch. 25/01/2036                                              | 332                                 | 144                              | 0,00                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 6,156 % éch. 25/01/2034                                    | 108                                 | 105                              | 0,00                      | Landmark Mortgage Securities PLC                                     |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 6,660 % éch. 25/12/2035                                    | 55                                  | 56                               | 0,00                      | 4,146 % éch. 17/04/2044                                              | £ 3 899                             | 5 096                            | 0,12                      |
|                                                                |                                     |                                  |                           | Bear Stearns ALT-A Trust                                   |                                     |                                  |                           |                                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                |                                     |                                  |                           | 4,083 % éch. 25/02/2034                                    | 20                                  | 19                               | 0,00                      |                                                                      |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

|                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                          | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                      | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET     |         |        |        |      |
|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|--------|--------|------|
| DESCRIPTION                                                          |                                     |                                  |                           | DESCRIPTION                                    |                                                                              |                                  |                           | DESCRIPTION                        |                                     |                                                       |                               |         |        |        |      |
| Lehman XS Trust                                                      |                                     |                                  |                           | Warwick Finance Residential Mortgages PLC      |                                                                              |                                  |                           | Renaissance Home Equity Loan Trust |                                     |                                                       |                               |         |        |        |      |
| 4,123 % éch. 25/12/2036                                              | \$                                  | 2 329                            | \$ 2 425                  | 0,06                                           | 0,000 % éch. 21/12/2049 (c)                                                  | £                                | 0                         | \$ 1 676                           | 0,04                                | 4,963 % éch. 25/11/2034                               | \$                            | 108     | \$ 96  | 0,00   |      |
| 4,163 % éch. 25/03/2047                                              |                                     | 8 463                            | 7 608                     | 0,18                                           | 4,698 % éch. 21/12/2049                                                      |                                  | 3 171                     | 4 231                              | 0,10                                | Structured Asset Investment Loan Trust                |                               |         |        |        |      |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                                |                                     |                                  |                           |                                                | 5,396 % éch. 21/12/2049                                                      |                                  | 2 030                     | 2 711                              | 0,06                                | 4,528 % éch. 25/08/2035                               |                               | 269     | 263    | 0,01   |      |
| 5,370 % éch. 21/11/2034                                              |                                     | 987                              | 981                       | 0,02                                           | 5,896 % éch. 21/12/2049                                                      |                                  | 1 015                     | 1 347                              | 0,03                                | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                               |         |        |        |      |
| 5,555 % éch. 25/01/2036                                              |                                     | 4                                | 4                         | 0,00                                           | 6,396 % éch. 21/12/2049                                                      |                                  | 580                       | 768                                | 0,02                                | 3,918 % éch. 25/09/2036                               |                               | 5 843   | 3 495  | 0,08   |      |
| MASTR Repereforming Loan Trust                                       |                                     |                                  |                           |                                                | 6,896 % éch. 21/12/2049                                                      |                                  | 580                       | 762                                | 0,02                                | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust             |                               |         |        |        |      |
| 7,000 % éch. 25/05/2035                                              |                                     | 451                              | 288                       | 0,01                                           | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust                   |                                  |                           |                                    |                                     | 4,483 % éch. 25/04/2037                               |                               | 4 490   | 1 602  | 0,04   |      |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                               |                                     |                                  |                           |                                                | 4,213 % éch. 25/05/2035                                                      | \$                               | 412                       | 353                                | 0,01                                | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                               |         |        |        |      |
| 4,263 % éch. 25/11/2035                                              |                                     | 118                              | 115                       | 0,00                                           | 6,000 % éch. 25/11/2035                                                      |                                  | 389                       | 337                                | 0,01                                | 4,763 % éch. 25/10/2034                               |                               | 518     | 539    | 0,01   |      |
| 4,522 % éch. 25/06/2035                                              |                                     | 161                              | 157                       | 0,00                                           | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust               |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       |                               |         |        |        |      |
| 5,109 % éch. 25/02/2035                                              |                                     | 452                              | 434                       | 0,01                                           | 5,270 % éch. 25/02/2031                                                      |                                  | 0                         | 0                                  | 0,00                                |                                                       |                               | 45 793  | 1,08   |        |      |
| MetLife Securitization Trust                                         |                                     |                                  |                           |                                                |                                                                              |                                  |                           | 172 404                            | 4,08                                | AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                    |                               |         |        |        |      |
| 3,750 % éch. 25/03/2057                                              |                                     | 4 336                            | 4 188                     | 0,10                                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS                                                  |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | Ares European CLO DAC         |         |        |        |      |
| Mortgage Equity Conversion Asset Trust                               |                                     |                                  |                           | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS AUTOMOBILES AUTRES |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     | 3,234 % éch. 21/10/2034                               | €                             | 413     | 473    | 0,01   |      |
| 4,510 % éch. 25/05/2042                                              |                                     | 1 030                            | 934                       | 0,02                                           |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | Aurium CLO DAC                |         |        |        |      |
| MortgageIT Trust                                                     |                                     |                                  |                           | Bumper NL BV                                   |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     | 3,347 % éch. 22/06/2034                               |                               | 6 696   | 7 650  | 0,18   |      |
| 4,323 % éch. 25/10/2035                                              |                                     | 243                              | 243                       | 0,01                                           | 2,925 % éch. 21/03/2036                                                      | €                                | 3 717                     | 4 256                              | 0,10                                | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.              |                               |         |        |        |      |
| NAAC Repereforming Loan REMIC Trust Certificates                     |                                     |                                  |                           | Golden Bar Securitisation SRL                  |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     | 4,941 % éch. 11/04/2045                               | \$                            | 5 578   | 5 567  | 0,13   |      |
| 6,500 % éch. 25/02/2035                                              |                                     | 1 304                            | 1 131                     | 0,03                                           | 3,436 % éch. 22/09/2043                                                      |                                  | 2 607                     | 2 998                              | 0,07                                | Black Diamond CLO DAC                                 |                               |         |        |        |      |
| 7,000 % éch. 25/10/2034                                              |                                     | 311                              | 274                       | 0,01                                           | LT Rahoitus DAC                                                              |                                  |                           |                                    |                                     | 3,263 % éch. 15/05/2032                               | €                             | 925     | 1 058  | 0,03   |      |
| 7,500 % éch. 25/03/2034                                              |                                     | 417                              | 393                       | 0,01                                           | 2,749 % éch. 18/07/2036                                                      |                                  | 1 603                     | 1 833                              | 0,05                                | BlueMountain Fuji Euro CLO DAC                        |                               |         |        |        |      |
| New Residential Mortgage Loan Trust                                  |                                     |                                  |                           |                                                |                                                                              |                                  |                           | 9 087                              | 0,22                                | 3,114 % éch. 15/01/2033                               |                               | 1 483   | 1 698  | 0,04   |      |
| 3,500 % éch. 25/12/2057                                              |                                     | 3 312                            | 3 210                     | 0,08                                           | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES COMMERCIALES AUTRES              |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | BNPP AM Euro CLO DAC          |         |        |        |      |
| Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust                 |                                     |                                  |                           |                                                |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | 3,014 % éch. 22/07/2032       |         | 10 679 | 12 206 | 0,29 |
| 4,833 % éch. 25/02/2035                                              |                                     | 51                               | 51                        | 0,00                                           | MF1 LLC                                                                      |                                  |                           |                                    |                                     | Bridgepoint CLO DAC                                   |                               |         |        |        |      |
| Paragon Mortgages PLC                                                |                                     |                                  |                           |                                                | 5,789 % éch. 19/06/2037                                                      | \$                               | 6 273                     | 6 275                              | 0,15                                | 3,414 % éch. 15/01/2034                               |                               | 586     | 671    | 0,02   |      |
| 2,523 % éch. 15/11/2038                                              | €                                   | 258                              | 293                       | 0,01                                           | PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES                                          |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | Commonbond Student Loan Trust |         |        |        |      |
| Prime Mortgage Trust                                                 |                                     |                                  |                           |                                                |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | 4,613 % éch. 25/05/2041       | \$      | 190    | 188    | 0,01 |
| 4,163 % éch. 25/02/2034                                              | \$                                  | 30                               | 29                        | 0,00                                           | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                  |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       | CVC Cordatus Loan Fund DAC    |         |        |        |      |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust                               |                                     |                                  |                           |                                                | 3,883 % éch. 25/10/2036                                                      |                                  | 203                       | 77                                 | 0,00                                | 3,377 % éch. 22/09/2034                               | €                             | 1 384   | 1 584  | 0,04   |      |
| 4,163 % éch. 25/05/2037                                              |                                     | 1 853                            | 1 431                     | 0,03                                           | 4,083 % éch. 25/08/2036                                                      |                                  | 5 955                     | 1 349                              | 0,03                                | Dryden Euro CLO DAC                                   |                               |         |        |        |      |
| 6,000 % éch. 25/04/2036                                              |                                     | 1 914                            | 1 561                     | 0,04                                           | Ameritquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                                  | 1 825                     | 1 809                              | 0,04                                | 3,144 % éch. 15/01/2034                               |                               | 4 021   | 4 603  | 0,11   |      |
| Residential Asset Securitization Trust                               |                                     |                                  |                           |                                                | 4,873 % éch. 25/03/2035                                                      |                                  |                           |                                    |                                     | Harvest CLO DAC                                       |                               |         |        |        |      |
| 6,000 % éch. 25/01/2037                                              |                                     | 2 479                            | 701                       | 0,02                                           | Asset-Backed Funding Certificates Trust                                      |                                  |                           |                                    |                                     | 3,054 % éch. 15/01/2032                               |                               | 7 825   | 8 950  | 0,21   |      |
| 6,500 % éch. 25/09/2036                                              |                                     | 687                              | 189                       | 0,00                                           | 4,463 % éch. 25/06/2034                                                      |                                  | 58                        | 56                                 | 0,00                                | Invesco Euro CLO DAC                                  |                               |         |        |        |      |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust                  |                                     |                                  |                           |                                                | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust                         |                                  |                           |                                    |                                     | 3,260 % éch. 30/10/2038                               |                               | 9 300   | 10 646 | 0,25   |      |
| 5,941 % éch. 25/02/2036                                              |                                     | 108                              | 91                        | 0,00                                           | 3,638 % éch. 25/12/2036                                                      |                                  | 922                       |                                    |                                     | Latitude Australia Personal Loans Trust               |                               |         |        |        |      |
| Resloc UK PLC                                                        |                                     |                                  |                           |                                                | Carrington Mortgage Loan Trust                                               |                                  |                           |                                    |                                     | 5,303 % éch. 17/09/2033                               | AUD                           | 1 466   | 1 016  | 0,02   |      |
| 4,026 % éch. 15/12/2043                                              | £                                   | 2 291                            | 2 998                     | 0,07                                           | 4,753 % éch. 25/06/2035                                                      |                                  | 390                       | 392                                | 0,01                                | Massachusetts Educational Financing Authority         |                               |         |        |        |      |
| RMAC PLC                                                             |                                     |                                  |                           |                                                | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                          |                                  |                           |                                    |                                     | 4,880 % éch. 25/04/2038                               | \$                            | 2       | 2      | 0,00   |      |
| 4,947 % éch. 15/02/2047                                              |                                     | 5 587                            | 7 420                     | 0,18                                           | 4,013 % éch. 25/03/2037                                                      |                                  | 1 498                     | 1 316                              | 0,03                                | Palmer Square European Loan Funding DAC               |                               |         |        |        |      |
| RMAC Securities PLC                                                  |                                     |                                  |                           |                                                | 4,083 % éch. 25/09/2036                                                      |                                  | 3 755                     | 2 844                              | 0,07                                | 3,273 % éch. 15/05/2034                               | €                             | 2 566   | 2 938  | 0,07   |      |
| 4,296 % éch. 12/06/2044                                              |                                     | 459                              | 579                       | 0,01                                           | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                            |                                  |                           |                                    |                                     | Providus CLO DAC                                      |                               |         |        |        |      |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                       |                                     |                                  |                           |                                                | 4,043 % éch. 25/06/2047                                                      |                                  | 1 300                     | 1 197                              | 0,03                                | 3,513 % éch. 15/11/2039                               |                               | 5 900   | 6 753  | 0,16   |      |
| 3,865 % éch. 25/02/2036                                              | \$                                  | 658                              | 568                       | 0,01                                           | 4,203 % éch. 25/09/2037                                                      |                                  | 650                       | 709                                | 0,02                                | Rockford Tower Europe CLO DAC                         |                               |         |        |        |      |
| 4,705 % éch. 25/09/2034                                              |                                     | 9                                | 9                         | 0,00                                           | 4,223 % éch. 25/07/2037                                                      |                                  | 930                       | 829                                | 0,02                                | 3,489 % éch. 29/08/2036                               |                               | 6 300   | 7 211  | 0,17   |      |
| 4,739 % éch. 25/04/2034                                              |                                     | 705                              | 703                       | 0,02                                           | 4,663 % éch. 25/10/2034                                                      |                                  | 577                       | 568                                | 0,01                                | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.        |                               |         |        |        |      |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust                          |                                     |                                  |                           |                                                | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                            |                                  |                           |                                    |                                     | 5,102 % éch. 01/04/2035                               | \$                            | 5 061   | 5 142  | 0,12   |      |
| 4,203 % éch. 25/09/2047                                              |                                     | 8 247                            | 7 490                     | 0,18                                           | 3,883 % éch. 25/11/2036                                                      |                                  | 105                       | 48                                 | 0,00                                |                                                       |                               | 78 356  | 1,86   |        |      |
| 4,234 % éch. 19/04/2035                                              |                                     | 143                              | 141                       | 0,00                                           | 4,073 % éch. 25/05/2046                                                      |                                  | 1 227                     | 1 112                              | 0,03                                | PRÊTS HYPOTHÉCAIRES ENTIERS EN GARANTIE               |                               |         |        |        |      |
| 4,254 % éch. 19/07/2035                                              |                                     | 52                               | 51                        | 0,00                                           | FBR Securitization Trust                                                     |                                  |                           |                                    |                                     | First Franklin Mortgage Loan Trust                    |                               |         |        |        |      |
| 4,323 % éch. 25/02/2036                                              |                                     | 317                              | 272                       | 0,01                                           | 4,468 % éch. 25/11/2035                                                      |                                  | 2 279                     | 2 257                              | 0,05                                | 3,983 % éch. 25/12/2037                               |                               | 2 260   | 2 182  | 0,05   |      |
| 4,334 % éch. 19/05/2034                                              |                                     | 66                               | 63                        | 0,00                                           | GE-WMC Mortgage Securities Trust                                             |                                  |                           |                                    |                                     | 4,438 % éch. 25/03/2034                               |                               | 178     | 181    | 0,00   |      |
| 4,414 % éch. 19/09/2032                                              |                                     | 5                                | 4                         | 0,00                                           | 3,843 % éch. 25/08/2036                                                      |                                  | 31                        | 12                                 | 0,00                                | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust        |                               |         |        |        |      |
| 5,463 % éch. 25/05/2047                                              |                                     | 6 738                            | 5 593                     | 0,13                                           | GSAMP Trust                                                                  |                                  |                           |                                    |                                     | 4,003 % éch. 25/11/2036                               |                               | 5 449   | 1 396  | 0,03   |      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                |                                     |                                  |                           |                                                | 4,043 % éch. 25/12/2036                                                      |                                  | 354                       | 218                                | 0,01                                | 4,043 % éch. 25/05/2036                               |                               | 379     | 203    | 0,01   |      |
| 7,500 % éch. 25/10/2036                                              |                                     | 599                              | 322                       | 0,01                                           | Home Equity Asset Trust                                                      |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       |                               | 3 962   | 0,09   |        |      |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates |                                     |                                  |                           |                                                | 4,798 % éch. 25/08/2035                                                      |                                  | 47                        | 47                                 | 0,00                                |                                                       |                               | 143 473 | 3,40   |        |      |
| 6,032 % éch. 25/06/2033                                              |                                     | 1                                | 1                         | 0,00                                           | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                          |                                  |                           |                                    |                                     | EMISSIONS SOUVERAINES                                 |                               |         |        |        |      |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                                  |                                     |                                  |                           |                                                | 4,198 % éch. 25/05/2036                                                      |                                  | 2 737                     | 2 619                              | 0,06                                | Action Logement Services                              |                               |         |        |        |      |
| 4,259 % éch. 25/09/2037                                              |                                     | 180                              | 178                       | 0,00                                           | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust                             |                                  | 7 814                     | 6 918                              | 0,16                                | 0,500 % éch. 30/10/2034                               | €                             | 7 600   | 6 774  | 0,16   |      |
| 6,039 % éch. 25/06/2047                                              |                                     | 563                              | 491                       | 0,01                                           | 6,263 % éch. 25/10/2037                                                      |                                  |                           |                                    |                                     | Airport Authority Hong Kong                           |                               |         |        |        |      |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                      |                                     |                                  |                           |                                                | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                       |                                  |                           |                                    |                                     | 4,750 % éch. 12/01/2028                               | \$                            | 1 300   | 1 310  | 0,03   |      |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                                              | £                                   | 4 784                            | 6 354                     | 0,15                                           | 3,943 % éch. 25/05/2037                                                      |                                  | 424                       | 390                                | 0,01                                | 4,875 % éch. 12/01/2030                               |                               | 5 000   | 5 089  | 0,12   |      |
| Uropa Securities PLC                                                 |                                     |                                  |                           |                                                | 3,963 % éch. 25/09/2036                                                      |                                  | 886                       | 298                                | 0,01                                | Obligation internationale du gouvernement australien  |                               |         |        |        |      |
| 4,066 % éch. 10/10/2040                                              |                                     | 124                              | 164                       | 0,00                                           | 3,993 % éch. 25/11/2036                                                      |                                  | 816                       | 455                                | 0,01                                | 2,750 % éch. 21/06/2035                               | AUD                           | 16 600  | 9 881  | 0,23   |      |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                        |                                     |                                  |                           |                                                | 4,063 % éch. 25/07/2036                                                      |                                  | 7 058                     | 2 514                              | 0,06                                | Obligation internationale du gouvernement brésilien   |                               |         |        |        |      |
| 3,455 % éch. 25/01/2037                                              | \$                                  | 3 584                            | 3 036                     | 0,07                                           | 4,083 % éch. 25/09/2036                                                      |                                  | 6 931                     | 2 885                              | 0,07                                | 4,000 % éch. 23/04/2030                               | €                             | 7 100   | 8 147  | 0,19   |      |
| 3,986 % éch. 25/02/2037                                              |                                     | 500                              | 474                       | 0,01                                           | 4,468 % éch. 25/01/2035                                                      |                                  | 1 476                     | 1 471                              | 0,04                                | 6,125 % éch. 15/03/2034                               | \$                            | 8 700   | 8 758  | 0,21   |      |
| 4,229 % éch. 25/09/2036                                              |                                     | 829                              | 802                       | 0,02                                           | New Century Home Equity Loan Trust                                           |                                  |                           |                                    |                                     | Obligation internationale du gouvernement canadien    |                               |         |        |        |      |
| 4,303 % éch. 25/07/2045                                              |                                     | 233                              | 228                       | 0,01                                           | 4,123 % éch. 25/05/2036                                                      |                                  | 21                        | 21                                 | 0,00                                | 3,250 % éch. 01/12/2034                               | CAD                           | 5 922   | 4 169  | 0,10   |      |
| 4,343 % éch. 25/10/2045                                              |                                     | 1 879                            | 1 833                     | 0,04                                           | 4,483 % éch. 25/10/2035                                                      |                                  | 901                       | 900                                | 0,02                                |                                                       |                               |         |        |        |      |
| 4,383 % éch. 25/01/2045                                              |                                     | 64                               | 64                        | 0,00                                           |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       |                               |         |        |        |      |
| 4,403 % éch. 25/01/2045                                              |                                     | 1 098                            | 1 076                     | 0,03                                           |                                                                              |                                  |                           |                                    |                                     |                                                       |                               |         |        |        |      |



| DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE EN % DE<br>VALEUR<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |      |
|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------|--------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------|
| Obligation internationale du gouvernement colombien               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain     |                                     |                                           |             | BONS DU TRESOR NIGERIAN              |                                  |                           |      |
| 5,375 % éch. 21/01/2029                                           | \$ 1 300                            | \$ 1 298                         | 0,03                      | 3,500 % éch. 19/09/2029                                | € 3 100                             | \$ 3 521                                  | 0,08        | 21,097 % éch. 07/07/2026 (c)(d)      | NGN 83 300                       | \$ 61                     | 0,00 |
| 6,500 % éch. 21/01/2033                                           | 1 300                               | 1 322                            | 0,03                      | 4,500 % éch. 19/03/2034                                | 3 200                               | 3 650                                     | 0,09        | 21,137 % éch. 06/10/2026 (c)(d)      | 109 845                          | 76                        | 0,00 |
| TES colombien                                                     |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 19/03/2038                                | 1 200                               | 1 366                                     | 0,03        | 21,241 % éch. 14/07/2026 (c)(d)      | 274 612                          | 198                       | 0,01 |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                          | COP 28 350 200                      | 7 981                            | 0,19                      | 6,000 % éch. 07/05/2036                                | \$ 2 900                            | 2 897                                     | 0,07        | 21,322 % éch. 28/07/2026 (c)(d)      | 131 814                          | 94                        | 0,00 |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                          | 4 067 800                           | 1 159                            | 0,03                      | Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap                 |                                     |                                           |             | 21,450 % éch. 07/07/2026 (c)(d)      | 104 100                          | 76                        | 0,00 |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                          | 22 250 700                          | 6 733                            | 0,16                      | 0,875 % éch. 21/03/2046                                | € 10 000                            | 6 378                                     | 0,15        | 21,480 % éch. 28/07/2026 (c)(d)      | 164 800                          | 118                       | 0,01 |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                                          | 24 746 600                          | 7 574                            | 0,18                      | New South Wales Treasury Corp.                         |                                     |                                           |             | 21,587 % éch. 04/08/2026 (c)(d)      | 24 800                           | 18                        | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain             |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 20/03/2034                                | AUD 8 900                           | 4 862                                     | 0,11        | 21,625 % éch. 11/08/2026 (c)(d)      | 190 000                          | 135                       | 0,01 |
| 5,950 % éch. 27/04/2033                                           | € 300                               | 366                              | 0,01                      | 2,000 % éch. 08/03/2033                                | 1 000                               | 577                                       | 0,01        | 21,638 % éch. 11/08/2026 (c)(d)      | 124 900                          | 89                        | 0,00 |
| CPPIB Capital, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 20/02/2037                                | 2 300                               | 1 511                                     | 0,04        | 21,659 % éch. 25/08/2026 (c)(d)      | 72 900                           | 51                        | 0,00 |
| 4,300 % éch. 02/06/2034                                           | CAD 1 500                           | 1 110                            | 0,03                      | Obligation internationale du gouvernement paraguayen   |                                     |                                           |             | 21,675 % éch. 18/08/2026 (c)(d)      | 41 600                           | 29                        | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien                |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 28/04/2031                                | \$ 1 196                            | 1 201                                     | 0,03        | 21,676 % éch. 11/08/2026 (c)(d)      | 149 000                          | 106                       | 0,00 |
| 21,954 % éch. 04/03/2028                                          | EGP 211 800                         | 4 179                            | 0,10                      | Obligation internationale du gouvernement péruvien     |                                     |                                           |             | 21,690 % éch. 07/07/2026 (c)(d)      | 95 000                           | 69                        | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                           | 6,150 % éch. 12/08/2032                                | PEN 22 280                          | 7 077                                     | 0,17        | 21,699 % éch. 25/08/2026 (c)(d)      | 57 000                           | 40                        | 0,00 |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | \$ 4 300                            | 4 286                            | 0,10                      | 6,850 % éch. 12/08/2035                                | 9 500                               | 2 932                                     | 0,07        |                                      |                                  |                           |      |
| 4,875 % éch. 30/04/2029                                           | 2 100                               | 2 116                            | 0,05                      | 6,950 % éch. 12/08/2031                                | 17 520                              | 5 845                                     | 0,14        |                                      |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 30/04/2034                                           | 2 200                               | 2 238                            | 0,05                      | 7,300 % éch. 12/08/2033                                | 91 720                              | 30 135                                    | 0,71        |                                      |                                  |                           |      |
| Union européenne                                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement polonais     |                                     |                                           |             | Total des Instruments à court terme  |                                  |                           |      |
| 0,000 % éch. 04/10/2028 (c)                                       | € 1 678                             | 1 809                            | 0,04                      | 5,125 % éch. 18/09/2034                                | \$ 4 200                            | 4 226                                     | 0,10        | Total des Valeurs mobilières         |                                  |                           |      |
| 2,875 % éch. 05/10/2029                                           | 16 300                              | 18 740                           | 0,44                      | Province du Québec                                     |                                     |                                           |             | \$ 5 627 003                         |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois                |                                     |                                  |                           | 4,450 % éch. 01/09/2034                                | CAD 12 800                          | 9 545                                     | 0,23        | 133,22                               |                                  |                           |      |
| 1,750 % éch. 05/06/2035                                           | 10 000                              | 9 654                            | 0,23                      | Obligation internationale du gouvernement qatari       |                                     |                                           |             | ACTIONS                              |                                  |                           |      |
| 4,500 % éch. 16/06/2034                                           | 5 000                               | 5 986                            | 0,14                      | 4,800 % éch. 08/04/2033                                | \$ 2 500                            | 2 513                                     | 0,06        | FONDS D'INVESTISSEMENT               |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement israélien               |                                     |                                  |                           | Queensland Treasury Corp.                              |                                     |                                           |             | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF    |                                  |                           |      |
| 5,000 % éch. 30/10/2026                                           | 4 000                               | 4 604                            | 0,11                      | 1,500 % éch. 20/08/2032                                | AUD 7 000                           | 3 988                                     | 0,09        | PIMCO Funds: Global Investors Series |                                  |                           |      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                 |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 22/08/2035                                | 1 700                               | 1 114                                     | 0,03        | plc - Fonds PIMCO Emerging           |                                  |                           |      |
| 1,300 % éch. 15/05/2028 (e)                                       | 47 341                              | 54 271                           | 1,28                      | Obligation internationale du gouvernement roumain      |                                     |                                           |             | Markets Opportunities Fund (g)       |                                  |                           |      |
| Japan Finance Organization for Municipalities                     |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 27/02/2027                                | \$ 12 000                           | 11 857                                    | 0,28        | 981 265                              |                                  |                           |      |
| 0,010 % éch. 02/02/2028                                           | 9 900                               | 10 823                           | 0,26                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien     |                                     |                                           |             | 15 357                               |                                  |                           |      |
| 2,875 % éch. 23/01/2029                                           | 400                                 | 457                              | 0,01                      | 3,375 % éch. 05/03/2032                                | € 9 500                             | 10 726                                    | 0,25        | 0,36                                 |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 12/01/2029                                | \$ 14 800                           | 14 589                                    | 0,35        | PIMCO Funds: Global Investors Series |                                  |                           |      |
| 2,000 % éch. 20/12/2044                                           | ¥ 1 830 000                         | 8 929                            | 0,21                      | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                           |             | plc - Fonds US Short-Term            |                                  |                           |      |
| 2,100 % éch. 20/09/2054                                           | 124 600                             | 529                              | 0,01                      | 6,250 % éch. 31/03/2036                                | ZAR 20 500                          | 1 072                                     | 0,03        | Fund (g)                             |                                  |                           |      |
| 2,300 % éch. 20/12/2054                                           | 1 453 400                           | 6 471                            | 0,15                      | 7,100 % éch. 19/11/2036                                | \$ 8 200                            | 8 809                                     | 0,21        | 11 122 124                           |                                  |                           |      |
| 2,400 % éch. 20/03/2045                                           | 1 117 400                           | 5 800                            | 0,14                      | 8,500 % éch. 31/01/2037                                | ZAR 125 100                         | 7 604                                     | 0,18        | 114 224                              |                                  |                           |      |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                                           | 1 993 000                           | 9 088                            | 0,22                      | 8,750 % éch. 31/01/2044                                | 4 740                               | 284                                       | 0,01        | 0,15                                 |                                  |                           |      |
| 2,700 % éch. 20/09/2045                                           | 97 950                              | 530                              | 0,01                      | 8,750 % éch. 28/02/2048                                | 20 300                              | 1 218                                     | 0,03        | PIMCO Select Funds plc - Fonds       |                                  |                           |      |
| 2,800 % éch. 20/06/2055                                           | 1 310 000                           | 6 522                            | 0,15                      | 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 495 630                             | 31 339                                    | 0,74        | PIMCO US Dollar Short-Term           |                                  |                           |      |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                                           | 1 615 000                           | 8 725                            | 0,21                      | 9,000 % éch. 31/01/2040                                | 24 373                              | 1 504                                     | 0,04        | Floating NAV Fund (g)                |                                  |                           |      |
| 3,700 % éch. 20/03/2056                                           | 711 600                             | 4 232                            | 0,10                      | Gouvernement de la métropole de Tokyo                  |                                     |                                           |             | 639 841                              |                                  |                           |      |
| Banque de développement coréenne                                  |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 30/04/2031                                | \$ 6 200                            | 6 132                                     | 0,15        | 6 381                                |                                  |                           |      |
| 4,330 % éch. 23/10/2026                                           | \$ 1 800                            | 1 806                            | 0,04                      | Treasury Corp. of Victoria                             |                                     |                                           |             | \$135 962                            |                                  |                           |      |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït               |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 20/11/2037                                | AUD 7 800                           | 3 793                                     | 0,09        | 3,22                                 |                                  |                           |      |
| 4,016 % éch. 09/10/2028                                           | 2 400                               | 2 369                            | 0,06                      | 2,250 % éch. 15/09/2033                                | 3 200                               | 1 843                                     | 0,04        | Total des Fonds d'investissement     |                                  |                           |      |
| 4,136 % éch. 09/10/2030                                           | 2 400                               | 2 356                            | 0,06                      | Bon du Trésor britannique                              |                                     |                                           |             |                                      |                                  |                           |      |
| 4,652 % éch. 09/10/2035                                           | 1 800                               | 1 760                            | 0,04                      | 0,875 % éch. 31/07/2033                                | £ 1 300                             | 1 347                                     | 0,03        |                                      |                                  |                           |      |
| 4,804 % éch. 20/04/2033 (i)                                       | 4 200                               | 4 193                            | 0,10                      | 3,750 % éch. 07/03/2027                                | 49 800                              | 65 967                                    | 1,56        |                                      |                                  |                           |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 31/07/2054                                | 19 019                              | 21 218                                    | 0,50        |                                      |                                  |                           |      |
|                                                                   |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     | 536 784                                   | 12,71       |                                      |                                  |                           |      |
| INSTRUMENTS À COURT TERME                                         |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                           |             |                                      |                                  |                           |      |
| BILLETS À COURT TERME                                             |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                           |             |                                      |                                  |                           |      |
| Kona Spc Ltd.                                                     |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                           |             |                                      |                                  |                           |      |
| 5,718 % éch. 15/09/2026                                           | € 2 000                             | 2 288                            | 0,05                      |                                                        |                                     |                                           |             |                                      |                                  |                           |      |

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)**

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026           | 85                 | \$ 95                                   | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Long  | 09/2026           | 158                | 130                                     | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026           | 1 502              | (881)                                   | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 1 353              | (2 083)                                 | (0,05)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 456                | (106)                                   | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 7 533              | 1 724                                   | 0,04                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 4 174              | 3 862                                   | 0,09                |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 7                  | 12                                      | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 36                 | (98)                                    | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 591                | (1 667)                                 | (0,04)              |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 723                | 2 055                                   | 0,05                |
|                                                                                               |       |                   |                    | \$ 3 043                                | 0,07                |

## Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|----------|--------------|---------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | \$ 108,000      | 24/07/2026        | 51                 | \$ (14)  | \$ (4)       | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 108,500         | 24/07/2026        | 46                 | (16)     | (6)          | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026    | 109,500         | 24/07/2026        | 58                 | (14)     | (22)         | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026     | 111,000         | 24/07/2026        | 155                | (41)     | (15)         | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,250         | 02/07/2026        | 48                 | (8)      | 0            | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750         | 02/07/2026        | 103                | (18)     | 0            | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250         | 02/07/2026        | 48                 | (9)      | (3)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500         | 02/07/2026        | 103                | (19)     | (2)          | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000         | 10/07/2026        | 47                 | (7)      | (4)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750         | 10/07/2026        | 47                 | (7)      | (1)          | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250         | 17/07/2026        | 59                 | (9)      | (13)         | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000         | 17/07/2026        | 59                 | (11)     | (3)          | 0,00                |
|                                                                                                           |                 |                   |                    | \$ (173) | \$ (73)      | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                                |                 |                   |                    |          | \$ 2 970     | 0,07                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence          | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc.                   | 1,000 %              | 20/12/2027      | \$ 6 300                         | \$ (12)                           | 0,00                |
| Boeing Co.                   | 1,000                | 20/12/2027      | 4 600                            | 252                               | 0,01                |
| Boeing Co.                   | 1,000                | 20/12/2029      | 400                              | 14                                | 0,00                |
| Boeing Co.                   | 1,000                | 20/12/2030      | 13 200                           | 35                                | 0,00                |
| Deutsche Bank AG             | 1,000                | 20/12/2030      | € 1 150                          | 12                                | 0,00                |
| Oracle Corp.                 | 1,000                | 20/06/2030      | \$ 7 400                         | (273)                             | (0,01)              |
| T-Mobile USA, Inc.           | 5,000                | 20/06/2028      | 6 700                            | (539)                             | (0,01)              |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2027      | 500                              | 10                                | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/06/2028      | 5 000                            | 58                                | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                | 20/12/2028      | 1 200                            | 20                                | 0,00                |
|                              |                      |                 |                                  | \$ (423)                          | (0,01)              |

### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans             | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 207 520                       | \$ 187                            | 0,01                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                | 20/06/2031      | 540 795                          | 2 032                             | 0,05                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | € 19 120                         | 139                               | 0,00                |
|                                            |                      |                 |                                  | \$ 2 358                          | 0,06                |

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 0,900 %   | 15/03/2052      | £ 8 400           | \$ 5 684                          | 0,14                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      | 21 020            | 632                               | 0,02                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036      | 41 700            | 260                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 4 790             | 248                               | 0,01                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056      | 4 200             | 47                                | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,250     | 18/06/2032      | ¥ 9 120 000       | 772                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,750     | 21/12/2052      | \$ 60 600         | 12 084                            | 0,29                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,050     | 14/12/2052      | 9 570             | 1 880                             | 0,05                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,156     | 10/03/2033      | 16 530            | 518                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2030      | 54 700            | 555                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2055      | 3 900             | 249                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/03/2031      | 14 500            | 346                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 20/06/2054      | 90 500            | 7 896                             | 0,19                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 18/12/2054      | 9 800             | 924                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 2 900             | 115                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,613     | 15/08/2033      | 38 890            | 893                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,642     | 15/02/2055      | 3 600             | 338                               | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,655     | 15/02/2055      | 1 800             | 165                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,687     | 15/08/2033      | 109 900           | 1 951                             | 0,05                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      | 8 122             | 150                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,748     | 03/03/2036      | 6 000             | 137                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 20/06/2029      | 9 800             | 137                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 73 500            | 1 778                             | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 15/05/2032      | 18 061            | 181                               | 0,00                |



| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750 %   | 17/06/2036      | \$ 7 500          | \$ (44)                           | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 2 000             | 10                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,765     | 17/12/2054      | 5 000             | 364                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,775     | 03/03/2036      | 5 900             | 122                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,807     | 31/05/2028      | 24 700            | 88                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,807     | 15/02/2055      | 1 900             | 125                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,836     | 02/05/2035      | 14 300            | 257                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,842     | 04/03/2030      | 5 400             | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,899     | 11/03/2035      | 3 180             | 28                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,930     | 24/03/2035      | 6 100             | 38                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,975     | 21/03/2035      | 3 600             | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      | 9 300             | 32                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 18/03/2036      | 900               | 24                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 17/06/2056      | 105 920           | 322                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,083     | 15/11/2053      | 1 800             | 38                                | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 11,496    | 04/01/2027      | 100               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 11,528    | 04/01/2027      | 64 800            | (545)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 11,548    | 04/01/2027      | 195 600           | (1 624)                           | (0,04)              |
| À recevoir                                         | CDI BRL à un an                   | 13,000    | 02/01/2029      | 36 900            | 192                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | CDI BRL à un an                   | 13,017    | 02/01/2029      | 152 000           | 781                               | 0,02                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,291    | 02/01/2029      | 84 200            | (373)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,320    | 02/01/2029      | 8 900             | (39)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,354    | 02/01/2029      | 12 100            | (50)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,400    | 02/01/2029      | 110 800           | (399)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,657    | 02/01/2031      | 67 600            | (92)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,681    | 02/01/2031      | 20 100            | (17)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,725    | 02/01/2031      | 650               | (1)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,899    | 02/01/2031      | 5 300             | (3)                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,926    | 04/01/2027      | 15 800            | (25)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,927    | 04/01/2027      | 152 500           | (242)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,009    | 04/01/2027      | 10 100            | (14)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,035    | 02/01/2031      | 226 920           | 185                               | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,067    | 02/01/2031      | 41 300            | 11                                | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 14,375    | 02/01/2031      | 13 100            | 23                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,740     | 01/06/2034      | CAD 3 000         | 39                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2033      | 3 100             | (19)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 01/06/2034      | 5 400             | 4                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500     | 01/06/2032      | 44 100            | (664)                             | (0,02)              |
| À payer                                            | BBR NZD à 3 mois                  | 3,750     | 15/06/2027      | NZD 39 100        | 655                               | 0,02                |
| À payer                                            | BBR NZD à 3 mois                  | 4,250     | 21/12/2027      | 3 300             | 26                                | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,000     | 19/03/2035      | AUD 14 800        | (568)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 20/09/2033      | 10 900            | 49                                | 0,00                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 20/03/2034      | 12 000            | 215                               | 0,01                |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,500     | 18/09/2034      | 22 400            | (367)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 0,650     | 12/04/2027      | € 25 000          | (411)                             | (0,01)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 1,000     | 13/05/2027      | 18 900            | (279)                             | (0,01)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,050     | 05/10/2029      | 3 100             | 39                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,056     | 05/10/2029      | 5 200             | 64                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,063     | 05/10/2029      | 8 000             | 97                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,300     | 25/09/2029      | 4 500             | 16                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,350     | 29/04/2030      | 2 700             | 46                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,400     | 09/04/2030      | 3 300             | 50                                | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,410     | 05/11/2034      | 2 500             | (54)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,420     | 07/03/2035      | 1 790             | (63)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,460     | 13/03/2035      | 2 000             | (63)                              | 0,00                |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,610     | 24/03/2035      | 1 900             | (36)                              | 0,00                |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 83 010            | (861)                             | (0,02)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,760     | 03/01/2029      | 2 300             | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 36 220            | (21)                              | 0,00                |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours               | 7,750     | 01/04/2030      | MXN 58 400        | 26                                | 0,00                |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 35 056                         | 0,83                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 36 991                         | 0,88                |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

| Contrepartie | Description                                              | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût     | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| CBK          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,500 %         | 13/07/2026        | 160 800                          | \$ 354   | \$ 1         | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,660           | 29/12/2026        | 109 200                          | 189      | 196          | 0,01                |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,500           | 20/07/2026        | 167 300                          | 329      | 4            | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois    | À payer                          | 2,400           | 29/12/2026        | 212 000                          | 133      | 142          | 0,00                |
|              |                                                          |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ 1 005 | \$ 343       | 0,01                |

#### OPTIONS VENDUES

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 3 501                            | \$ (12) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 6 208                            | (14)    | 0            | 0,00                |
| MBC          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 09/07/2026        | 9 017                            | (29)    | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 10/07/2026        | 8 995                            | (23)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (78) | \$ 0         | 0,00                |

#### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime    | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| CBK          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,000 %         | 13/07/2026        | 160 800                          | \$ (138) | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,250           | 13/07/2026        | 160 800                          | (177)    | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,943           | 29/12/2026        | 12 560                           | (189)    | (190)        | (0,01)              |
| DUB          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,080           | 20/07/2026        | 167 300                          | (128)    | (1)          | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote    | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,290           | 20/07/2026        | 167 300                          | (201)    | (1)          | 0,00                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004           | 08/07/2026        | 2 400                            | (6)      | (6)          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 2 400                            | (6)      | 0            | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,690           | 29/12/2026        | 12 190                           | (67)     | (70)         | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | EURIBOR EUR à 6 mois    | À recevoir                       | 2,702           | 29/12/2026        | 12 190                           | (66)     | (74)         | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,875           | 24/07/2026        | 2 800                            | (7)      | (4)          | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,135           | 24/07/2026        | 2 800                            | (7)      | (7)          | 0,00                |
| MYC          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,150           | 01/07/2026        | 6 400                            | (5)      | 0            | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (997) | \$ (353)     | (0,01)              |

#### OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description                                                                                                        | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GSC          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/07/2056 | \$ 92,891       | 06/07/2026        | 3 400                            | \$ (14) | \$ (2)       | 0,00                |
| JPM          | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) hors cote, TBA 4,000 % éch. 01/08/2056 | 89,641          | 06/08/2026        | 5 200                            | (27)    | (2)          | 0,00                |
|              |                                                                                                                    |                 |                   |                                  | \$ (41) | \$ (4)       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                 | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 %              | 20/06/2027      | \$ 1 600                         | \$ (77)                | \$ 85                            | \$ 8         | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2027      | 400                              | (36)                   | 38                               | 2            | 0,00                |
| BRC          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2026      | 2 325                            | (108)                  | 115                              | 7            | 0,00                |
| CBK          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 700                              | (25)                   | 28                               | 3            | 0,00                |
| GST          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 3 000                            | (112)                  | 127                              | 15           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2027      | 1 300                            | (116)                  | 123                              | 7            | 0,00                |
| JPM          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2026      | 2 275                            | (104)                  | 111                              | 7            | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 400                              | (15)                   | 17                               | 2            | 0,00                |
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/06/2027      | 2 900                            | (104)                  | 118                              | 14           | 0,00                |
|              | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000                | 20/12/2027      | 3 400                            | (303)                  | 322                              | 19           | 0,00                |
|              |                                                     |                      |                 |                                  | \$ (1 000)             | \$ 1 084                         | \$ 84        | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 9 880                          | \$ 2 224               | \$ (121)                         | \$ 2 103     | 0,05                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 17 600                           | 3 881                  | (136)                            | 3 745        | 0,09                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 8 000                            | 1 820                  | (118)                            | 1 702        | 0,04                |

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 2 800                          | \$ 570                 | \$ 26                            | \$ 596       | 0,01                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 42 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2029      | 1 343                            | 267                    | (25)                             | 242          | 0,01                |
|              | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 15 960                           | 3 438                  | (42)                             | 3 396        | 0,08                |
| MYC          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 1 640                            | 381                    | (32)                             | 349          | 0,01                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 12 581              | \$ (448)                         | \$ 12 133    | 0,29                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 28 561      | \$ 20 423         | \$ 636             | \$ 0                  | \$ 636                                 | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH 2 506       | 371               | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 16 735      | 9 883             | 364                | 0                     | 364                                    | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 788          | CAD 1 120         | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 10 325          | NZD 18 278        | 72                 | 0                     | 72                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD 1 118       | \$ 788            | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 18 278      | 10 337            | 0                  | (72)                  | (72)                                   | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | BRL 365         | 70                | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 5 901       | 7 315             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | COP 9 063       | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 1 530       | 16                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 76 354        | 480               | 10                 | 0                     | 10                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 8 405       | 850               | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 16 863      | 4 992             | 48                 | 0                     | 48                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 41          | 32                | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 2 066        | CNH 13 971        | 0                  | (8)                   | (8)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 026           | € 2 600           | 0                  | (54)                  | (54)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 251             | KRW 382 212       | 0                  | (4)                   | (4)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 527           | NOK 14 186        | 0                  | (94)                  | (94)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 289             | PLN 1 090         | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | HKD 2 146       | \$ 274            | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 3 862       | 1 298             | 1                  | 0                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 43 767      | 12 727            | 0                  | (79)                  | (79)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 15 443 222  | 4 230             | 0                  | (172)                 | (172)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 229 623     | 13 113            | 58                 | (3)                   | 55                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 430          | INR 40 850        | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 10/2026           | 3               | COP 9 277         | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | BRL 27 483      | \$ 5 281          | 4                  | (33)                  | (29)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 12 023      | 8 490             | 16                 | 0                     | 16                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF 1 757       | 2 234             | 55                 | 0                     | 55                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 12 181      | 1 800             | 6                  | 0                     | 6                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 2 257       | 108               | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 6 949         | 7 885             | 0                  | (60)                  | (60)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 267 739 526 | 14 933            | 11                 | (10)                  | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 5 744       | 1 949             | 20                 | 0                     | 20                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 439 892     | 4 580             | 0                  | (67)                  | (67)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 269 478     | 7 949             | 138                | 0                     | 138                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW 2 193 038   | 1 436             | 19                 | 0                     | 19                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 7 025       | 714               | 4                  | 0                     | 4                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 16 372      | 12 668            | 10                 | 0                     | 10                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB 67 399      | 2 052             | 25                 | (4)                   | 21                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 12 857       | BRL 66 371        | 0                  | (34)                  | (34)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 555           | CAD 3 527         | 0                  | (69)                  | (69)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 5 176           | € 4 460           | 0                  | (77)                  | (77)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9 264           | £ 6 984           | 19                 | (13)                  | 6                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 220           | IDR 39 556 949    | 0                  | (18)                  | (18)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 909           | ILS 8 474         | 0                  | (65)                  | (65)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 22 621          | INR 2 143 605     | 34                 | (47)                  | (13)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 418           | ¥ 229 500         | 0                  | (6)                   | (6)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 876           | KRW 5 950 473     | 0                  | (32)                  | (32)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 175             | KWD 53            | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14              | TWD 455           | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 44 227      | \$ 2 696          | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 1 078       | 361               | 0                  | (1)                   | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 2 126        | BRL 10 830        | 0                  | (50)                  | (50)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 26 530 626  | \$ 1 461          | 0                  | (10)                  | (10)                                   | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN 31 686      | 1 802             | 0                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 55 588      | 1 714             | 30                 | 0                     | 30                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 693          | COP 2 536 074     | 29                 | 0                     | 29                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | 8 437           | IDR 149 352 512   | 10                 | (168)                 | (158)                                  | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 225           | INR 116 358       | 0                  | (4)                   | (4)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 340             | THB 11 155        | 0                  | (2)                   | (2)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | 926             | IDR 16 861 513    | 2                  | 0                     | 2                                      | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BRC          | 06/2027           | \$ 266          | KWD 81            | \$ 0               | \$ (3)                | \$ (3)                                  | 0,00                |
|              | 07/2029           | KWD 105         | \$ 360            | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 06/2031           | 265             | 891               | 24                 | 0                     | 24                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 7 136       | 2 411             | 15                 | 0                     | 15                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 228 749       | 1 415             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD 24 308      | 14 376            | 548                | 0                     | 548                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | TRY 111 287     | 2 324             | 0                  | (29)                  | (29)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 27 189       | TRY 1 297 957     | 297                | 0                     | 297                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | ZAR 218 425     | \$ 13 448         | 142                | 0                     | 142                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 415        | ¥ 228 149         | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| BSH          | 07/2026           | € 4 682         | \$ 5 459          | 106                | 0                     | 106                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 1 368 658     | 8 608             | 187                | 0                     | 187                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 17 887       | NZD 31 659        | 122                | 0                     | 122                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD 31 659      | \$ 17 907         | 0                  | (122)                 | (122)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 4 731       | 1 397             | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 25 281       | BRL 128 991       | 0                  | (554)                 | (554)                                   | (0,01)              |
|              | 07/2026           | BRL 29 487      | \$ 5 823          | 145                | 0                     | 145                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS 6 404       | 2 205             | 54                 | 0                     | 54                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 297 862     | 3 157             | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NOK 7 495       | 808               | 51                 | 0                     | 51                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | \$ 2 928        | COP 10 274 785    | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 076           | € 1 781           | 0                  | (40)                  | (40)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 2 547           | IDR 45 690 798    | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 3 074           | INR 297 862       | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 744           | ¥ 766 600         | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 346             | KRW 522 729       | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 4 083           | PEN 13 801        | 0                  | (38)                  | (38)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 549           | PLN 5 661         | 0                  | (43)                  | (43)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 564             | SEK 5 212         | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 12 412      | \$ 4 324          | 154                | 0                     | 154                                     | 0,00                |
| DUB          | 08/2026           | \$ 672          | ILS 1 997         | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 96 858 885  | \$ 5 365          | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR 29 935      | 311               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 7 263       | 2 101             | 0                  | (23)                  | (23)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 78 336      | 2 365             | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 795        | COP 6 567 429     | 77                 | 0                     | 77                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 750           | IDR 31 213 370    | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | 755             | MXN 13 514        | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | 20              | PEN 69            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 10/2026           | COP 3 493 255   | \$ 980            | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
| FAR          | 10/2026           | PEN 13 858      | 4 083             | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | COP 7 055 639   | 1 948             | 0                  | (33)                  | (33)                                    | 0,00                |
|              | 12/2026           | PEN 24 012      | 6 869             | 0                  | (128)                 | (128)                                   | 0,00                |
|              | 12/2026           | \$ 2 819        | IDR 51 245 505    | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           | PEN 15 969      | \$ 4 686          | 38                 | 0                     | 38                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 7 389       | 1 086             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CZK 2 439       | 117               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR 6 117 099   | 342               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR 143 013     | 1 514             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | RON 1 180       | 261               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | \$ 1 011        | INR 97 483        | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 635             | NOK 5 903         | 0                  | (39)                  | (39)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 548           | PLN 5 742         | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 101 569     | \$ 6 274          | 87                 | 0                     | 87                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 59 320 563  | 3 292             | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | PEN 68          | 19                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 074        | IDR 19 507 532    | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 1 514           | INR 143 982       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH 12 119      | \$ 1 791          | 6                  | 0                     | 6                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 214 449       | 288 140           | 3 513              | 0                     | 3 513                                   | 0,08                |
| GLM          | 07/2026           | INR 135 379     | 1 435             | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 31 746        | 200               | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | PEN 13 793      | 4 079             | 37                 | 0                     | 37                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SEK 3 102       | 320               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD 73 167      | 57 351            | 784                | 0                     | 784                                     | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$ 7 963        | CNH 54 164        | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 7 925           | € 6 949           | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 1 419           | INR 135 379       | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | 38 264          | ¥ 6 191 072       | 0                  | (171)                 | (171)                                   | 0,00                |
|              | 07/2026           | 6 793           | PLN 24 942        | 0                  | (158)                 | (158)                                   | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | 3               | SGD 4             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR 144 695     | \$ 8 768          | 0                  | (46)                  | (46)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH 54 045      | 7 963             | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 6 949         | 7 936             | 0                  | (19)                  | (19)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS 7 696       | 2 688             | 103                | 0                     | 103                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 6 174 871     | 38 264            | 172                | 0                     | 172                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | PEN 19 226      | 5 687             | 56                 | 0                     | 56                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 320          | SEK 3 096         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | 10 355          | BRL 53 243        | 0                  | (221)                 | (221)                                   | (0,01)              |
|              | 09/2026           | 693             | INR 66 426        | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |
| GLM          | 09/2026           | 613             | MXN 10 827        | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL 122 101     | \$ 23 716         | 126                | 0                     | 126                                     | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | COP 29 584 956  | 7 664             | 0                  | (878)                 | (878)                                   | (0,02)              |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| JPM          | 07/2026           | KRW             | 975 312           | \$ 632             | \$ 2                  | \$ 0                                    | \$ 2                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 15 135            | BRL 79 770         | 403                   | (127)                                   | 276                 | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 75 755            | CAD 107 799        | 227                   | 0                                       | 227                 | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 7 659             | COP 26 682 869     | 56                    | (12)                                    | 44                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 449             | IDR 43 902 430     | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 632               | KRW 975 173        | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 018             | PLN 22 443         | 0                     | (48)                                    | (48)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 107 646           | \$ 75 755          | 0                     | (227)                                   | (227)               | (0,01) |
|              | 08/2026           | \$              | 3 458             | BRL 17 669         | 0                     | (70)                                    | (70)                | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 971               | INR 93 164         | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 44 159 527        | \$ 2 449           | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 59 896            | 3 402              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 173 606           | 5 380              | 121                   | 0                                       | 121                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 4 604             | BRL 23 698         | 0                     | (93)                                    | (93)                | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 5 010             | IDR 89 964 249     | 11                    | (34)                                    | (23)                | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 3 933             | INR 378 188        | 36                    | 0                                       | 36                  | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 26 483            | MXN 464 792        | 0                     | (51)                                    | (51)                | 0,00   |
|              | 10/2026           |                 | 23 716            | BRL 124 788        | 0                     | (126)                                   | (126)               | 0,00   |
|              | 11/2026           | COP             | 27 476 301        | \$ 7 659           | 9                     | (58)                                    | (49)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 123 622           | 88 130             | 2 484                 | 0                                       | 2 484               | 0,06   |
|              | 07/2026           | CNH             | 13 373            | 1 973              | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 18 200            | 6 095              | 0                     | (14)                                    | (14)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 42 618            | 451                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 301 378           | 195                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 17 183            | 1 736              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 439               | 259                | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 7 126             | € 6 119            | 0                     | (130)                                   | (130)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 609             | £ 1 199            | 0                     | (18)                                    | (18)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 372               | IDR 6 689 958      | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 452               | INR 42 618         | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 291               | KRW 447 434        | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 144             | NZD 2 028          | 10                    | 0                                       | 10                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 6 371             | PLN 23 243         | 1                     | (189)                                   | (188)               | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 358             | THB 45 386         | 9                     | 0                                       | 9                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | HKD             | 7 973             | \$ 1 019           | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 47 272            | 16 119             | 238                   | 0                                       | 238                 | 0,01   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 736             | NOK 17 190         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 6 953 113         | \$ 385             | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 13 249            | 751                | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 288 635           | 8 818              | 89                    | (14)                                    | 75                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 2 939             | COP 10 750 602     | 125                   | 0                                       | 125                 | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 3 373             | INR 321 565        | 1                     | (1)                                     | 0                   | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 31 640            | MXN 551 044        | 0                     | (303)                                   | (303)               | (0,01) |
| MBC          | 12/2026           | MXN             | 1 149             | \$ 66              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 12/2026           | \$              | 10 238            | MXN 180 717        | 0                     | (34)                                    | (34)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 571             | \$ 1 808           | 27                    | 0                                       | 27                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 309               | 221                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 19 239            | 24 408             | 580                   | (23)                                    | 557                 | 0,01   |
|              | 07/2026           | COP             | 7 345 757         | 1 939              | 0                     | (182)                                   | (182)               | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 3 560             | 4 081              | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 170               | 228                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 604 188           | 34                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 143 578           | 1 520              | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 1 275 311         | 8 026              | 179                   | 0                                       | 179                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | NOK             | 5 618             | 566                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | NZD             | 12 311            | 7 056              | 53                    | 0                                       | 53                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | SEK             | 1 894             | 195                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 60 878            | AUD 88 098         | 237                   | (81)                                    | 156                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 15 257            | € 13 108           | 0                     | (271)                                   | (271)               | (0,01) |
|              | 07/2026           |                 | 2 344             | INR 225 955        | 39                    | 0                                       | 39                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 4 340             | KRW 6 578 779      | 0                     | (91)                                    | (91)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 723             | NOK 25 754         | 0                     | (121)                                   | (121)               | 0,00   |
|              | MYI               | 07/2026         |                   | 1 032              | NZD 1 829             | 8                                       | 0                   | 8      |
| 08/2026      |                   | AUD             | 82 155            | \$ 56 651          | 0                     | (232)                                   | (232)               | (0,01) |
| 08/2026      |                   | ILS             | 446               | 149                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |
| 08/2026      |                   | \$              | 337               | NOK 3 350          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| 08/2026      |                   |                 | 195               | SEK 1 891          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| 09/2026      |                   | THB             | 51 700            | \$ 1 548           | 0                     | (18)                                    | (18)                | 0,00   |
| 09/2026      |                   | \$              | 6 253             | INR 598 171        | 29                    | (8)                                     | 21                  | 0,00   |
| 07/2026      |                   | £               | 10                | \$ 13              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   | \$              | 575               | € 504              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| 07/2026      |                   |                 | 106               | £ 80               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |
| NSL          | 12/2026           | PEN             | 15 969            | \$ 4 614           | 0                     | (40)                                    | (40)                | 0,00   |
|              | 01/2027           | \$              | 4 605             | PEN 15 969         | 42                    | 0                                       | 42                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 279             | IDR 40 636 992     | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 371             | INR 228 054        | 37                    | 0                                       | 37                  | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           |                 | 2 662             | TRY 125 199        | 8                     | 0                                       | 8                   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 40 864 892        | \$ 2 279           | 14                    | 0                                       | 14                  | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 1 071             | IDR 19 056 433     | 0                     | (15)                                    | (15)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 5 439             | \$ 6 336           | 118                   | 0                                       | 118                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 865               | IDR 15 516 988     | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 120             | INR 299 037        | 37                    | 0                                       | 37                  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 2 417             | ¥ 384 000          | 0                     | (54)                                    | (54)                | 0,00   |

## Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |            | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|------------|-------------------|------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 07/2026           | \$              | 5 383      | KRW               | 7 699 175  | \$ 0               | \$ (410)              | \$ (410)                                | (0,01)              |
|              | 08/2026           | HKD             | 7 524      | \$                | 962        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 415      | INR               | 231 402    | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 46 536 598 | \$                | 2 578      | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 61 863     |                   | 1 916      | 42                 | 0                     | 42                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 2 730      | IDR               | 49 013 272 | 3                  | (17)                  | (14)                                    | 0,00                |
|              | 11/2026           | NGN             | 84 110     | \$                | 52         | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 20 564     |                   | 3 040      | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 648 742    |                   | 756 783    | 15 077             | 0                     | 15 077                                  | 0,36                |
|              | 07/2026           | ¥               | 3 320 891  |                   | 20 904     | 470                | 0                     | 470                                     | 0,01                |
|              | 07/2026           | PEN             | 3 693      |                   | 1 091      | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 45 992     | AUD               | 66 656     | 187                | 0                     | 187                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 32         | CAD               | 44         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 716        | CHF               | 579        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 721 740    | €                 | 634 490    | 3 678              | (6)                   | 3 672                                   | 0,09                |
|              | 07/2026           |                 | 69 174     | SGD               | 89 592     | 93                 | 0                     | 93                                      | 0,00                |
| SSB          | 08/2026           | AUD             | 66 656     | \$                | 45 963     | 0                  | (189)                 | (189)                                   | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 577        |                   | 716        | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | €               | 634 210    |                   | 722 393    | 0                  | (3 672)               | (3 672)                                 | (0,09)              |
|              | 08/2026           | SGD             | 89 390     |                   | 69 174     | 0                  | (96)                  | (96)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 25 080     |                   | 4 901      | 72                 | 0                     | 72                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD             | 102 050    |                   | 74 006     | 2 077              | 0                     | 2 077                                   | 0,05                |
|              | 07/2026           | CHF             | 605        |                   | 770        | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 696        | CAD               | 986        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 272 879    | £                 | 206 436    | 1 113              | 0                     | 1 113                                   | 0,03                |
|              | 08/2026           | CAD             | 985        | \$                | 696        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | COP             | 10 979 598 |                   | 2 879      | 0                  | (272)                 | (272)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | £               | 206 436    |                   | 272 874    | 0                  | (1 112)               | (1 112)                                 | (0,03)              |
|              | 07/2026           | SGD             | 5          |                   | 4          | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 1          | HKD               | 10         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 575      | PLN               | 5 756      | 0                  | (44)                  | (44)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 60 387 039 | \$                | 15 649     | 0                  | (1 563)               | (1 563)                                 | (0,04)              |
|              | 09/2026           | MXN             | 5 043      |                   | 288        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 7 347      |                   | 224        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| WST          | 09/2026           | \$              | 4          | THB               | 124        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 33 346     | CHF               | 26 923     | 30                 | 0                     | 30                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CHF             | 26 827     | \$                | 33 346     | 0                  | (31)                  | (31)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |            |                   |            | \$ 36 989          | \$ (14 097)           | \$ 22 892                               | 0,54                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |       | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CAD             | 1 996 | \$ 1 404          | \$ 0               | \$ (3)                | \$ (3)                                  | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 1 404 | CAD 1 993         | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           |                 | 2 467 | CAD 3 412         | 0                  | (63)                  | (63)                                    | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           |                 | 2     | 3                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | CAD             | 3 502 | \$ 2 461          | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 2 461 | CAD 3 497         | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | CAD             | 102   | \$ 72             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 583 | CAD 3 567         | 0                  | (69)                  | (69)                                    | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | CAD             | 1 180 | \$ 833            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 2 576 | CAD 3 552         | 0                  | (72)                  | (72)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 833   | 1 179             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |       |                   | \$ 11              | \$ (215)              | \$ (204)                                | 0,00                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| JPM          | 07/2026           | \$              | 4 288             | CHF 3 352          | \$ 0                  | \$ (133)                                | \$ (133)            | (0,01) |
| MBC          | 07/2026           | CHF             | 145               | \$ 180             | 2                     | (1)                                     | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 4 623             | CHF 3 620          | 0                     | (135)                                   | (135)               | 0,00   |
| SOG          | 07/2026           | CHF             | 3 534             | \$ 4 368           | 0                     | (13)                                    | (13)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 4 368             | CHF 3 521          | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,00   |
| SSB          | 07/2026           |                 | 4 532             | 3 563              | 0                     | (116)                                   | (116)               | 0,00   |
| UAG          | 07/2026           | CHF             | 92                | \$ 116             | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |
| WST          | 07/2026           |                 | 3 515             | 4 354              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 4 354             | CHF 3 503          | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |
|              |                   |                 |                   | \$ 21              | \$ (402)              | \$ (381)                                |                     | (0,01) |



Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 283           | \$ 330            | \$ 6               | \$ 0                  | \$ 6                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 3 053         | \$ 3 478          | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 322 435      | € 276 765         | 0                  | (6 010)               | (6 010)                                 | (0,14)              |
| BSH          | 07/2026           | € 327           | \$ 380            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 306 889      | € 263 213         | 0                  | (5 958)               | (5 958)                                 | (0,14)              |
| CBK          | 07/2026           | € 563           | \$ 656            | 13                 | 0                     | 13                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 199        | € 4 458           | 0                  | (103)                 | (103)                                   | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 256 628       | \$ 292 683        | 0                  | (719)                 | (719)                                   | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 293 078      | € 256 628         | 717                | 0                     | 717                                     | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | € 285 546       | \$ 324 564        | 166                | (2 067)               | (1 901)                                 | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 135          | € 116             | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 962           | \$ 1 099          | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 313 389      | € 275 547         | 2 065              | 0                     | 2 065                                   | 0,05                |
| SOG          | 07/2026           | € 275 547       | \$ 313 435        | 0                  | (1 598)               | (1 598)                                 | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 322 858      | € 276 765         | 0                  | (6 431)               | (6 431)                                 | (0,15)              |
|              | 08/2026           | 313 860         | 275 547           | 1 595              | 0                     | 1 595                                   | 0,04                |
| SSB          | 07/2026           | 718             | 629               | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 629           | \$ 719            | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 571           | \$ (22 905)           | \$ (18 334)                             | (0,43)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 9 285        | £ 6 916           | \$ 0               | \$ (106)              | \$ (106)                                | (0,01)              |
| BOA          | 07/2026           | £ 1             | \$ 1              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 6 263         | \$ 8 260          | 0                  | (53)                  | (53)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 10 129       | £ 7 560           | 0                  | (96)                  | (96)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 6             | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 8 227        | £ 6 238           | 53                 | 0                     | 53                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | £ 12            | \$ 16             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 55              | 72                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 517          | £ 385             | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 72              | 55                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | 9 858           | 7 346             | 0                  | (107)                 | (107)                                   | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | £ 26            | \$ 35             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 381          | £ 287             | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | £ 1 438         | \$ 1 892          | 0                  | (16)                  | (16)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 1 892        | £ 1 438           | 16                 | 0                     | 16                                      | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 7 280         | \$ 9 636          | 0                  | (26)                  | (26)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6            | £ 4               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 9 601           | 7 254             | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 7 261         | \$ 9 592          | 0                  | (45)                  | (45)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 9 592        | £ 7 261           | 45                 | 0                     | 45                                      | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 74            | \$ 97             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 97           | £ 74              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 143             | \$ (457)              | \$ (314)                                | (0,01)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et E en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 4 416        | SGD 5 631         | \$ 0               | \$ (63)               | \$ (63)                                 | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | SGD 1 810       | \$ 1 400          | 2                  | (1)                   | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 6 949        | SGD 8 874         | 0                  | (88)                  | (88)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 1 251           | 1 615             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD 20          | \$ 15             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | 2 386           | 1 863             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           | 1 253           | 968               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 5 036        | SGD 6 424         | 0                  | (70)                  | (70)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | 968             | 1 250             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | SGD 4 097       | \$ 3 159          | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 8 414        | SGD 10 735        | 0                  | (115)                 | (115)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 3 159           | 4 087             | 8                  | 0                     | 8                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | SGD 63          | \$ 49             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL          | 07/2026           | 889             | 686               | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 686          | SGD 887           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | SGD 20 437      | \$ 15 776         | 0                  | (25)                  | (25)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 16           | SGD 21            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | 15 749          | 20 357            | 26                 | 0                     | 26                                      | 0,00                |
| UAG          | 07/2026           | SGD 9           | \$ 7              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 146          | SGD 189           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 56              | \$ (371)              | \$ (315)                                | (0,01)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 15 547 0,37

## Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

### TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN</b>                       |                                     |                                  |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 01/07/2056                                        | \$ 1 500                            | \$ (1 198)                       | (0,03)                    |
| Total des Titres vendus à découvert                            |                                     | \$ (1 198)                       | (0,03)                    |
| Total des Investissements                                      |                                     | \$ 5 817 275                     | 137,73                    |
| Autres actifs et passifs à court terme                         |                                     | \$ (1 593 471)                   | (37,73)                   |
| Actif net                                                      |                                     | \$ 4 223 804                     | 100,00                    |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

- \* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- µ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (g) Affilié au Fonds.
- (h) Titre convertible conditionnel.
- (i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,33 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût      | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|--------------------|-----------------|-----------|-----------------|------------------------|
| Coastal Gaslink Pipeline LP                         | 5,857 % | 30/03/2049         | 04/06/2024      | \$ 1 023  | \$ 1 100        | 0,03                   |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804   | 20/04/2033         | 13/04/2026      | 4 200     | 4 193           | 0,10                   |
| Project Dorchester                                  | 4,610   | 04/01/2027         | 10/12/2025      | 2 095     | 2 058           | 0,05                   |
| Project Fenno                                       | 0,600   | 10/07/2028         | 16/07/2025      | 819       | 809             | 0,02                   |
| Project Fenno                                       | 4,641   | 10/07/2028         | 16/07/2025      | 1 565     | 1 562           | 0,04                   |
| Project Fenno                                       | 4,680   | 10/07/2028         | 16/07/2025      | 747       | 742             | 0,01                   |
| RBC International                                   | 4,660   | 16/12/2028         | 18/11/2025      | 5 000     | 4 918           | 0,12                   |
|                                                     |         |                    |                 | \$ 15 449 | \$ 15 382       | 0,37                   |

- (j) Des titres d'une juste valeur globale de 75 910 \$ (31 décembre 2025 : 514 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Des titres d'une juste valeur globale de 1 199 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 98 731 \$ (31 décembre 2025 : 89 638 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 12 600 \$ (31 décembre 2025 : 16 590 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                                       | \$ 5 608 161                                               | \$ 18 842                                               | \$ 5 627 003        |
| Fonds d'investissement                        | 135 962                                                                                    | 0                                                          | 0                                                       | 135 962             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (683)                                                                                      | 56 191                                                     | 0                                                       | 55 508              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                          | (1 198)                                                    | 0                                                       | (1 198)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 135 279</b>                                                                          | <b>\$ 5 663 154</b>                                        | <b>\$ 18 842</b>                                        | <b>\$ 5 817 275</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 5 558 092                                         | \$ 25 495                                         | \$ 5 583 587        |
| Fonds d'investissement                        | 311 537                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 311 537             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 4 466                                                                             | 29 530                                               | 33                                                | 34 029              |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (1 213)                                              | 0                                                 | (1 213)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 316 003</b>                                                                 | <b>\$ 5 586 409</b>                                  | <b>\$ 25 528</b>                                  | <b>\$ 5 927 940</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BRC                                           | 0,500 %        | 24/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (2 226)        | \$ (2 546)                               | (0,06)              |
|                                               | 3,700          | 30/06/2026        | 07/07/2026         | \$ (6 067)       | (6 068)                                  | (0,14)              |
| CIB                                           | 3,710          | 04/06/2026        | 16/07/2026         | (43 297)         | (43 417)                                 | (1,03)              |
| JPS                                           | 3,710          | 03/06/2026        | 01/07/2026         | (16 140)         | (16 187)                                 | (0,38)              |
|                                               | 3,720          | 16/06/2026        | 07/07/2026         | (4 225)          | (4 231)                                  | (0,10)              |
|                                               | 3,740          | 24/06/2026        | 15/07/2026         | (2 305)          | (2 306)                                  | (0,06)              |
| MEI                                           | 1,850          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | € (1 126)        | (1 288)                                  | (0,03)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (76 043)</b>                       | <b>(1,80)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ 833                                                     | \$ (720)                | \$ 113                            | \$ 164                                                     | \$ (220)                | \$ (56)                           |
| BOA          | 1 725                                                      | (1 680)                 | 45                                | 2 687                                                      | (2 530)                 | 157                               |
| BPS          | (2 722)                                                    | 3 130                   | 408                               | 1 259                                                      | (1 100)                 | 159                               |
| BRC          | 998                                                        | (1 320)                 | (322)                             | 4 858                                                      | (5 270)                 | (412)                             |
| BSH          | (6 201)                                                    | 6 580                   | 379                               | (677)                                                      | 610                     | (67)                              |
| CBK          | 1 909                                                      | (1 880)                 | 29                                | 2 193                                                      | (2 110)                 | 83                                |
| DUB          | (8)                                                        | 350                     | 342                               | (393)                                                      | 300                     | (93)                              |
| FAR          | 3 979                                                      | (4 340)                 | (361)                             | (1 972)                                                    | 2 220                   | 248                               |
| GLM          | (730)                                                      | 700                     | (30)                              | 92                                                         | 0                       | 92                                |
| GSC          | (2)                                                        | 0                       | (2)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| GST          | 618                                                        | (540)                   | 78                                | 19                                                         | 0                       | 19                                |
| IND          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 16                                                         | 0                       | 16                                |
| JPM          | 5 658                                                      | (6 070)                 | (412)                             | 3 233                                                      | (3 070)                 | 163                               |
| MBC          | 171                                                        | (360)                   | (189)                             | 1 982                                                      | (2 300)                 | (318)                             |
| MYC          | 382                                                        | (310)                   | 72                                | 368                                                        | (310)                   | 58                                |
| MYI          | 3                                                          | (40)                    | (37)                              | 37                                                         | (40)                    | (3)                               |
| NSL          | 38                                                         | 0                       | 38                                | 144                                                        | 0                       | 144                               |
| SCX          | (267)                                                      | 380                     | 113                               | (68)                                                       | 0                       | (68)                              |
| SOG          | 9 057                                                      | (9 200)                 | (143)                             | (12 569)                                                   | 13 200                  | 631                               |
| SSB          | 1 710                                                      | (1 780)                 | (70)                              | 14                                                         | (10)                    | 4                                 |
| UAG          | (1 603)                                                    | 1 460                   | (143)                             | (303)                                                      | 260                     | (43)                              |
| WST          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | (77)                                                       | 0                       | (77)                              |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 40,17            | 34,62                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 34,60            | 30,03                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,48             | 0,16                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,82             | 3,62                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,11             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,60             | 0,45                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,73             | 0,33                 |
| Autres actifs                                                    | 21,49            | 30,71                |
| <b>Total des actifs</b>                                          | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 0,39             | 0,35                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 43,18            | 41,69                |
| Obligations et billets municipaux                                                                        | 0,19             | 0,19                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                        | 44,97            | 42,82                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 24,22            | 20,84                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux                  | 4,08             | 4,45                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                              | 3,40             | 4,38                 |
| Émissions souveraines                                                                                    | 12,71            | 11,28                |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,08             | 0,66                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 3,22             | 7,07                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,07             | 0,07                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse    | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01)           | (0,01)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,06             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,83             | 0,67                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | S/O              | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,01             | S/O                  |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,01)           | 0,00                 |
| Options sur titres                                                                                       | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,29             | 0,20                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,54             | (0,50)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,46)           | 0,31                 |
| Titres vendus à découvert                                                                                | (0,03)           | (0,03)               |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (37,73)          | (34,47)              |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

## 30 juin 2026

Rapport semestriel | 30 juin 2026 921

## Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| TITRES ADOSSES À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES COMMERCIALES AUTRES |                                     |                                  |                           |                                                |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| ACORE Issuer LLC                                                |                                     |                                  |                           | Symphony CLO Ltd.                              |                                     |                                  |                           | 4,270 % éch. 17/08/2026             | \$ 500                              | \$ 497                           | 0,30                      |
| 5,089 % éch. 20/08/2043                                         | \$ 600                              | \$ 600                           | 0,36                      | 4,796 % éch. 23/10/2035                        | \$ 400                              | \$ 401                           | 0,24                      | 4,350 % éch. 09/09/2026             | 500                                 | 496                              | 0,30                      |
| ACREC LLC                                                       |                                     |                                  |                           | Toro European CLO DAC                          | € 600                               | 687                              | 0,42                      | Jabil, Inc.                         | 2 100                               | 2 092                            | 1,27                      |
| 5,087 % éch. 18/08/2044                                         | 700                                 | 701                              | 0,43                      | 3,474 % éch. 15/04/2037                        |                                     |                                  |                           | 4,150 % éch. 31/07/2026             |                                     |                                  |                           |
| PFP Ltd.                                                        |                                     |                                  |                           | Trinitas CLO Ltd.                              | \$ 387                              | 388                              | 0,24                      | Jones Lang LaSalle Finance BV       |                                     |                                  |                           |
| 5,137 % éch. 18/08/2043                                         | 400                                 | 402                              | 0,24                      | 4,777 % éch. 25/01/2034                        |                                     |                                  |                           | 4,080 % éch. 21/07/2026             | 1 600                               | 1 596                            | 0,97                      |
|                                                                 |                                     | 1 703                            | 1,03                      |                                                |                                     |                                  |                           | 4,130 % éch. 09/07/2026             | 600                                 | 599                              | 0,36                      |
| AUTRES TITRES ADOSSES À DES ACTIFS                              |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                          |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| AlbaCore Euro CLO DAC                                           |                                     |                                  |                           | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos |                                     |                                  |                           | Keurig Dr Pepper, Inc.              | 2 200                               | 2 198                            | 1,34                      |
| 3,194 % éch. 15/07/2035                                         | € 980                               | 1 123                            | 0,68                      | 4,700 % éch. 01/09/2030                        | CLP 120 000                         | 128                              | 0,08                      | 4,250 % éch. 09/07/2026             |                                     |                                  |                           |
| Arbour CLO DAC                                                  |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/10/2028                        | 25 000                              | 27                               | 0,02                      | Oglethorpe Power Corp.              | 1 400                               | 1 396                            | 0,85                      |
| 3,453 % éch. 15/08/2038                                         | 400                                 | 457                              | 0,28                      | 5,800 % éch. 01/10/2029                        | 65 000                              | 73                               | 0,04                      | 4,070 % éch. 27/07/2026             |                                     |                                  |                           |
| Ares European CLO DAC                                           |                                     |                                  |                           |                                                |                                     | 228                              | 0,14                      | ONE Gas, Inc.                       | 1 100                               | 1 099                            | 0,67                      |
| 3,512 % éch. 15/07/2037                                         | 600                                 | 686                              | 0,42                      | INSTRUMENTS À COURT TERME                      |                                     |                                  |                           | 4,040 % éch. 09/07/2026             |                                     |                                  |                           |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                                    |                                     |                                  |                           | BILLETS DE TRÉSORERIE                          |                                     |                                  |                           | Tampa Electric Co.                  |                                     |                                  |                           |
| 4,702 % éch. 21/10/2034                                         | \$ 700                              | 700                              | 0,42                      | Amdocs, Inc.                                   | \$ 2 200                            | 2 198                            | 1,34                      | 4,060 % éch. 08/07/2026             | 800                                 | 799                              | 0,49                      |
| Bain Capital Euro CLO DAC                                       |                                     |                                  |                           | 4,040 % éch. 08/07/2026                        |                                     |                                  |                           | 4,060 % éch. 09/07/2026             | 1 400                               | 1 399                            | 0,85                      |
| 3,444 % éch. 22/01/2038                                         | € 500                               | 572                              | 0,35                      | AMETEK, Inc.                                   | 300                                 | 300                              | 0,18                      | Telus Corp.                         | 2 100                               | 2 087                            | 1,27                      |
| 3,449 % éch. 15/01/2037                                         | 500                                 | 573                              | 0,35                      | 4,040 % éch. 07/07/2026                        |                                     |                                  |                           | 4,300 % éch. 19/08/2026             | 1 200                               | 1 184                            | 0,72                      |
| Canyon CLO Ltd.                                                 |                                     |                                  |                           | Banco de Crédito e Inversiones                 | 1 400                               | 1 391                            | 0,85                      | VW CR, Inc.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,773 % éch. 15/10/2034                                         | \$ 400                              | 401                              | 0,24                      | 4,000 % éch. 24/08/2026                        |                                     |                                  |                           | 4,180 % éch. 21/10/2026             |                                     |                                  |                           |
| Capital Four CLO DAC                                            |                                     |                                  |                           | Boston Scientific Corp.                        | 300                                 | 300                              | 0,18                      |                                     | 29 051                              | 17,66                            |                           |
| 3,415 % éch. 25/10/2038                                         | € 300                               | 343                              | 0,21                      | 3,980 % éch. 13/07/2026                        |                                     |                                  |                           | BONS DU TRÉSOR SUD-AFRICAÏN         |                                     |                                  |                           |
| Carlyle Euro CLO DAC                                            |                                     |                                  |                           | Brookfield Corporate Treasury Ltd.             | 300                                 | 299                              | 0,18                      | 7,046 % éch. 27/01/2027 (a)(b)      | ZAR 4 300                           | 252                              | 0,15                      |
| 3,173 % éch. 15/08/2032                                         | 57                                  | 65                               | 0,04                      | 4,030 % éch. 31/07/2026                        |                                     |                                  |                           | 7,066 % éch. 28/10/2026 (a)(b)      | 500                                 | 30                               | 0,02                      |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                                      |                                     |                                  |                           | Campbell Soup Co.                              | 1 000                               | 998                              | 0,61                      |                                     |                                     | 282                              | 0,17                      |
| 3,066 % éch. 25/04/2036                                         | 400                                 | 458                              | 0,28                      | 4,140 % éch. 16/07/2026                        |                                     |                                  |                           | Total des Instruments à court terme |                                     | 29 333                           | 17,83                     |
| Euro-Galaxy CLO DAC                                             |                                     |                                  |                           | CBRE Services, Inc.                            | 400                                 | 399                              | 0,24                      | Total des Valeurs mobilières        |                                     | \$ 138 783                       | 84,35                     |
| 2,781 % éch. 24/04/2034                                         | 141                                 | 161                              | 0,10                      | 4,050 % éch. 15/07/2026                        |                                     |                                  |                           | ACTIONS                             |                                     |                                  |                           |
| Hayfin Emerald CLO DAC                                          |                                     |                                  |                           | Constellation Energy Corp.                     | 1 900                               | 1 900                            | 1,15                      | FONDS D'INVESTISSEMENT              |                                     |                                  |                           |
| 3,454 % éch. 15/10/2038                                         | 250                                 | 286                              | 0,17                      | 4,100 % éch. 01/07/2026                        |                                     |                                  |                           | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF   |                                     |                                  |                           |
| Latitude Australia Personal Loans Trust                         |                                     |                                  |                           | CRH America Finance, Inc.                      | 300                                 | 299                              | 0,18                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds      |                                     |                                  |                           |
| 5,303 % éch. 17/09/2033                                         | AUD 147                             | 102                              | 0,06                      | 4,030 % éch. 10/08/2026                        |                                     |                                  |                           | PIMCO US Dollar Short-Term          |                                     |                                  |                           |
| Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC                     |                                     |                                  |                           | Enbridge, Inc.                                 | 1 100                               | 1 090                            | 0,66                      | Floating NAV Fund (c)               | 2 450                               | 25                               | 0,02                      |
| 3,414 % éch. 15/07/2039                                         | € 600                               | 687                              | 0,42                      | 4,040 % éch. 16/09/2026                        |                                     |                                  |                           | FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE            |                                     |                                  |                           |
| Palmer Square European Loan Funding DAC                         |                                     |                                  |                           | 4,040 % éch. 16/09/2026                        |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc -                    |                                     |                                  |                           |
| 3,134 % éch. 15/07/2035                                         | 278                                 | 318                              | 0,19                      | Enel Finance America, LLC                      | 250                                 | 249                              | 0,15                      | Fonds PIMCO US Dollar Short         |                                     |                                  |                           |
| 3,150 % éch. 15/10/2035                                         | 300                                 | 343                              | 0,21                      | 4,150 % éch. 31/07/2026                        |                                     |                                  |                           | Maturity UCITS ETF (c)              | 108 581                             | 10 910                           | 6,63                      |
| Providus CLO DAC                                                |                                     |                                  |                           | Entergy Corp.                                  | 1 200                               | 1 197                            | 0,73                      | Total des Fonds d'investissement    |                                     | \$ 10 935                        | 6,65                      |
| 3,513 % éch. 15/11/2039                                         | 300                                 | 343                              | 0,21                      | 4,100 % éch. 23/07/2026                        |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| Riserva CLO Ltd.                                                |                                     |                                  |                           | Glencore Funding LLC                           | 1 000                               | 996                              | 0,61                      |                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,725 % éch. 18/01/2034                                         | \$ 366                              | 366                              | 0,22                      | 4,020 % éch. 06/08/2026                        | 1 000                               | 996                              | 0,61                      |                                     |                                     |                                  |                           |
| Rockford Tower Europe CLO DAC                                   |                                     |                                  |                           | 4,050 % éch. 10/08/2026                        |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |
| 3,489 % éch. 29/08/2036                                         | € 500                               | 572                              | 0,35                      | HCA, Inc.                                      | 500                                 | 499                              | 0,30                      |                                     |                                     |                                  |                           |
| SLM Private Credit Student Loan Trust                           |                                     |                                  |                           | 4,220 % éch. 14/07/2026                        | 500                                 | 498                              | 0,30                      |                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,216 % éch. 15/06/2039                                         | \$ 205                              | 201                              | 0,12                      | 4,270 % éch. 11/08/2026                        |                                     |                                  |                           |                                     |                                     |                                  |                           |

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)**

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                | Long  | 12/2026              | 40                    | \$ 9                                    | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                | Long  | 12/2027              | 23                    | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                   | Court | 03/2027              | 32                    | 12                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                  | Court | 12/2027              | 215                   | (13)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                     | Long  | 03/2027              | 49                    | 16                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois septembre                    | Long  | 12/2027              | 11                    | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours août                           | Long  | 08/2026              | 53                    | 2                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre      | Long  | 09/2026              | 209                   | 65                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 45                    | 26                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index juillet                              | Long  | 07/2026              | 9                     | (4)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre    | Court | 09/2026              | 14                    | (5)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index septembre                               | Long  | 09/2026              | 1                     | (2)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini NASDAQ 100 Index septembre                 | Long  | 09/2026              | 7                     | 78                                      | 0,05                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index septembre               | Long  | 09/2026              | 14                    | 47                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre                    | Long  | 09/2026              | 3                     | 3                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Euro STOXX Bank Index septembre                   | Long  | 09/2026              | 162                   | 69                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre    | Long  | 09/2026              | 113                   | 7                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre    | Court | 09/2026              | 24                    | (6)                                     | 0,00                   |



| Description                                                                                       | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre | Long  | 09/2026           | 6                  | \$ (1)                                  | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index septembre                                 | Long  | 09/2026           | 24                 | 4                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index juillet                             | Long  | 07/2026           | 440                | 46                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE Taiwan Index juillet                                | Long  | 07/2026           | 18                 | 4                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index septembre                                 | Court | 09/2026           | 34                 | 26                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index septembre                                 | Long  | 09/2026           | 7                  | (13)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Hang Seng China Enterprises Index juillet                | Court | 07/2026           | 117                | 176                                     | 0,11                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice IBEX 35 Index juillet                                    | Long  | 07/2026           | 14                 | 72                                      | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index juillet                             | Long  | 07/2026           | 118                | (21)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Nikkei 225 Index septembre                               | Long  | 09/2026           | 9                  | 175                                     | 0,11                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index juillet                                     | Long  | 07/2026           | 141                | 53                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P CNX Nifty Index juillet                              | Court | 07/2026           | 23                 | 6                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P/Toronto Stock Exchange 60 Index septembre            | Long  | 09/2026           | 11                 | 4                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index septembre                                  | Long  | 09/2026           | 9                  | (23)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index septembre                                    | Long  | 09/2026           | 16                 | 111                                     | 0,07                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                    | Court | 09/2026           | 38                 | 9                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                    | Long  | 09/2026           | 290                | 52                                      | 0,03                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre                   | Court | 09/2026           | 58                 | (86)                                    | (0,05)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre     | Court | 09/2026           | 3                  | (10)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Volatility S&P 500 Index juillet                         | Court | 07/2026           | 114                | 304                                     | 0,18                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice VSTOXX Mini Index juillet                                | Court | 07/2026           | 166                | 36                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index septembre                                    | Long  | 09/2026           | 94                 | (65)                                    | (0,04)                 |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ 1 164                                | 0,71                   |
|                                                                                                   |       |                   |                    | \$ 1 164                                | 0,71                   |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe<br>(à payer) | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-44 Index à 5 ans | (1,000) %              | 20/12/2030         | \$ 11 400                           | \$ (183)                                | (0,11)                 |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                            | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice CDX.EM-45 Index à 5 ans             | 1,000 %                 | 20/06/2031         | \$ 34 600                           | \$ 302                                  | 0,19                   |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans             | 5,000                   | 20/06/2031         | 5 445                               | 22                                      | 0,01                   |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans             | 1,000                   | 20/06/2031         | 49 800                              | 22                                      | 0,01                   |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans   | 5,000                   | 20/06/2031         | e 5 570                             | 41                                      | 0,03                   |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/06/2031         | 45 900                              | 19                                      | 0,01                   |
|                                            |                         |                    |                                     | \$ 406                                  | 0,25                   |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/<br>à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer <sup>(4)</sup>               |                                   | 3,500     |                 |                   |                                         |                        |
|                                      | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | %         | 16/09/2028      | £ 4 300           | \$ (2)                                  | 0,00                   |
| À payer                              | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2031      | 1 490             | (42)                                    | (0,03)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>               | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031      | 800               | (5)                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036      | 5 300             | (56)                                    | (0,03)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>               | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056      | 3 100             | 15                                      | 0,01                   |
| À payer                              | SHIR ILS composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031      | 38 900            | 38                                      | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour    | 6,250     | 16/09/2031      | 1 085 900         | (129)                                   | (0,08)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2036      | ¥ 394 000         | 64                                      | 0,04                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 2,750     | 16/09/2056      | 1 056 600         | 208                                     | 0,13                   |
| À payer <sup>(4)</sup>               | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 1,750     | 16/09/2031      | 11 300            | 10                                      | 0,01                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,000     | 16/09/2031      | 9 000             | (98)                                    | (0,06)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | THOR THB composé-OIS à 1 jour     | 1,500     | 16/09/2031      | 140 100           | (72)                                    | (0,04)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 16/09/2028      | \$ 83 100         | 85                                      | 0,05                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 16/09/2031      | 7 200             | 50                                      | 0,03                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | 8 810             | 137                                     | 0,08                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 18/12/2029      | 7 600             | 66                                      | 0,04                   |
| À payer <sup>(4)</sup>               | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 16/09/2036      | 12 000            | (5)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                           | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      | 4 190             | (11)                                    | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>               | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 16/09/2056      | 3 400             | 38                                      | 0,02                   |
| À payer                              | CDI BRL à un an                   | 12,800    | 02/01/2031      | 27 400            | (156)                                   | (0,09)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>            | CDI BRL à un an                   | 12,975    | 02/01/2031      | 76 100            | 176                                     | 0,11                   |
| À payer                              | CDI BRL à un an                   | 13,172    | 02/01/2031      | 6 700             | (23)                                    | (0,01)                 |
| À payer                              | CDI BRL à un an                   | 13,180    | 02/01/2031      | 53 100            | (135)                                   | (0,08)                 |
| À recevoir                           | CDI BRL à un an                   | 13,328    | 02/01/2031      | 12 900            | 49                                      | 0,03                   |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Taux variable à payer/<br>à recevoir               | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À recevoir                                         | CDI BRL à un an                   | 13,885 %  | 02/01/2031      | BRL 24 900        | \$ 13                                   | 0,01                   |
| À recevoir                                         | CDI BRL à un an                   | 14,020    | 02/01/2031      | 33 200            | (35)                                    | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | CDI BRL à un an                   | 14,684    | 02/01/2031      | 18 200            | (56)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,500     | 16/09/2028      | CAD 9 800         | (33)                                    | (0,02)                 |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | 3 300             | (9)                                     | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 16/09/2031      | 3 000             | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      | 1 500             | (8)                                     | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 16/09/2036      | 16 300            | 51                                      | 0,03                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250     | 16/09/2056      | 800               | (4)                                     | 0,00                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | CNREPOFIX CNY à 3 mois            | 1,500     | 16/09/2031      | CNY 128 500       | 111                                     | 0,07                   |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 9,110     | 17/12/2030      | COP 16 727 600    | 194                                     | 0,12                   |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,360    | 18/03/2031      | 9 054 200         | (122)                                   | (0,07)                 |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,750    | 18/03/2031      | 5 410 400         | (47)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 10,830    | 18/03/2031      | 7 644 400         | (73)                                    | (0,04)                 |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,111    | 18/03/2031      | 4 727 900         | (46)                                    | (0,03)                 |
| À recevoir                                         | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,154    | 18/03/2031      | 2 701 600         | (28)                                    | (0,02)                 |
| À payer                                            | IBR COP composé-OIS à 3 mois      | 11,730    | 17/06/2031      | 22 588 900        | 333                                     | 0,20                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | KORIBOR KRW à 3 mois              | 3,500     | 16/09/2031      | KRW 8 095 600     | 46                                      | 0,03                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | KLIBOR MYR à 3 mois               | 3,500     | 16/09/2031      | MYR 45 400        | 33                                      | 0,02                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | TAIBOR TWD à 3 mois               | 2,250     | 16/09/2031      | TWD 262 400       | (36)                                    | (0,02)                 |
| À recevoir                                         | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,522     | 29/01/2031      | ZAR 232 200       | (163)                                   | (0,10)                 |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois                | 6,673     | 14/04/2031      | 120 000           | 86                                      | 0,05                   |
| À recevoir                                         | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,180     | 04/12/2030      | 16 200            | 24                                      | 0,01                   |
| À payer                                            | JIBAR ZAR à 3 mois                | 7,330     | 10/07/2030      | 22 500            | (28)                                    | (0,02)                 |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 4,250     | 16/09/2028      | AUD 58 000        | (133)                                   | (0,08)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | BBR-BBSW AUD à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2036      | 13 400            | 143                                     | 0,09                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,490     | 01/10/2028      | CLP 28 800        | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,590     | 01/10/2029      | 59 000            | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,676     | 01/09/2030      | 50 400            | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,710     | 01/09/2030      | 59 400            | 0                                       | 0,00                   |
| À payer                                            | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,715     | 17/12/2030      | 1 197 800         | 1                                       | 0,00                   |
| À payer                                            | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,750     | 17/11/2030      | 1 500 000         | 6                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,000     | 17/06/2031      | 8 336 600         | (164)                                   | (0,10)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,000     | 16/09/2031      | 16 523 200        | 40                                      | 0,02                   |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,060     | 18/03/2031      | 116 200           | (2)                                     | 0,00                   |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 5,150     | 17/06/2031      | 3 150 100         | (62)                                    | (0,04)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | PRIBOR CZK à 6 mois               | 3,930     | 20/07/2031      | CZK 8 900         | 8                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | PRIBOR CZK à 6 mois               | 3,963     | 27/11/2030      | 16 700            | (18)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,000     | 17/06/2036      | 57 500            | (71)                                    | (0,04)                 |
| À payer                                            | PRIBOR CZK à 6 mois               | 4,130     | 01/10/2035      | 24 700            | (7)                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,250     | 16/09/2028      | € 22 200          | (9)                                     | (0,01)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036      | 9 200             | 49                                      | 0,03                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 3,000     | 16/09/2056      | 1 300             | 5                                       | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | HIBOR HKD à 6 mois                | 2,750     | 16/09/2031      | HKD 71 500        | 13                                      | 0,01                   |
| À payer                                            | BBR HUF à 6 mois                  | 5,750     | 17/06/2031      | HUF 2 151 400     | 81                                      | 0,05                   |
| À payer                                            | WIBOR PLN à 6 mois                | 3,750     | 17/06/2031      | PLN 20 344        | 10                                      | 0,01                   |
| À payer                                            | WIBOR PLN à 6 mois                | 3,952     | 29/07/2030      | 757               | (7)                                     | 0,00                   |
| À payer                                            | WIBOR PLN à 6 mois                | 4,195     | 29/09/2030      | 8 420             | 24                                      | 0,01                   |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours               | 7,750     | 10/09/2031      | MXN 96 500        | (20)                                    | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours               | 8,000     | 11/06/2031      | 49 500            | (40)                                    | (0,02)                 |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours               | 8,071     | 05/09/2035      | 58 900            | (64)                                    | (0,04)                 |
| À recevoir                                         | TIIE MXN à 28 jours               | 8,250     | 05/03/2036      | 85 700            | (79)                                    | (0,05)                 |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | TIIE MXN à 28 jours               | 8,250     | 03/09/2036      | 23 300            | (8)                                     | (0,01)                 |
| À payer                                            | TIIE MXN à 28 jours               | 8,500     | 04/06/2036      | 19 600            | (3)                                     | 0,00                   |
| À payer                                            | CPURNSA                           | 2,500     | 29/03/2033      | \$ 6 900          | (91)                                    | (0,06)                 |
| À recevoir                                         | CPURNSA                           | 2,525     | 07/06/2033      | 1 700             | 6                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | CPURNSA                           | 2,595     | 12/07/2033      | 5 200             | 6                                       | 0,00                   |
| À payer                                            | CPURNSA                           | 2,598     | 10/04/2034      | 4 700             | (11)                                    | (0,01)                 |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | \$ 8                                    | 0,00                   |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | \$ 231                                  | 0,14                   |

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre                              | Nombre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|------------------------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | À payer            | Indice Brazil Stock Exchange Index | 120                          | 0,000 %       | BRL 20 808        | 12/08/2026      | \$ 0                   | \$ (33)                          | \$ (33)      | (0,02)              |
|              | À recevoir         | Indice SET 50 Index                | 121 200                      | 0,000         | THB 122 840       | 29/09/2026      | 0                      | 120                              | 120          | 0,07                |
| MEI          | À recevoir         | Indice KOSPI2 Index                | 1 250 000                    | 0,000         | KRW 1 537 915     | 10/09/2026      | 0                      | 125                              | 125          | 0,08                |
|              |                    |                                    |                              |               |                   |                 | \$ 0                   | \$ 212                           | \$ 212       | 0,13                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |             | Devise à recevoir | Plus-value latente |       | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|--------------------|-------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 9 065       | \$                | 6 301              | \$ 43 | \$ (23)               | \$ 20                                   | 0,01                |
|              | 07/2026           | CAD             | 140         |                   | 102                | 3     | 0                     | 3                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 4 960       | AUD               | 6 965              | 0     | (135)                 | (135)                                   | (0,08)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 187       | CNH               | 8 017              | 0     | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 330       | NZD               | 2 278              | 0     | (34)                  | (34)                                    | (0,02)              |
|              | 07/2026           |                 | 98          | SGD               | 125                | 0     | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 39          | \$                | 22                 | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 4 899       | AUD               | 7 109              | 24    | 0                     | 24                                      | 0,01                |
| BOA          | 07/2026           |                 | 19          | £                 | 14                 | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 77          | SGD               | 99                 | 0     | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 90          | HKD               | 705                | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CAD             | 8 573       | \$                | 6 200              | 137   | 0                     | 137                                     | 0,08                |
|              | 09/2026           | COP             | 375 324     |                   | 95                 | 0     | (12)                  | (12)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | CZK             | 22 966      |                   | 1 075              | 0     | (8)                   | (8)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | HUF             | 994 273     |                   | 3 155              | 0     | (29)                  | (29)                                    | (0,02)              |
|              | 09/2026           | ¥               | 1 570 778   |                   | 9 900              | 176   | 0                     | 176                                     | 0,11                |
|              | 09/2026           | MXN             | 154         |                   | 9                  | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | NZD             | 4 500       |                   | 2 545              | 0     | (22)                  | (22)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | PHP             | 257 202     |                   | 4 171              | 0     | (8)                   | (8)                                     | (0,01)              |
|              | 09/2026           | \$              | 700         | COP               | 2 450 283          | 0     | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 10/2026           | ZAR             | 484         | \$                | 30                 | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 01/2027           |                 | 4 123       |                   | 251                | 3     | 0                     | 3                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$              | 3 227       | BRL               | 16 668             | 0     | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 15          | £                 | 11                 | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 287         | ILS               | 845                | 0     | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 308         | ¥                 | 49 500             | 0     | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 24          | SEK               | 235                | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | AUD             | 17 200      | \$                | 11 987             | 106   | (19)                  | 87                                      | 0,05                |
|              | 09/2026           | BRL             | 45 527      |                   | 8 600              | 0     | (38)                  | (38)                                    | (0,02)              |
|              | 09/2026           | CHF             | 11 426      |                   | 14 600             | 316   | 0                     | 316                                     | 0,19                |
|              | 09/2026           | CLP             | 5 582 797   |                   | 6 059              | 3     | (3)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CNH             | 29 109      |                   | 4 300              | 0     | (10)                  | (10)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | €               | 13 500      |                   | 15 563             | 95    | (15)                  | 80                                      | 0,05                |
|              | 09/2026           | £               | 11 750      |                   | 15 549             | 0     | (46)                  | (46)                                    | (0,03)              |
|              | 09/2026           | HUF             | 1           |                   | 0                  | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 161 780     |                   | 1 700              | 2     | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ¥               | 1 140 584   |                   | 7 100              | 39    | 0                     | 39                                      | 0,02                |
|              | 09/2026           | NOK             | 152 587     |                   | 15 800             | 405   | (9)                   | 396                                     | 0,24                |
|              | 09/2026           | NZD             | 8 800       |                   | 5 056              | 37    | 0                     | 37                                      | 0,02                |
|              | 09/2026           | PLN             | 28 588      |                   | 7 683              | 79    | (1)                   | 78                                      | 0,05                |
|              | 09/2026           | SEK             | 89 589      |                   | 9 400              | 129   | (25)                  | 104                                     | 0,06                |
|              | 09/2026           | THB             | 177 092     |                   | 5 400              | 36    | 0                     | 36                                      | 0,02                |
|              | 09/2026           | TWD             | 115 058     |                   | 3 600              | 0     | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 300       | COP               | 4 721 958          | 46    | 0                     | 46                                      | 0,03                |
|              | 09/2026           |                 | 568         | IDR               | 10 263 055         | 1     | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 000       | ILS               | 2 910              | 0     | (21)                  | (21)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           |                 | 2 052       | INR               | 195 594            | 1     | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 1 700       | PHP               | 102 706            | 0     | (31)                  | (31)                                    | (0,02)              |
|              | 09/2026           |                 | 2 200       | TWD               | 69 704             | 0     | (18)                  | (18)                                    | (0,01)              |
|              | 09/2026           | ZAR             | 48 069      | \$                | 2 902              | 0     | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |
|              | 12/2026           | IDR             | 10 332 862  |                   | 568                | 0     | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | COP             | 3 772 592   |                   | 1 096              | 8     | 0                     | 8                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | KRW             | 10 384 202  |                   | 6 811              | 104   | 0                     | 104                                     | 0,06                |
|              | 07/2026           | MYR             | 9 245       |                   | 2 273              | 10    | 0                     | 10                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | SGD             | 672         |                   | 525                | 5     | 0                     | 5                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | TRY             | 294         |                   | 6                  | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 994         | COP               | 3 772 592          | 94    | 0                     | 94                                      | 0,06                |
|              | 07/2026           |                 | 2           | MYR               | 7                  | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 28          | NZD               | 48                 | 0     | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 148         | SGD               | 191                | 0     | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6           | TRY               | 280                | 0     | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CZK             | 19 767      | \$                | 925                | 0     | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 115 640 860 |                   | 6 337              | 0     | (73)                  | (73)                                    | (0,04)              |
|              | 09/2026           | MYR             | 17 447      |                   | 4 300              | 23    | 0                     | 23                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 082       | COP               | 3 772 592          | 0     | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BSH          | 07/2026           | AUD             | 588               | \$ 408             | \$ 1                  | \$ 0                                    | \$ 1 0,00           |
|              | 07/2026           | \$              | 709               | AUD 995            | 0                     | (20)                                    | (20) (0,01)         |
|              | 08/2026           |                 | 408               | 588                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 254               | BRL 1 298          | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
| CBK          | 09/2026           |                 | 4 729             | 24 257             | 0                     | (112)                                   | (112) (0,07)        |
|              | 07/2026           | SEK             | 5 057             | \$ 547             | 24                    | 0                                       | 24 0,01             |
|              | 07/2026           | \$              | 20                | COP 69 877         | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 2 346             | € 2 021            | 0                     | (35)                                    | (35) (0,02)         |
|              | 07/2026           |                 | 202               | HUF 61 970         | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 324               | ILS 942            | 0                     | (8)                                     | (8) (0,01)          |
|              | 07/2026           |                 | 82                | ¥ 13 200           | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 782               | NOK 7 236          | 0                     | (50)                                    | (50) (0,03)         |
|              | 07/2026           |                 | 21                | SEK 205            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 6                 | TWD 187            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | INR             | 276 788           | \$ 2 953           | 41                    | 0                                       | 41 0,02             |
|              | 08/2026           | \$              | 825               | ILS 2 327          | 0                     | (43)                                    | (43) (0,03)         |
|              | 09/2026           | CAD             | 7 220             | \$ 5 200           | 94                    | 0                                       | 94 0,06             |
|              | 09/2026           | CLP             | 1 049 935         | 1 141              | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | COP             | 198 206           | 50                 | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
| DUB          | 09/2026           | €               | 599               | 697                | 10                    | 0                                       | 10 0,01             |
|              | 09/2026           | MXN             | 56 174            | 3 203              | 8                     | 0                                       | 8 0,00              |
|              | 09/2026           | PEN             | 1 276             | 366                | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
|              | 09/2026           | PHP             | 356               | 6                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | \$              | 4 717             | CLP 4 115 048      | 0                     | (251)                                   | (251) (0,15)        |
|              | 09/2026           |                 | 500               | COP 1 941 461      | 53                    | 0                                       | 53 0,03             |
|              | 09/2026           |                 | 227               | € 197              | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           |                 | 1 348             | IDR 24 328 085     | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 1                 | PEN 4              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 11/2026           | COP             | 71 914            | \$ 20              | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 12/2026           | IDR             | 24 490 408        | 1 348              | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 12/2026           | \$              | 2 704             | PEN 9 373          | 27                    | 0                                       | 27 0,02             |
|              | 07/2026           | CNH             | 20 412            | \$ 3 001           | 0                     | (6)                                     | (6) 0,00            |
|              | 07/2026           | RON             | 127               | 28                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | SGD             | 31                | 24                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 242               | AUD 339            | 0                     | (7)                                     | (7) 0,00            |
| FAR          | 07/2026           |                 | 2 251             | CZK 46 875         | 0                     | (43)                                    | (43) (0,03)         |
|              | 07/2026           |                 | 2 503             | NOK 23 258         | 0                     | (153)                                   | (153) (0,09)        |
|              | 07/2026           |                 | 152               | SGD 194            | 0                     | (2)                                     | (2) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 8                 | ZAR 129            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | INR             | 53 822            | \$ 572             | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 3 001             | CNH 20 367         | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 24                | SGD 31             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | CHF             | 961               | \$ 1 200           | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 09/2026           | HUF             | 864 455           | 2 745              | 0                     | (24)                                    | (24) (0,02)         |
|              | 09/2026           | IDR             | 30 033 815        | 1 654              | 0                     | (11)                                    | (11) (0,01)         |
|              | 09/2026           | KRW             | 1 552 940         | 1 000              | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 09/2026           | \$              | 348               | INR 33 173         | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           |                 | 2 342             | MXN 40 876         | 0                     | (17)                                    | (17) (0,01)         |
|              | 07/2026           | AUD             | 2 233             | \$ 1 551           | 4                     | 0                                       | 4 0,00              |
|              | 07/2026           | CNH             | 9 020             | 1 326              | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 07/2026           | NZD             | 72                | 41                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
| GLM          | 07/2026           | PLN             | 759               | 208                | 6                     | 0                                       | 6 0,00              |
|              | 07/2026           | SEK             | 4 213             | 434                | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |
|              | 07/2026           | \$              | 83                | £ 63               | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 1 109             | ¥ 179 487          | 0                     | (5)                                     | (5) 0,00            |
|              | 07/2026           |                 | 855               | ZAR 14 109         | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 08/2026           | £               | 63                | \$ 83              | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           | ¥               | 179 017           | 1 109              | 5                     | 0                                       | 5 0,00              |
|              | 08/2026           | \$              | 1 550             | AUD 2 233          | 0                     | (3)                                     | (3) 0,00            |
|              | 08/2026           |                 | 1 326             | CNH 9 001          | 3                     | 0                                       | 3 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 2 039             | ILS 5 974          | 0                     | (32)                                    | (32) (0,02)         |
|              | 08/2026           |                 | 41                | NZD 72             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 08/2026           |                 | 434               | SEK 4 206          | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | €               | 2 449             | \$ 2 852           | 43                    | 0                                       | 43 0,03             |
|              | 09/2026           | HKD             | 15                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | INR             | 3 916             | 41                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | BRL             | 26 480            | 5 128              | 13                    | (1)                                     | 12 0,01             |
| GLM          | 07/2026           | CNH             | 20 555            | 3 043              | 15                    | 0                                       | 15 0,01             |
|              | 07/2026           | TRY             | 5 205             | 109                | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 07/2026           | \$              | 2 337             | BRL 11 791         | 0                     | (59)                                    | (59) (0,04)         |
|              | 07/2026           |                 | 2 855             | CAD 4 062          | 9                     | 0                                       | 9 0,01              |
|              | 07/2026           |                 | 196               | COP 680 652        | 1                     | (1)                                     | 0 0,00              |
|              | 07/2026           |                 | 4 761             | MYR 19 345         | 0                     | (25)                                    | (25) (0,02)         |
|              | 08/2026           | CAD             | 4 057             | \$ 2 855           | 0                     | (9)                                     | (9) (0,01)          |
|              | 08/2026           | \$              | 17                | BRL 90             | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | COP             | 474 978           | \$ 136             | 1                     | 0                                       | 1 0,00              |
|              | 09/2026           | IDR             | 56 019            | 3                  | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | INR             | 2 852             | 30                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | MXN             | 366               | 21                 | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 09/2026           | MYR             | 9 513             | 2 300              | 0                     | (32)                                    | (32) (0,02)         |
|              | 09/2026           | NZD             | 5 500             | 3 112              | 0                     | (24)                                    | (24) (0,02)         |
|              | 09/2026           | \$              | 5 110             | BRL 26 784         | 0                     | (13)                                    | (13) (0,01)         |
|              | 09/2026           |                 | 3                 | INR 269            | 0                     | 0                                       | 0 0,00              |
|              | 11/2026           | COP             | 211 618           | \$ 58              | 0                     | (1)                                     | (1) 0,00            |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|--------|
| IND          | 07/2026           | PLN             | 394       | \$                | 107                | \$ 2                  | \$ 0                                    | \$ 2                | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | \$              | 57        | CZK               | 1 205              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
| JPM          | 07/2026           |                 | 1 004     | PLN               | 3 674              | 0                     | (26)                                    | (26)                | (0,02) |        |
|              | 07/2026           | AUD             | 7 596     | \$                | 5 415              | 153                   | 0                                       | 153                 | 0,09   |        |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 980     |                   | 383                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | CAD             | 25 717    |                   | 18 375             | 249                   | 0                                       | 249                 | 0,15   |        |
|              | 07/2026           | CHF             | 974       |                   | 1 227              | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           | £               | 864       |                   | 1 159              | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           | NOK             | 10 008    |                   | 1 011              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | PLN             | 1 939     |                   | 532                | 16                    | 0                                       | 16                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           | \$              | 4 987     | CNH               | 33 665             | 0                     | (28)                                    | (28)                | (0,02) |        |
|              | 07/2026           |                 | 353       | CZK               | 7 344              | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 6 469     | HUF               | 1 953 133          | 0                     | (198)                                   | (198)               | (0,12) |        |
|              | 07/2026           |                 | 289       | ILS               | 862                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 12        | NZD               | 20                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           |                 | 380       | BRL               | 1 980              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           |                 | 4 556     | ILS               | 13 353             | 0                     | (70)                                    | (70)                | (0,04) |        |
|              | 08/2026           |                 | 1 011     | NOK               | 10 012             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | CZK             | 153 863   | \$                | 7 300              | 46                    | 0                                       | 46                  | 0,03   |        |
|              | 09/2026           | ILS             | 14 330    |                   | 4 800              | 0                     | (19)                                    | (19)                | (0,01) |        |
|              | 09/2026           | MXN             | 22 743    |                   | 1 297              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | PLN             | 5 713     |                   | 1 517              | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |        |
| 09/2026      | THB               | 129 557         |           | 3 960             | 35                 | 0                     | 35                                      | 0,02                |        |        |
| 09/2026      | TWD               | 23 902          |           | 755               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |        |        |
| MBC          | 09/2026           | \$              | 129       | BRL               | 663                | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |        |
|              | 09/2026           |                 | 1         | INR               | 115                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           |                 | 4 585     | MXN               | 79 663             | 0                     | (55)                                    | (55)                | (0,03) |        |
|              | 09/2026           | ZAR             | 19 841    | \$                | 1 198              | 0                     | (5)                                     | (5)                 | 0,00   |        |
|              | 12/2026           | MXN             | 664       |                   | 38                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | AUD             | 619       |                   | 427                | 1                     | (3)                                     | (2)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | COP             | 750 529   |                   | 198                | 0                     | (19)                                    | (19)                | (0,01) |        |
|              | 07/2026           | £               | 2 150     |                   | 2 883              | 30                    | 0                                       | 30                  | 0,02   |        |
|              | 07/2026           | ¥               | 620 352   |                   | 3 902              | 85                    | 0                                       | 85                  | 0,05   |        |
|              | 07/2026           | NOK             | 10 120    |                   | 1 018              | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | NZD             | 709       |                   | 406                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | SEK             | 2 573     |                   | 264                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | SGD             | 252       |                   | 196                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | \$              | 3 605     | AUD               | 5 222              | 15                    | (2)                                     | 13                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           |                 | 62        | CAD               | 86                 | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 1 396     | CHF               | 1 093              | 0                     | (41)                                    | (41)                | (0,03) |        |
|              | 07/2026           |                 | 256       | €                 | 222                | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 40        | £                 | 30                 | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 4 682     | NOK               | 43 735             | 0                     | (262)                                   | (262)               | (0,16) |        |
|              | 07/2026           |                 | 27        | SEK               | 260                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           | AUD             | 5 148     | \$                | 3 550              | 0                     | (15)                                    | (15)                | (0,01) |        |
|              | 08/2026           | \$              | 402       | AUD               | 584                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           |                 | 120       | HKD               | 941                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           |                 | 1 888     | ILS               | 5 454              | 0                     | (55)                                    | (55)                | (0,03) |        |
|              | 08/2026           |                 | 1 018     | NOK               | 10 124             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           |                 | 407       | NZD               | 709                | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |        |
|              | 08/2026           |                 | 264       | SEK               | 2 568              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | SGD             | 7 394     | \$                | 5 800              | 53                    | 0                                       | 53                  | 0,03   |        |
|              | 09/2026           | \$              | 694       | AUD               | 984                | 0                     | (14)                                    | (14)                | (0,01) |        |
|              | MYI               | 07/2026         |           | 285               |                    | 404                   | 0                                       | (6)                 | (6)    | 0,00   |
|              |                   | 07/2026         |           | 5 305             | £                  | 3 954                 | 0                                       | (57)                | (57)   | (0,03) |
|              |                   | 07/2026         |           | 91                | SEK                | 855                   | 0                                       | (3)                 | (3)    | 0,00   |
|              |                   | 07/2026         |           | 21                | ZAR                | 345                   | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 202       | \$                | 12                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 09/2026           | NZD             | 785       |                   | 459                | 11                    | 0                                       | 11                  | 0,01   |        |
|              | RYL               | 09/2026         | TWD       | 189 106           |                    | 5 984                 | 64                                      | 0                   | 64     | 0,04   |
|              |                   | 07/2026         | NZD       | 1 800             |                    | 1 050                 | 26                                      | 0                   | 26     | 0,02   |
|              | SCX               | 07/2026         | \$        | 1 127             | SEK                | 10 580                | 0                                       | (34)                | (34)   | (0,02) |
|              |                   | 07/2026         | €         | 1 365             | \$                 | 1 589                 | 28                                      | 0                   | 28     | 0,02   |
|              |                   | 07/2026         | £         | 2 277             |                    | 3 050                 | 27                                      | 0                   | 27     | 0,02   |
| 07/2026      |                   | ¥               | 483 525   |                   | 3 043              | 68                    | 0                                       | 68                  | 0,04   |        |
| 07/2026      | \$                | 1 108           | CNH       | 7 482             | 0                  | (6)                   | (6)                                     | 0,00                |        |        |
| 07/2026      |                   | 1               | INR       | 79                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |        |
| 07/2026      |                   | 2 480           | ¥         | 400 878           | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |        |        |
| 08/2026      | ¥                 | 399 830         | \$        | 2 480             | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,01                |        |        |
| 08/2026      | \$                | 26              | HKD       | 203               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |        |
| 09/2026      | CAD               | 7 755           | \$        | 5 546             | 61                 | 0                     | 61                                      | 0,04                |        |        |
| SOG          | 09/2026           | IDR             | 9 306 335 |                   | 514                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           | €               | 6 174     |                   | 7 202              | 143                   | 0                                       | 143                 | 0,09   |        |
|              | 07/2026           | ¥               | 142 988   |                   | 900                | 20                    | 0                                       | 20                  | 0,01   |        |
|              | 07/2026           | \$              | 3 382     | AUD               | 4 880              | 12                    | (13)                                    | (1)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 2 362     | CAD               | 3 262              | 0                     | (63)                                    | (63)                | (0,04) |        |
|              | 07/2026           |                 | 2 014     | CNH               | 13 623             | 0                     | (7)                                     | (7)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 6 024     | €                 | 5 296              | 31                    | 0                                       | 31                  | 0,02   |        |
|              | 07/2026           |                 | 472       | £                 | 357                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 1         | ¥                 | 195                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 92        | NZD               | 158                | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |        |
|              | 07/2026           |                 | 244       | SGD               | 316                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |        |
|              | 08/2026           | AUD             | 4 177     | \$                | 2 880              | 0                     | (12)                                    | (12)                | (0,01) |        |

## Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 08/2026           | € 5 296         | \$ 6 032          | \$ 0               | \$ (31)               | \$ (31)                                 | (0,02)              |
|              | 08/2026           | £ 357           | 472               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | ¥ 194           | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | SGD 315         | 244               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | £ 1 570         | 2 106             | 22                 | 0                     | 22                                      | 0,01                |
|              | 09/2026           | TWD 66 507      | 2 100             | 18                 | 0                     | 18                                      | 0,01                |
| SSB          | 07/2026           | CAD 84          | 61                | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 4 481        | CAD 6 179         | 0                  | (126)                 | (126)                                   | (0,08)              |
|              | 07/2026           | 3 769           | ¥ 603 600         | 0                  | (55)                  | (55)                                    | (0,03)              |
|              | 07/2026           | 4 493           | ZAR 72 795        | 0                  | (57)                  | (57)                                    | (0,03)              |
|              | 08/2026           | 1 796           | COP 6 851 551     | 170                | 0                     | 170                                     | 0,10                |
| UAG          | 09/2026           | AUD 67          | \$ 47             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 901          | ILS 2 667         | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 9               | NZD 16            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 37              | SGD 48            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | CLP 187 375     | \$ 211            | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP 85 622      | 22                | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 1 038        | CLP 924 020       | 0                  | (35)                  | (35)                                    | (0,02)              |
|              | 09/2026           | 2 920           | COP 11 268 979    | 292                | 0                     | 292                                     | 0,18                |
| WST          | 07/2026           | CHF 119         | \$ 147            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 924          | AUD 1 297         | 0                  | (25)                  | (25)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 147             | CHF 119           | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4 066           | \$ (3 053)            | \$ 1 013                                | 0,62                |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 516          | € 443             | \$ 0               | \$ (9)                | \$ (9)                                  | (0,01)              |
| BPS          | 07/2026           | € 333           | \$ 378            | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 14 056       | € 12 075          | 3                  | (254)                 | (251)                                   | (0,15)              |
| BSH          | 07/2026           | 13 496          | 11 577            | 0                  | (260)                 | (260)                                   | (0,16)              |
| CBK          | 07/2026           | 101             | 87                | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 11 899        | \$ 13 571         | 0                  | (33)                  | (33)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 13 589       | € 11 899          | 33                 | 0                     | 33                                      | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | € 13 151        | \$ 14 949         | 7                  | (94)                  | (87)                                    | (0,05)              |
|              | 07/2026           | \$ 2 425        | € 2 094           | 0                  | (31)                  | (31)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | 14 411          | 12 671            | 94                 | 0                     | 94                                      | 0,06                |
| SOG          | 07/2026           | € 12 560        | \$ 14 287         | 0                  | (73)                  | (73)                                    | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 13 636       | € 11 689          | 0                  | (272)                 | (272)                                   | (0,17)              |
|              | 08/2026           | 14 307          | 12 560            | 73                 | 0                     | 73                                      | 0,04                |
| SSB          | 07/2026           | € 21            | \$ 24             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 24           | € 21              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 210             | \$ (1 031)            | \$ (821)                                | (0,50)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | \$ 259          | £ 193             | \$ 0               | \$ (3)                | \$ (3)                                  | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | £ 180           | \$ 237            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 294          | £ 220             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | 221             | 167               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | 273             | 203               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | (0,01)              |
| NSL          | 07/2026           | £ 41            | \$ 54             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 54           | £ 41              | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SCX          | 07/2026           | £ 199           | \$ 263            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 258          | £ 195             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | £ 193           | \$ 256            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 256          | £ 193             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| SSB          | 07/2026           | £ 2             | \$ 3              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 3            | £ 2               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 4               | \$ (13)               | \$ (9)                                  | (0,01)              |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 395 0,24



| DESCRIPTION                                 | ACTIONS | JUSTE VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|---------------------------------------------|---------|-------------------------------|---------------------------|
| <b>CERTIFICATS DE DÉPÔT</b>                 |         |                               |                           |
| Banco Itau Chile<br>4,290 % éch. 01/12/2026 | \$ 400  | \$ 400                        | 0,24                      |
| Total des Certificats de dépôt              |         | \$ 400                        | 0,24                      |

**TITRES VENDUS À DÉCOUVERT****AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN**

|                                                                                               |       |            |        |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|------------|--------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA<br>5,000 % éch. 01/07/2041 (d) | 4 000 | (4 017)    | (2,44) |
| Total des Titres vendus à découvert                                                           |       | \$ (4 017) | (2,44) |
| Total des Investissements                                                                     |       | \$ 147 891 | 89,89  |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                        |       | \$ 16 634  | 10,11  |
| Actif net                                                                                     |       | \$ 164 525 | 100,00 |

**NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :**

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (c) Affilié au Fonds.
- (d) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2026 sont couverts par des positions longues sur des titres négociables et des instruments du marché monétaire.
- (e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Wells Fargo & Co.         | 5,083 % | 26/04/2028      | 13/04/2026   | \$ 294 | \$ 287       | 0,17                |

(f) Un titre d'une juste valeur globale de 1 160 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 20 388 \$ (31 décembre 2025 : 10 915 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 820 \$ (31 décembre 2025 : 280 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 138 097                                           | \$ 686                                            | \$ 138 783        |
| Fonds d'investissement                        | 10 935                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 10 935            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 1 197                                                                             | 593                                                  | 0                                                 | 1 790             |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit      | 0                                                                                 | 400                                                  | 0                                                 | 400               |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (4 017)                                              | 0                                                 | (4 017)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 12 132</b>                                                                  | <b>\$ 135 073</b>                                    | <b>\$ 686</b>                                     | <b>\$ 147 891</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur      |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 109 549                                           | \$ 0                                              | \$ 109 549        |
| Fonds d'investissement                        | 10 594                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 10 594            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 445                                                                               | 2 190                                                | 0                                                 | 2 635             |
| Titres vendus à découvert                     | 0                                                                                 | (2 735)                                              | 0                                                 | (2 735)           |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 11 039</b>                                                                  | <b>\$ 109 004</b>                                    | <b>\$ 0</b>                                       | <b>\$ 120 043</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                    | 3,870 %        | 29/06/2026        | 13/07/2026      | \$ (1 104)       | \$ (1 104)                               | (0,67)              |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                 |                  | \$ (1 104)                               | (0,67)              |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (132)                                                   | \$ 0                    | \$ (132)                          | \$ 24                                                      | \$ 0                    | \$ 24                             |
| BOA          | 312                                                        | 0                       | 312                               | 181                                                        | (260)                   | (79)                              |
| BPS          | 773                                                        | (1 210)                 | (437)                             | 172                                                        | 0                       | 172                               |
| BRC          | 155                                                        | (110)                   | 45                                | 126                                                        | (160)                   | (34)                              |
| BSH          | (398)                                                      | 300                     | (98)                              | (14)                                                       | 0                       | (14)                              |
| CBK          | (149)                                                      | 0                       | (149)                             | 153                                                        | 0                       | 153                               |
| DUB          | (257)                                                      | 260                     | 3                                 | 144                                                        | 0                       | 144                               |
| FAR          | 19                                                         | (20)                    | (1)                               | (7)                                                        | 0                       | (7)                               |
| GLM          | (126)                                                      | 0                       | (126)                             | 191                                                        | (270)                   | (79)                              |
| IND          | (24)                                                       | 0                       | (24)                              | 24                                                         | 0                       | 24                                |
| JPM          | 156                                                        | (270)                   | (114)                             | 83                                                         | 0                       | 83                                |
| MBC          | (251)                                                      | 260                     | 9                                 | 88                                                         | 0                       | 88                                |
| MEI          | 125                                                        | (320)                   | (195)                             | 34                                                         | 0                       | 34                                |
| MYI          | 9                                                          | (20)                    | (11)                              | 27                                                         | (20)                    | 7                                 |
| NSL          | 1                                                          | 0                       | 1                                 | 76                                                         | 0                       | 76                                |
| RYL          | (8)                                                        | 0                       | (8)                               | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| SCX          | 178                                                        | (120)                   | 58                                | 12                                                         | 0                       | 12                                |
| SOG          | (155)                                                      | 0                       | (155)                             | (358)                                                      | 280                     | (78)                              |
| SSB          | (65)                                                       | 0                       | (65)                              | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| UAG          | 257                                                        | (270)                   | (13)                              | 257                                                        | (330)                   | (73)                              |
| WST          | (25)                                                       | 0                       | (25)                              | (77)                                                       | 0                       | (77)                              |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 31,24            | 20,38                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 28,45            | 33,27                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,01             | S/O                  |
| Fonds d'investissement                                           | 4,78             | 5,19                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,62             | 0,27                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 1,15             | 1,66                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 1,98             | 1,25                 |
| Certificats de dépôt                                             | 0,17             | S/O                  |
| Autres actifs                                                    | 30,60            | 37,98                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                       | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés                                                           | 39,41            | 43,98                |
| Agences du gouvernement américain                                                       | 16,00            | 41,06                |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 2,85             | 5,26                 |
| Titres adossés à des actifs                                                             | 8,12             | 8,99                 |
| Émissions souveraines                                                                   | 0,14             | S/O                  |
| Instruments à court terme                                                               | 17,83            | 4,05                 |
| Fonds d'investissement                                                                  | 6,65             | 9,99                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                        |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                           | 0,71             | 0,38                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                        | (0,11)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                        | 0,25             | 0,28                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                 | 0,00             | 0,75                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                        | S/O              | 0,23                 |
| Swaps de rendement total sur indices                                                    | 0,13             | 0,03                 |
| Contrats de change à terme                                                              | 0,62             | 0,61                 |
| Contrats de change à terme couverts                                                     | (0,51)           | 0,20                 |
| Titres vendus à découvert                                                               | (2,44)           | (2,58)               |
| Certificats de dépôt                                                                    | 0,24             | S/O                  |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                  | 10,11            | (13,23)              |
| Actif net                                                                               | 100,00           | 100,00               |

| DESCRIPTION                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)     | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                   | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                               |       |       |      |
|--------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|-----------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------|----------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                         |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| AUSTRALIE                                  |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           | JAPON                         |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| APA Infrastructure Ltd.                    | £                                   | 600                              | £ 458                     | 0,20        | Électricité de France S.A.              | £                                | 300                       | £ 242                         | 0,11                                               | UniCredit SpA                                      | €                         | 600                           | £ 517 | 0,23  |      |
| 2,500 % éch. 15/03/2036                    |                                     |                                  |                           |             | 5,125 % éch. 22/09/2050                 |                                  |                           |                               |                                                    | 3,875 % éch. 03/06/2027 (d)(f)                     | £                         | 1 200                         | 1 202 | 0,53  |      |
| 3,125 % éch. 18/07/2031                    |                                     | 800                              | 731                       | 0,32        | 5,500 % éch. 27/03/2037                 |                                  | 2 700                     | 2 581                         | 1,14                                               | 5,305 % éch. 31/07/2032                            |                           |                               |       |       |      |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. |                                     |                                  |                           |             | 5,500 % éch. 17/10/2041                 |                                  | 2 000                     | 1 837                         | 0,81                                               |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 5,145 % éch. 18/08/2036 (f)                |                                     | 200                              | 198                       | 0,09        | 6,125 % éch. 02/06/2034                 |                                  | 600                       | 620                           | 0,27                                               | Total Italie                                       |                           |                               | 4 506 | 1,99  |      |
| Total Australie                            |                                     |                                  | 1 387                     | 0,61        | Engie S.A.                              |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           |                               | 4 750 | 2,10  |      |
| AUTRICHE                                   |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| ams-OSRAM AG                               | €                                   | 300                              | 267                       | 0,12        | 5,000 % éch. 01/10/2060                 |                                  | 400                       | 322                           | 0,14                                               | NTT Finance Corp.                                  |                           | 400                           | 391   | 0,17  |      |
| 7,250 % éch. 31/05/2032                    |                                     |                                  |                           |             | Société Générale S.A.                   |                                  | 1 400                     | 1 417                         | 0,62                                               | 4,764 % éch. 15/12/2032                            |                           | 700                           | 700   | 0,31  |      |
| CANADA                                     |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           |                               |       | 1 091 | 0,48 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES         |       |       |      |
| Bank of Nova Scotia                        | £                                   | 700                              | 702                       | 0,31        | 5,637 % éch. 09/09/2032                 |                                  | 200                       | 204                           | 0,09                                               | Obligation internationale du gouvernement japonais |                           |                               |       |       |      |
| 4,943 % éch. 24/04/2030                    |                                     |                                  |                           |             | 5,750 % éch. 22/01/2032                 |                                  |                           |                               |                                                    | 3,700 % éch. 20/03/2056                            | ¥                         | 134 100                       | 601   | 0,27  |      |
| Royal Bank of Canada                       |                                     |                                  |                           |             | Total France                            |                                  |                           | 18 729                        | 8,27                                               | Total Japon                                        |                           |                               | 1 692 | 0,75  |      |
| 5,125 % éch. 01/08/2032                    |                                     | 700                              | 703                       | 0,31        | ALLEMAGNE                               |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| Toronto-Dominion Bank                      |                                     |                                  |                           |             | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 5,138 % éch. 28/11/2030                    |                                     | 600                              | 605                       | 0,27        | Commerzbank AG                          |                                  | 700                       | 695                           | 0,31                                               | AA Bond Co. Ltd.                                   | £                         | 500                           | 495   | 0,22  |      |
| Total Canada                               |                                     |                                  | 2 010                     | 0,89        | 5,000 % éch. 15/10/2031                 |                                  |                           |                               |                                                    | 5,500 % éch. 31/07/2050                            |                           | 300                           | 314   | 0,14  |      |
| ÎLES CAIMANS                               |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
| Gacfi First Investment Co.                 |                                     |                                  |                           |             | Deutsche Bank AG                        |                                  | 1 600                     | 1 604                         | 0,71                                               | Gatwick Funding Ltd.                               |                           |                               |       |       |      |
| 5,125 % éch. 11/06/2029                    |                                     | 400                              | 402                       | 0,18        | 5,000 % éch. 26/02/2029                 |                                  | 600                       | 620                           | 0,27                                               | 4,625 % éch. 27/03/2036                            |                           | 537                           | 507   | 0,22  |      |
| COLOMBIE                                   |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | GSG Bidco Ltd.                |       |       |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                      |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | 4,700 % éch. 15/06/2031       |       |       |      |
| TES colombien                              |                                     |                                  |                           |             | 6,125 % éch. 12/12/2030                 |                                  |                           |                               |                                                    | 5,375 % éch. 15/06/2036                            | €                         | 200                           | 171   | 0,08  |      |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                   | COP                                 | 3 158 000                        | 670                       | 0,30        | 10,000 % éch. 01/12/2027 (d)(f)         | €                                | 400                       | 372                           | 0,16                                               | Heathrow Funding Ltd.                              |                           | 250                           | 214   | 0,09  |      |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                   |                                     | 3 005 000                        | 645                       | 0,28        | Total Allemagne                         |                                  |                           | 3 291                         | 1,45                                               | 5,625 % éch. 05/02/2034                            | £                         | 800                           | 780   | 0,35  |      |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                   |                                     | 3 185 000                        | 726                       | 0,32        | IRLANDE                                 |                                  |                           |                               | Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                 |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 13,250 % éch. 09/02/2033                   |                                     | 2 756 700                        | 636                       | 0,28        | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS              |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| Total Colombie                             |                                     |                                  | 2 677                     | 1,18        | Arbour CLO DAC                          |                                  | 700                       | 604                           | 0,27                                               | AA Bond Co. Ltd.                                   |                           |                               |       |       |      |
| DANEMARK                                   |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
| Carlsberg Breweries A/S                    | £                                   | 250                              | 243                       | 0,11        | 3,433 % éch. 15/11/2037                 |                                  |                           |                               |                                                    | 5,500 % éch. 31/07/2050                            |                           |                               |       |       |      |
| 5,500 % éch. 28/02/2039                    |                                     |                                  |                           |             | Ares European CLO DAC                   |                                  |                           |                               |                                                    | 7,375 % éch. 31/07/2050                            |                           |                               |       |       |      |
| Danske Bank A/S                            |                                     |                                  |                           |             | 3,234 % éch. 21/10/2034                 |                                  | 385                       | 332                           | 0,15                                               | Gatwick Funding Ltd.                               |                           |                               |       |       |      |
| 5,000 % éch. 13/09/2033                    |                                     | 700                              | 693                       | 0,31        | CVC Cordatus Loan Fund DAC              |                                  |                           |                               |                                                    | 4,625 % éch. 27/03/2036                            |                           | 537                           | 507   | 0,22  |      |
| Nykredit Realkredit A/S                    |                                     |                                  |                           |             | 3,066 % éch. 25/04/2036                 |                                  | 700                       | 603                           | 0,27                                               | GSG Bidco Ltd.                                     |                           |                               |       |       |      |
| 3,750 % éch. 26/09/2033                    | €                                   | 100                              | 86                        | 0,04        | Dryden Euro CLO DAC                     |                                  |                           |                               |                                                    | 4,700 % éch. 15/06/2031                            | €                         | 200                           | 171   | 0,08  |      |
| Orsted A/S                                 |                                     |                                  |                           |             | 3,498 % éch. 18/10/2039                 |                                  | 600                       | 517                           | 0,23                                               | 5,375 % éch. 15/06/2036                            |                           | 250                           | 214   | 0,09  |      |
| 2,500 % éch. 16/05/2033                    | £                                   | 850                              | 699                       | 0,31        | Hayfin Emerald CLO DAC                  |                                  |                           |                               |                                                    | Heathrow Funding Ltd.                              |                           |                               |       |       |      |
| 2,500 % éch. 18/02/3021                    |                                     | 300                              | 238                       | 0,10        | 3,449 % éch. 17/11/2037                 |                                  | 1 000                     | 863                           | 0,38                                               | 5,625 % éch. 05/02/2034                            | £                         | 800                           | 780   | 0,35  |      |
| 4,875 % éch. 12/01/2032                    |                                     | 200                              | 194                       | 0,09        | Indigo Credit Management DAC            |                                  | 1 000                     | 863                           | 0,38                                               | Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                 |                           |                               | 2 481 | 1,10  |      |
| 5,125 % éch. 13/09/2034                    |                                     | 1 575                            | 1 500                     | 0,66        | 3,404 % éch. 15/07/2038                 |                                  |                           |                               |                                                    | LUXEMBOURG                                         |                           |                               |       |       |      |
| 5,750 % éch. 09/04/2040                    |                                     | 300                              | 282                       | 0,12        | Madison Park Euro Funding DAC           |                                  |                           |                               |                                                    | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                           |                               |       |       |      |
| Total Danemark                             |                                     |                                  | 3 935                     | 1,74        | 3,004 % éch. 15/07/2032                 |                                  | 592                       | 510                           | 0,22                                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                           |                               |       |       |      |
| FRANCE                                     |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS              |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.    |                                     |                                  |                           |             | OCP Euro CLO DAC                        |                                  | 500                       | 431                           | 0,19                                               | CPI Property Group S.A.                            |                           | 500                           | 487   | 0,21  |      |
| 5,000 % éch. 22/10/2029                    |                                     | 400                              | 401                       | 0,18        | 3,468 % éch. 20/10/2039                 |                                  |                           |                               |                                                    | 4,000 % éch. 22/01/2028                            |                           | 100                           | 93    | 0,04  |      |
| BNP Paribas S.A.                           |                                     |                                  |                           |             | Palmer Square European Loan Funding DAC |                                  |                           |                               |                                                    | 6,875 % éch. 05/02/2033                            |                           |                               |       |       |      |
| 2,875 % éch. 24/02/2029                    |                                     | 1 400                            | 1 332                     | 0,59        | 3,134 % éch. 15/07/2035                 |                                  | 555                       | 479                           | 0,21                                               | Logicor Financing SARL                             |                           | 1 000                         | 920   | 0,41  |      |
| 5,750 % éch. 13/06/2032                    |                                     | 1 100                            | 1 128                     | 0,50        | 3,253 % éch. 15/05/2033                 |                                  |                           |                               |                                                    | 2,750 % éch. 15/01/2030                            |                           |                               | 1 500 | 0,66  |      |
| 6,000 % éch. 18/08/2029                    |                                     | 500                              | 513                       | 0,23        | 3,283 % éch. 15/05/2034                 |                                  | 67                        | 58                            | 0,02                                               | Total Luxembourg                                   |                           |                               |       |       |      |
| BPCE S.A.                                  |                                     |                                  |                           |             | Tikehau CLO DAC                         |                                  | 378                       | 327                           | 0,14                                               | MEXIQUE                                            |                           |                               |       |       |      |
| 5,250 % éch. 16/04/2029                    |                                     | 900                              | 899                       | 0,40        | 3,404 % éch. 15/10/2038                 |                                  | 700                       | 604                           | 0,27                                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                           |                               |       |       |      |
| 5,250 % éch. 31/07/2032                    |                                     | 1 600                            | 1 597                     | 0,70        | Toro European CLO DAC                   |                                  |                           |                               |                                                    | America Movil S.A.B. de C.V.                       |                           | 400                           | 394   | 0,18  |      |
| 5,375 % éch. 22/10/2031                    |                                     | 1 600                            | 1 610                     | 0,71        | 3,070 % éch. 12/01/2032                 |                                  | 1 861                     | 1 604                         | 0,71                                               | 4,948 % éch. 22/07/2033                            |                           |                               |       |       |      |
| Crédit Agricole S.A.                       |                                     |                                  |                           |             | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | ÉMISSIONS SOUVERAINES                              |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 5,375 % éch. 20/12/2037                    |                                     | 1 200                            | 1 173                     | 0,52        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | Obligation internationale du gouvernement mexicain |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 5,500 % éch. 31/07/2032                    |                                     | 600                              | 609                       | 0,27        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | 5,625 % éch. 19/03/2114                            |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 5,500 % éch. 20/12/2033                    |                                     | 700                              | 703                       | 0,31        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | Total Mexique                                      |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 5,750 % éch. 09/11/2034                    |                                     | 300                              | 303                       | 0,13        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 6,000 % éch. 22/10/2035                    |                                     | 600                              | 610                       | 0,27        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | PAYS-BAS                                           |                                                    |                           |                               |       |       |      |
| 6,375 % éch. 14/06/2031                    |                                     | 600                              | 628                       | 0,28        | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS           |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                      |                                                    |                           |                               |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS |       |       |      |
|                                            |                                     |                                  |                           |             |                                         |                                  |                           |                               |                                                    |                                                    |                           |                               |       |       |      |

# Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>NORVÈGE</b>                                         |                                     |                                  |                           | Barclays PLC                         |                                     |                                  |                           | Mitchells & Butlers Finance PLC                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 5,851 % éch. 21/03/2035              | £ 900                               | £ 909                            | 0,40                      | 4,350 % éch. 15/12/2030                                  | \$ 563                              | £ 410                            | 0,18                      |
| DNB Bank ASA                                           |                                     |                                  |                           | 6,174 % éch. 29/07/2036              | 900                                 | 914                              | 0,40                      | 6,013 % éch. 15/12/2030                                  | £ 221                               | 222                              | 0,10                      |
| 5,000 % éch. 23/07/2032                                | £ 500                               | £ 499                            | 0,22                      | 6,369 % éch. 31/01/2031              | 400                                 | 416                              | 0,18                      | Morhomes PLC                                             |                                     |                                  |                           |
| <b>PÉROU</b>                                           |                                     |                                  |                           | 7,090 % éch. 06/11/2029              | 1 250                               | 1 306                            | 0,58                      | 3,400 % éch. 19/02/2040                                  | 1 100                               | 865                              | 0,38                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 15/09/2027 (d)(f)       | 1 200                               | 1 244                            | 0,55                      | Motability Operations Group PLC                          |                                     |                                  |                           |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.           |                                     |                                  |                           | Berkeley Group PLC                   |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 18/01/2042                                  | 4 700                               | 2 809                            | 1,24                      |
| 9,700 % éch. 05/03/2045                                | PEN 1 000                           | 237                              | 0,11                      | 2,500 % éch. 11/08/2031              | 1 300                               | 1 115                            | 0,49                      | 2,375 % éch. 14/03/2032                                  | 200                                 | 173                              | 0,08                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | Blend Funding PLC                    |                                     |                                  |                           | National Gas Transmission PLC                            |                                     |                                  |                           |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien     |                                     |                                  |                           | 3,459 % éch. 21/09/2049              | 200                                 | 136                              | 0,06                      | 5,500 % éch. 04/02/2034                                  | 700                                 | 705                              | 0,31                      |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                                | 1 600                               | 372                              | 0,16                      | 5,260 % éch. 11/06/2034              | 1 000                               | 1 009                            | 0,45                      | National Grid Electricity Distribution South Wales PLC   |                                     |                                  |                           |
| 6,950 % éch. 12/08/2031                                | 3 600                               | 905                              | 0,40                      | British Land Co. PLC                 |                                     |                                  |                           | 1,625 % éch. 07/10/2035                                  | 1 300                               | 932                              | 0,41                      |
|                                                        |                                     | 1 277                            | 0,56                      | 2,375 % éch. 14/09/2029              | 1 100                               | 1 021                            | 0,45                      | National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC |                                     |                                  |                           |
| Total Pérou                                            |                                     | 1 514                            | 0,67                      | British Telecommunications Ltd.      |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 16/04/2032                                  | 2 075                               | 2 126                            | 0,94                      |
| <b>QATAR</b>                                           |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 20/12/2083              | 500                                 | 529                              | 0,23                      | National Grid Electricity Transmission PLC               |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | Bromford Flagship Livewest Ltd.      |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 16/09/2038                                  | 450                                 | 298                              | 0,13                      |
| Obligation internationale du gouvernement qatari       |                                     |                                  |                           | 3,125 % éch. 03/05/2048              | 500                                 | 321                              | 0,14                      | Nationwide Building Society                              |                                     |                                  |                           |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                | \$ 700                              | 530                              | 0,23                      | Burberry Group PLC                   |                                     |                                  |                           | 5,167 % éch. 12/12/2033                                  | 700                                 | 693                              | 0,31                      |
| <b>AFRIQUE DU SUD</b>                                  |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 20/06/2030              | 1 100                               | 1 111                            | 0,49                      | 5,750 % éch. 20/06/2027 (d)(f)                           | 1 200                               | 1 201                            | 0,53                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                           |                                     |                                  |                           | Cadent Finance PLC                   |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 20/12/2030 (d)(f)                           | 800                                 | 823                              | 0,36                      |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 14/03/2034              | 2 700                               | 2 723                            | 1,20                      | NatWest Group PLC                                        |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                | ZAR 4 500                           | 206                              | 0,09                      | Clarion Funding PLC                  |                                     |                                  |                           | 3,619 % éch. 29/03/2029                                  | 900                                 | 882                              | 0,39                      |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 22 700                              | 1 082                            | 0,48                      | 1,875 % éch. 22/01/2035              | 1 000                               | 753                              | 0,33                      | 4,758 % éch. 10/11/2031                                  | 100                                 | 99                               | 0,04                      |
| Total Afrique du Sud                                   |                                     | 1 288                            | 0,57                      | 1,875 % éch. 07/09/2051              | 3 000                               | 1 343                            | 0,59                      | 5,125 % éch. 12/05/2027 (d)(f)                           | 800                                 | 798                              | 0,35                      |
| <b>ESPAGNE</b>                                         |                                     |                                  |                           | Derwent London PLC                   |                                     |                                  |                           | 7,416 % éch. 06/06/2033                                  | 800                                 | 829                              | 0,37                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 17/11/2031              | 1 700                               | 1 441                            | 0,64                      | 7,500 % éch. 28/02/2032 (d)(f)                           | 300                                 | 309                              | 0,14                      |
| Banco de Sabadell S.A.                                 |                                     |                                  |                           | DWR Cymru Financing UK PLC           |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 03/06/2036 (d)(f)                           | 600                                 | 606                              | 0,27                      |
| 5,000 % éch. 13/10/2029                                | £ 900                               | 904                              | 0,40                      | 2,375 % éch. 31/03/2034              | 400                                 | 307                              | 0,14                      | NIE Finance PLC                                          |                                     |                                  |                           |
| Banco Santander S.A.                                   |                                     |                                  |                           | 2,500 % éch. 31/03/2036              | 1 900                               | 1 417                            | 0,63                      | 5,750 % éch. 07/12/2035                                  | 300                                 | 302                              | 0,13                      |
| 4,625 % éch. 17/11/2030                                | 500                                 | 494                              | 0,22                      | 6,250 % éch. 08/09/2037              | 200                                 | 200                              | 0,09                      | 5,875 % éch. 01/12/2032                                  | 1 400                               | 1 447                            | 0,64                      |
| 5,500 % éch. 28/04/2033                                | 1 700                               | 1 705                            | 0,75                      | Eastern Power Networks PLC           |                                     |                                  |                           | Northern Powergrid Northeast PLC                         |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 27/01/2031                                | 700                                 | 713                              | 0,32                      | 6,250 % éch. 12/11/2036              | 1 800                               | 1 888                            | 0,83                      | 5,375 % éch. 04/11/2037                                  | 500                                 | 488                              | 0,22                      |
| CaixaBank S.A.                                         |                                     |                                  |                           | Gatwick Airport Finance PLC          |                                     |                                  |                           | Northumbrian Water Finance PLC                           |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 29/11/2031                                | 2 500                               | 2 472                            | 1,09                      | 6,000 % éch. 21/11/2030              | 500                                 | 498                              | 0,22                      | 4,500 % éch. 14/02/2031                                  | 900                                 | 870                              | 0,38                      |
| 6,875 % éch. 28/02/2033                                | 200                                 | 207                              | 0,09                      | Grainger PLC                         |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 22/07/2032                                  | 500                                 | 495                              | 0,22                      |
| Total Espagne                                          |                                     | 6 495                            | 2,87                      | 3,000 % éch. 03/07/2030              | 1 315                               | 1 211                            | 0,54                      | 5,500 % éch. 02/10/2037                                  | 1 325                               | 1 248                            | 0,55                      |
| <b>SUISSE</b>                                          |                                     |                                  |                           | Greene King Finance PLC              |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 29/04/2033 (g)                              | 400                                 | 398                              | 0,18                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 3,593 % éch. 15/03/2035              | 278                                 | 257                              | 0,11                      | Pacific Quay Finance PLC                                 |                                     |                                  |                           |
| UBS Group AG                                           |                                     |                                  |                           | 4,064 % éch. 15/03/2035              | 158                                 | 148                              | 0,07                      | 5,565 % éch. 25/07/2034                                  | 127                                 | 129                              | 0,06                      |
| 2,125 % éch. 15/11/2029                                | 1 500                               | 1 411                            | 0,62                      | 5,318 % éch. 15/09/2031              | 502                                 | 501                              | 0,22                      | Peabody Trust                                            |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>                             |                                     |                                  |                           | Heathrow Finance PLC                 |                                     |                                  |                           | 3,250 % éch. 14/09/2048                                  | 400                                 | 251                              | 0,11                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/03/2027              | 900                                 | 893                              | 0,39                      | Pension Insurance Corp. PLC                              |                                     |                                  |                           |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                              |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 01/09/2029              | 400                                 | 377                              | 0,17                      | 7,375 % éch. 25/07/2029 (d)(f)                           | 200                                 | 205                              | 0,09                      |
| 4,697 % éch. 19/08/2031                                | 600                                 | 591                              | 0,26                      | HSBC Holdings PLC                    |                                     |                                  |                           | Pinewood Finco PLC                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                                | \$ 700                              | 528                              | 0,24                      | 3,000 % éch. 29/05/2030              | 1 700                               | 1 612                            | 0,71                      | 6,000 % éch. 27/03/2030                                  | 500                                 | 501                              | 0,22                      |
| Total Émirats arabes unis                              |                                     | 1 119                            | 0,50                      | 5,813 % éch. 22/05/2033              | 1 100                               | 1 128                            | 0,50                      | Places for People Treasury PLC                           |                                     |                                  |                           |
| <b>ROYAUME-UNI</b>                                     |                                     |                                  |                           | 6,800 % éch. 14/09/2031              | 1 300                               | 1 382                            | 0,61                      | 6,250 % éch. 06/12/2041                                  | 100                                 | 99                               | 0,04                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                     |                                     |                                  |                           | 8,201 % éch. 16/11/2034              | 1 100                               | 1 187                            | 0,52                      | Sage Group PLC                                           |                                     |                                  |                           |
| Curzon Mortgages PLC                                   |                                     |                                  |                           | Imperial Brands Finance PLC          |                                     |                                  |                           | 1,625 % éch. 25/02/2031                                  | 600                                 | 509                              | 0,23                      |
| 4,592 % éch. 28/07/2049                                | £ 600                               | 600                              | 0,26                      | 4,875 % éch. 07/06/2032              | 1 100                               | 1 074                            | 0,47                      | Santander UK Group Holdings PLC                          |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                   |                                     |                                  |                           | InterContinental Hotels Group PLC    |                                     |                                  |                           | 2,421 % éch. 17/01/2029                                  | 200                                 | 193                              | 0,09                      |
| Affinity Water Finance PLC                             |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 08/10/2028              | 1 175                               | 1 135                            | 0,50                      | 7,482 % éch. 29/08/2029                                  | 850                                 | 893                              | 0,39                      |
| 6,250 % éch. 12/09/2040                                | 562                                 | 558                              | 0,25                      | J Sainsbury PLC                      |                                     |                                  |                           | Scottish Hydro Electric Transmission PLC                 |                                     |                                  |                           |
| Anglian Water Osprey Financing PLC                     |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 29/01/2035              | 200                                 | 200                              | 0,09                      | 5,500 % éch. 15/01/2044                                  | 1 000                               | 927                              | 0,41                      |
| 2,000 % éch. 31/07/2028                                | 1 200                               | 1 112                            | 0,49                      | John Lewis PLC                       |                                     |                                  |                           | Segro PLC                                                |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 27/08/2031                                | 1 500                               | 1 512                            | 0,67                      | 4,250 % éch. 18/12/2034              | 1 344                               | 1 139                            | 0,50                      | 2,875 % éch. 11/10/2037                                  | 900                                 | 696                              | 0,31                      |
| Anglian Water Services Financing PLC                   |                                     |                                  |                           | Legal & General Group PLC            |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 20/06/2035                                  | 600                                 | 617                              | 0,27                      |
| 2,750 % éch. 26/10/2029                                | 400                                 | 371                              | 0,16                      | 5,625 % éch. 24/03/2031 (d)(f)       | 1 200                               | 1 156                            | 0,51                      | Society of Lloyd's                                       |                                     |                                  |                           |
| Assura Financing PLC                                   |                                     |                                  |                           | Liberty Living Finance PLC           |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 07/02/2047                                  | 500                                 | 499                              | 0,22                      |
| 1,625 % éch. 30/06/2033                                | 600                                 | 466                              | 0,21                      | 3,375 % éch. 28/11/2029              | 100                                 | 95                               | 0,04                      | South West Water Finance PLC                             |                                     |                                  |                           |
| Aster Treasury PLC                                     |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC             |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/09/2031                                  | 1 300                               | 1 288                            | 0,57                      |
| 1,405 % éch. 27/01/2036                                | 700                                 | 484                              | 0,21                      | 5,250 % éch. 16/10/2031              | 1 000                               | 1 007                            | 0,45                      | 5,750 % éch. 11/12/2032                                  | 725                                 | 733                              | 0,32                      |
| Aviva PLC                                              |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 08/06/2033              | 1 200                               | 1 210                            | 0,54                      | Southern Gas Networks PLC                                |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 28/11/2057                                | € 600                               | 530                              | 0,23                      | 5,625 % éch. 16/09/2036              | 400                                 | 400                              | 0,18                      | 3,100 % éch. 15/09/2036                                  | 550                                 | 434                              | 0,19                      |
| 6,875 % éch. 15/12/2031 (d)(f)                         | £ 500                               | 510                              | 0,23                      | 8,500 % éch. 27/09/2027 (d)(f)       | 1 600                               | 1 658                            | 0,73                      | SW Finance PLC                                           |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           | London & Quadrant Housing Trust      |                                     |                                  |                           | 3,000 % éch. 28/05/2037                                  | 2 000                               | 1 418                            | 0,63                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 20/10/2038              | 1 550                               | 1 023                            | 0,45                      | 5,750 % éch. 19/11/2030                                  | 300                                 | 293                              | 0,13                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 31/03/2032              | 1 000                               | 845                              | 0,37                      | 6,125 % éch. 19/11/2033                                  | 300                                 | 288                              | 0,13                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | LSEGA Financing PLC                  |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 07/08/2032                                  | 500                                 | 504                              | 0,22                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 19/09/2032              | 600                                 | 594                              | 0,26                      | 7,375 % éch. 12/12/2041 (g)                              | 500                                 | 491                              | 0,22                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | M&G PLC                              |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 31/10/2031                                  | 300                                 | 311                              | 0,14                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 20/10/2051              | 500                                 | 497                              | 0,22                      | Tesco Corporate Treasury Services PLC                    |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           | Manchester Airport Group Funding PLC |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 22/05/2034                                  | 800                                 | 778                              | 0,34                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 30/09/2044              | 3 475                               | 2 218                            | 0,98                      | 5,500 % éch. 27/02/2035                                  | 200                                 | 198                              | 0,09                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           | Marks & Spencer PLC                  |                                     |                                  |                           | Tesco Property Finance PLC                               |                                     |                                  |                           |
|                                                        |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 18/08/2032              | 600                                 | 592                              | 0,26                      | 5,744 % éch. 13/04/2040                                  | 900                                 | 901                              | 0,40                      |
|                                                        |                                     |                                  |                           |                                      |                                     |                                  |                           | 6,052 % éch. 13/10/2039                                  | 100                                 | 103                              | 0,05                      |

| DESCRIPTION                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| TP ICAP Finance PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | Tower Bridge Funding PLC               |                                     |                                  |                           | Stellantis Financial Services U.S. Corp.                                                   |                                     |                                  |                           |
| 2,625 % éch. 18/11/2028                                                                    | £ 1 450                             | £ 1 367                          | 0,60                      | 4,497 % éch. 20/01/2073                | £ 594                               | £ 594                            | 0,26                      | 5,328 % éch. 15/09/2028                                                                    | \$ 200                              | £ 151                            | 0,07                      |
| 6,375 % éch. 12/06/2032                                                                    | 900                                 | 924                              | 0,41                      | 4,538 % éch. 20/12/2066                | 829                                 | 829                              | 0,37                      | Time Warner Cable LLC                                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                                                                            |                                     |                                  |                           |                                        |                                     | 5 134                            | 2,27                      | 5,250 % éch. 15/07/2042                                                                    | £ 875                               | 717                              | 0,32                      |
| Tritax Big Box REIT PLC                                                                    | 800                                 | 786                              | 0,35                      |                                        |                                     |                                  |                           | Verizon Communications, Inc.                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,750 % éch. 12/11/2032                                                                    |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES                  |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 17/02/2034                                                                    | 1 800                               | 1 722                            | 0,76                      |
| United Utilities Water Finance PLC                                                         |                                     |                                  |                           | Bon du Trésor britannique              | 7 500                               | 3 186                            | 1,41                      | Wells Fargo & Co.                                                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 03/07/2033                                                                    | 600                                 | 481                              | 0,21                      | 1,250 % éch. 31/07/2051                |                                     |                                  |                           | 2,125 % éch. 24/09/2031                                                                    | 900                                 | 784                              | 0,35                      |
| 2,625 % éch. 12/02/2031                                                                    | 550                                 | 494                              | 0,22                      | Total Royaume-Uni                      | 108 925                             | 48,12                            |                           | 4,625 % éch. 02/11/2035                                                                    | 2 500                               | 2 355                            | 1,04                      |
| 5,125 % éch. 06/10/2038                                                                    | 875                                 | 798                              | 0,35                      | ÉTATS-UNIS                             |                                     |                                  |                           | Welltower OP LLC                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Virgin Media Secured Finance PLC                                                           |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS          |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/12/2034                                                                    | 1 275                               | 1 200                            | 0,53                      |
| 4,250 % éch. 15/01/2030                                                                    | 600                                 | 530                              | 0,23                      | AES Corp.                              |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 20/11/2028                                                                    | 500                                 | 500                              | 0,22                      |
| Virgin Money UK PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 15/07/2029                | \$ 100                              | 76                               | 0,03                      |                                                                                            | 23 690                              | 10,46                            |                           |
| 7,625 % éch. 23/08/2029                                                                    | 400                                 | 423                              | 0,19                      | 5,750 % éch. 15/07/2033                | 100                                 | 76                               | 0,03                      | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |
| Vmed O2 UK Financing PLC                                                                   |                                     |                                  |                           | Alphabet, Inc.                         |                                     |                                  |                           | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/07/2031                                                                    | 1 100                               | 908                              | 0,40                      | 3,625 % éch. 11/05/2034                | € 300                               | 262                              | 0,12                      | 4,263 % éch. 25/04/2035                                                                    | \$ 58                               | 41                               | 0,02                      |
| Vodafone Group PLC                                                                         |                                     |                                  |                           | 4,100 % éch. 11/05/2039                | 300                                 | 264                              | 0,12                      | Sequoia Mortgage Trust                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 03/07/2050                                                                    | 1 025                               | 1 002                            | 0,44                      | 5,875 % éch. 13/02/2058                | £ 400                               | 381                              | 0,17                      | 2,999 % éch. 20/07/2037                                                                    | 4                                   | 2                                | 0,00                      |
| Weir Group PLC                                                                             |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 13/02/2126                | 400                                 | 379                              | 0,17                      | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 14/06/2028                                                                    | 1 100                               | 1 130                            | 0,50                      | AT&T, Inc.                             |                                     |                                  |                           | 5,923 % éch. 25/02/2034                                                                    | 1                                   | 0                                | 0,00                      |
| Wessex Water Services Finance PLC                                                          |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 01/06/2043                | 1 175                               | 910                              | 0,40                      | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 19/09/2034                                                                    | 2 625                               | 2 637                            | 1,17                      | 5,200 % éch. 18/11/2033                | 500                                 | 494                              | 0,22                      | 4,944 % éch. 25/11/2042                                                                    | 7                                   | 5                                | 0,00                      |
| Westfield Stratford City Finance PLC                                                       |                                     |                                  |                           | Athene Global Funding                  |                                     |                                  |                           |                                                                                            | 48                                  | 0,02                             |                           |
| 5,124 % éch. 05/05/2036                                                                    | 600                                 | 605                              | 0,27                      | 5,150 % éch. 28/07/2027                | 900                                 | 902                              | 0,40                      | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN                                                          |                                     |                                  |                           |
| Whitbread Group PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | Bank of America Corp.                  |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA                             |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 31/05/2032                                                                    | 1 100                               | 1 087                            | 0,48                      | 3,584 % éch. 27/04/2031                | 1 700                               | 1 627                            | 0,72                      | 3,000 % éch. 01/08/2056                                                                    | 4 100                               | 2 692                            | 1,19                      |
| Workspace Group PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | Digital Stout Holding LLC              |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 01/07/2056                                                                    | 6 250                               | 4 402                            | 1,95                      |
| 2,250 % éch. 11/03/2028                                                                    | 800                                 | 761                              | 0,34                      | 3,750 % éch. 17/10/2030                | 450                                 | 426                              | 0,19                      | 4,500 % éch. 01/07/2056 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Yorkshire Water Finance PLC                                                                |                                     |                                  |                           | Doctors Co. An Interinsurance Exchange |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                                                 | 5 500                               | 3 969                            | 1,75                      |
| 1,750 % éch. 27/10/2032                                                                    | 200                                 | 159                              | 0,07                      | 4,500 % éch. 18/01/2032                | \$ 500                              | 350                              | 0,15                      | 5,000 % éch. 01/07/2056 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 18/04/2041                                                                    | 700                                 | 449                              | 0,20                      | Ford Motor Credit Co. LLC              |                                     |                                  |                           | 01/08/2056                                                                                 | 8 600                               | 6 362                            | 2,81                      |
| 5,250 % éch. 28/04/2030                                                                    | 1 100                               | 1 095                            | 0,48                      | 5,625 % éch. 09/10/2028                | £ 200                               | 201                              | 0,09                      | 5,500 % éch. 01/07/2056                                                                    | 1 500                               | 1 134                            | 0,50                      |
| 6,000 % éch. 22/07/2033                                                                    | 200                                 | 201                              | 0,09                      | 6,184 % éch. 29/08/2031                | 600                                 | 612                              | 0,27                      | 6,000 % éch. 01/08/2056 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 18/11/2034                                                                    | 975                                 | 999                              | 0,44                      | GA Global Funding Trust                |                                     |                                  |                           | 01/09/2056                                                                                 | 18 850                              | 14 462                           | 6,39                      |
| 6,625 % éch. 22/07/2040                                                                    | 200                                 | 199                              | 0,09                      | 5,414 % éch. 15/12/2032                | 500                                 | 489                              | 0,22                      | 6,500 % éch. 01/08/2056                                                                    | 17 300                              | 13 469                           | 5,95                      |
|                                                                                            | 100 005                             | 44,18                            |                           | Goldman Sachs Group, Inc.              |                                     |                                  |                           |                                                                                            | 46 490                              | 20,54                            |                           |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR<br>DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 1,875 % éch. 16/12/2030                | 1 000                               | 884                              | 0,39                      | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMERICAIN                                                            |                                     |                                  |                           |
| Atlas Funding PLC                                                                          |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 18/01/2038                | 800                                 | 849                              | 0,37                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,886 % éch. 20/01/2061                                                                    | 465                                 | 466                              | 0,21                      | Jane Street Group                      |                                     |                                  |                           | 1,125 % éch. 15/10/2030                                                                    | 1 750                               | 1 281                            | 0,57                      |
| Canada Square Funding PLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/11/2032                | \$ 1 000                            | 754                              | 0,33                      | 1,875 % éch. 15/07/2034                                                                    | 1 167                               | 867                              | 0,38                      |
| 5,409 % éch. 17/06/2058                                                                    | 4                                   | 5                                | 0,00                      | JPMorgan Chase & Co.                   |                                     |                                  |                           |                                                                                            | 2 148                               | 0,95                             |                           |
| Eurohome UK Mortgages PLC                                                                  |                                     |                                  |                           | 1,895 % éch. 28/04/2033                | £ 900                               | 765                              | 0,34                      | Total États-Unis                                                                           |                                     |                                  |                           |
| 4,016 % éch. 15/06/2044                                                                    | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Morgan Stanley                         |                                     |                                  |                           |                                                                                            | 72 376                              | 31,97                            |                           |
| EuroMASTR PLC                                                                              |                                     |                                  |                           | 5,213 % éch. 24/10/2035                | 650                                 | 638                              | 0,28                      | Total des Valeurs mobilières                                                               | £ 258 429                           | 114,17                           |                           |
| 4,066 % éch. 15/06/2040                                                                    | 267                                 | 263                              | 0,12                      | 5,432 % éch. 10/09/2032                | 600                                 | 609                              | 0,27                      | ACTIONS                                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Frontier Mortgage Funding PLC                                                              |                                     |                                  |                           | 5,789 % éch. 18/11/2033                | 600                                 | 615                              | 0,27                      | FONDS D'INVESTISSEMENT                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,464 % éch. 20/12/2066                                                                    | 318                                 | 317                              | 0,14                      | Pacific Life Global Funding            |                                     |                                  |                           | FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Harvest Funding PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 30/11/2028                | 300                                 | 304                              | 0,13                      | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO                                                               |                                     |                                  |                           |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                    | 800                                 | 800                              | 0,35                      | Protective Life Global Funding         |                                     |                                  |                           | Sterling Short Maturity                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Ludgate Funding PLC                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,803 % éch. 01/11/2030                | 700                                 | 698                              | 0,31                      | UCITS ETF (e)                                                                              | 40 200                              | 4 168                            | 1,84                      |
| 4,466 % éch. 01/01/2061                                                                    | 698                                 | 693                              | 0,31                      | RD Michigan Property Owner LLC         |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement                                                           | £ 4 168                             | 1,84                             |                           |
| Mansard Mortgages PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/03/2045                | \$ 1 400                            | 1 052                            | 0,46                      |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,516 % éch. 15/12/2049                                                                    | 25                                  | 25                               | 0,01                      | Realty Income Corp.                    |                                     |                                  |                           |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Pierpont BTL PLC                                                                           |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 13/07/2033                | £ 600                               | 477                              | 0,21                      |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,846 % éch. 21/09/2054                                                                    | 624                                 | 625                              | 0,28                      | 5,750 % éch. 05/12/2031                | 1 100                               | 1 133                            | 0,50                      |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Stratton Mortgage Funding PLC                                                              |                                     |                                  |                           | Spirit Airlines Pass-Through Trust     |                                     |                                  |                           |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 4,896 % éch. 20/06/2060                                                                    | 237                                 | 237                              | 0,10                      | 4,100 % éch. 01/10/2029                | \$ 47                               | 34                               | 0,01                      |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                                            |                                     |                                  |                           |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 5,147 % éch. 20/02/2054                                                                    | 277                                 | 278                              | 0,12                      |                                        |                                     |                                  |                           |                                                                                            |                                     |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                 | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension à<br>recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BPS                                   | 4,000 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | £ 100                   | Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 22/05/2029                           | £ (102)             | £ 100                                          | £ 100                                                                          | 0,04                   |
| CEW                                   | 4,000           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 2 200                   | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/06/2032                           | (2 238)             | 2 200                                          | 2 200                                                                          | 0,98                   |
| SCX                                   | 4,000           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 100                     | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation 0,125 %<br>éch. 22/03/2039 | (102)               | 100                                            | 100                                                                            | 0,04                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                             | £ (2 442)           | £ 2 400                                        | £ 2 400                                                                        | 1,06                   |

(1) Comprend les intérêts courus.

## Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois septembre                                  | Court | 09/2026           | 98                 | £ (30)                            | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2030           | 28                 | (7)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                        | Long  | 03/2027           | 14                 | 4                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                        | Long  | 03/2028           | 38                 | 18                                | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                        | Long  | 03/2029           | 33                 | 2                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                        | Long  | 03/2030           | 34                 | (29)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre         | Long  | 09/2026           | 36                 | 10                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Long  | 09/2026           | 26                 | 20                                | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026           | 6                  | (3)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre       | Long  | 09/2026           | 89                 | 80                                | 0,04                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 28                 | (16)                              | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Court | 09/2026           | 24                 | (48)                              | (0,02)              |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Long  | 09/2026           | 112                | 10                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Court | 09/2026           | 17                 | 4                                 | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Court | 09/2026           | 7                  | (1)                               | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026           | 561                | 229                               | 0,10                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 86                 | (74)                              | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Long  | 09/2026           | 41                 | 26                                | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 39                 | 99                                | 0,04                |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 261                | 372                               | 0,16                |
|                                                                                               |       |                   |                    | £ 666                             | 0,29                |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | £ 666                             | 0,29                |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG    | 1,000 %              | 20/12/2030      | € 300                            | £ 1                               | 0,00                |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION<sup>(2)</sup>

| Indice/Tranches                             | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 10 ans | (1,000) %           | 20/06/2036      | € 12 400                         | £ (36)                            | (0,02)              |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                              | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(3)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans               | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 15 570                        | £ 46                              | 0,02                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans               | 1,000                | 20/06/2031      | 43 620                           | 117                               | 0,05                |
| Indice iTraxx Crossover 45 Index à 5 ans     | 5,000                | 20/06/2031      | € 3 300                          | 58                                | 0,03                |
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans   | 1,000                | 20/06/2031      | 48 450                           | 71                                | 0,03                |
| Indice iTraxx Europe Senior 45 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 8 000                            | 15                                | 0,01                |
|                                              |                      |                 |                                  | £ 307                             | 0,14                |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2028      | £ 23 580          | £ 10                              | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2028      | 5 000             | 47                                | 0,02                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031      | 3 100             | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036      | 11 900            | (170)                             | (0,08)              |
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056      | 6 070             | 127                               | 0,06                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056      | 1 070             | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 17/12/2027      | ¥ 1 170 000       | (3)                               | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000     | 18/03/2028      | 1 230 000         | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500     | 17/06/2028      | 1 210 000         | (10)                              | (0,01)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 1,250     | 17/06/2030      | \$ 8 000          | (527)                             | (0,23)              |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 19/03/2032      | 17 800            | 67                                | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2035      | 13 600            | 164                               | 0,07                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/06/2033      | 2 600             | 14                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,551     | 17/09/2035      | 900               | 27                                | 0,01                |



| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 %   | 17/09/2030      | \$ 22 100         | £ 326                             | 0,14                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/12/2035      | 1 800             | 32                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 17/06/2036      | 1 900             | 7                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/06/2046      | 4 100             | (55)                              | (0,02)              |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/06/2056      | 6 000             | (72)                              | (0,03)              |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 16/09/2056      | 1 900             | 0                                 | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,013    | 02/01/2029      | BRL 8 400         | (27)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,354    | 02/01/2029      | 34 100            | (105)                             | (0,05)              |
| À payer                                            | EURIBOR EUR à 6 mois          | 1,940     | 05/03/2027      | € 6 000           | (64)                              | (0,03)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,250     | 16/09/2028      | 6 900             | (54)                              | (0,02)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,280     | 04/03/2030      | 1 300             | 17                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,300     | 25/09/2029      | 700               | 2                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,350     | 29/04/2030      | 1 000             | 13                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,360     | 07/10/2029      | 800               | 1                                 | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,400     | 09/04/2030      | 1 300             | 15                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,650     | 14/08/2029      | 800               | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,700     | 13/08/2029      | 1 000             | (13)                              | (0,01)              |
| À payer <sup>(4)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,750     | 16/09/2036      | 5 800             | 100                               | 0,04                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,760     | 03/01/2029      | 400               | (1)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,880     | 19/12/2028      | 600               | (9)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 2,950     | 29/12/2028      | 300               | (5)                               | 0,00                |
| À recevoir <sup>(4)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,000     | 16/09/2056      | 2 250             | (64)                              | (0,03)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,179     | 29/11/2028      | 200               | (4)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,255     | 22/11/2028      | 300               | (7)                               | 0,00                |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,270     | 08/11/2028      | 600               | (11)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | NIBOR NOK à 6 mois            | 3,780     | 05/03/2027      | NOK 156 300       | 121                               | 0,05                |
| À payer                                            | NIBOR NOK à 6 mois            | 3,780     | 05/03/2027      | 156 300           | (39)                              | (0,01)              |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,501     | 10/05/2029      | \$ 2 000          | 14                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | CPURNSA                       | 2,520     | 04/04/2029      | 1 950             | 9                                 | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | £ (136)                           | (0,06)              |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | £ 136                             | 0,06                |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

#### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CNH             | 135               | \$ 20              | £ 0                   | £ 0                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 178               | 140                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | £               | 750               | € 868              | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 143               | NOK 1 775          | 0                     | (8)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 869             | \$ 1 464           | 14                    | 14                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 100               | CNH 676            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 500               | INR 47 355         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 16                | PLN 61             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           |                 | 262               | \$ 88              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | ILS             | 282               | 16                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | MXN             | 324               | 62                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 901               | 133                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 733               | € 850              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1 010             | \$ 1 353           | 10                    | 10                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 13 700 988        | 764                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 331               | 112                | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 21 130            | 220                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 48 085            | 32                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 3 486             | 106                | 1                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 16                | BRL 80             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 13 076            | £ 9 766            | 2                     | (89)                                    | (0,04)              |
|              | 07/2026           |                 | 1 464             | HUF 447 216        | 0                     | (22)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           |                 | 802               | INR 76 070         | 1                     | (1)                                     | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |      |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|------|
| BRC          | 07/2026           | \$              | 210               | KRW 322 940        | £ 0                   | £ (1)                                   | £ (1)               | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 53                | TWD 1 659          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | ZAR             | 2 470             | \$ 151             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | CAD             | 899               | £ 480              | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 60                | \$ 20              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | \$              | 131               | BRL 667            | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 361 989         | \$ 75              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | THB             | 2 656             | 82                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | \$              | 392               | IDR 6 947 159      | 1                     | (6)                                     | (5)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 46                | INR 4 389          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 20                | THB 656            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 12/2026           |                 | 46                | IDR 834 003        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | £               | 303               | € 350              | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | ILS             | 406               | \$ 137             | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | NOK             | 465               | £ 36               | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 179             | \$ 921             | 7                     | 0                                       | 7                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | TRY             | 14 216            | 296                | 0                     | (3)                                     | (3)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 1 983             | TRY 94 352         | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,01   |      |
|              | CBK               | 07/2026         | ZAR               | 20 276             | \$ 1 242              | 6                                       | (1)                 | 5      | 0,00 |
| 07/2026      |                   | AUD             | 393               | £ 209              | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | €               | 517               | 448                | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | £               | 7                 | CZK 190            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | ILS             | 369               | \$ 127             | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | INR             | 14 092            | 149                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | \$              | 910               | BRL 4 621          | 0                     | (13)                                    | (13)                | (0,01) |      |
| 07/2026      |                   |                 | 129               | COP 445 188        | 1                     | (1)                                     | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 279               | IDR 4 974 776      | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 145               | INR 14 092         | 3                     | 0                                       | 3                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 20                | KRW 29 870         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 411               | PLN 1 522          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 19                | TWD 594            | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   | ILS             | 2 238             | \$ 770             | 13                    | 0                                       | 13                  | 0,01   |      |
| 09/2026      |                   | COP             | 257 531           | 65                 | 0                     | (6)                                     | (6)                 | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | IDR             | 4 726 729         | 262                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | INR             | 961               | 10                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | THB             | 4 245             | 128                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| DUB          |                   | 09/2026         | \$                | 88                 | IDR 1 567 591         | 0                                       | (1)                 | (1)    | 0,00 |
|              | 09/2026           |                 | 53                | MXN 949            | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           |                 | 0                 | PEN 0              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 10/2026           | COP             | 391 751           | \$ 111             | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 10/2026           | PEN             | 6 938             | 2 004              | 0                     | (17)                                    | (17)                | (0,01) |      |
|              | 11/2026           | COP             | 64 320            | 18                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 12/2026           | PEN             | 101               | 29                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 12/2026           | \$              | 143               | IDR 2 591 795      | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | IDR             | 269 867           | \$ 15              | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | INR             | 5 533             | 59                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | SGD             | 214               | 168                | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 412               | CNH 2 801          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 39                | INR 3 771          | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 249               | PLN 925            | 0                     | (2)                                     | (2)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | ZAR             | 5 672             | \$ 350             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | CNH             | 2 795             | 412                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 2 760 224         | 153                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | GLM               | 09/2026         | \$                | 54                 | IDR 979 741           | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00 |
|              |                   | 09/2026         |                   | 59                 | INR 5 570             | 0                                       | 0                   | 0      | 0,00 |
| 07/2026      |                   | BRL             | 185               | \$ 37              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | CNH             | 947               | 140                | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | KRW             | 48 650            | 32                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   | \$              | 52                | COP 183 961        | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 120               | IDR 2 142 832      | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 32                | KRW 48 644         | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 07/2026      |                   |                 | 16                | PLN 60             | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 08/2026      |                   |                 | 2 409             | BRL 12 296         | 0                     | (40)                                    | (40)                | (0,02) |      |
| 08/2026      |                   |                 | 37                | INR 3 514          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | COP             | 907 836           | \$ 247             | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | IDR             | 2 155 381         | 120                | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | THB             | 7 961             | 247                | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   | \$              | 284               | BRL 1 460          | 0                     | (4)                                     | (4)                 | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 252               | IDR 4 518 163      | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |      |
| 09/2026      |                   |                 | 229               | INR 22 074         | 2                     | 0                                       | 2                   | 0,00   |      |
| JPM          |                   | 11/2026         | COP               | 189 278            | \$ 52                 | 0                                       | (1)                 | (1)    | 0,00 |
|              |                   | 07/2026         | BRL               | 5 162              | 1 003                 | 4                                       | 0                   | 4      | 0,00 |
|              | 07/2026           | ILS             | 1 039             | 348                | 0                     | (1)                                     | (1)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | INR             | 4 715             | 50                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | KRW             | 90 805            | 60                 | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | NZD             | 892               | £ 387              | 5                     | 0                                       | 5                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           | \$              | 17                | IDR 310 887        | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 50                | INR 4 715          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 391               | PLN 1 425          | 0                     | (9)                                     | (9)                 | 0,00   |      |
|              | 07/2026           |                 | 64                | THB 2 152          | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |
|              | 08/2026           | ILS             | 835               | \$ 286             | 4                     | 0                                       | 4                   | 0,00   |      |
|              | 09/2026           | IDR             | 312 615           | 17                 | 0                     | 0                                       | 0                   | 0,00   |      |

| Contrepartie | Mois de règlement                                  | Devise à livrer |            | Devise à recevoir |           | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|----------------------------------------------------|-----------------|------------|-------------------|-----------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| MBC          | 09/2026                                            | INR             | 6 631      | \$                | 70        | £ 0                | £ 0                   | £ 0                                     | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | MXN             | 280        |                   | 16        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | THB             | 6 275      |                   | 192       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | \$              | 71         | INR               | 6 779     | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            |                 | 1 498      | MXN               | 26 040    | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |        |
|              | 10/2026                                            |                 | 1 003      | BRL               | 5 275     | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |        |
|              | 12/2026                                            |                 | 208        | MXN               | 3 671     | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | CHF             | 750        | £                 | 713       | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,01                |        |
|              | 07/2026                                            | COP             | 671 289    | \$                | 177       | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |        |
|              | 07/2026                                            | €               | 533        | £                 | 459       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | £               | 532        | €                 | 616       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 991        | ¥                 | 212 400   | 0                  | (7)                   | (7)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 1 437      | \$                | 1 900     | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | IDR             | 29 480     |                   | 2         | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | INR             | 5 555      |                   | 59        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | KRW             | 130 268    |                   | 86        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | NZD             | 84         | £                 | 37        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | \$              | 152        | BRL               | 789       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 2 471      | £                 | 1 837     | 0                  | (25)                  | (25)                                    | (0,01)              |        |
|              | MYI                                                | 07/2026         |            | 91                | INR       | 8 742              | 1                     | 0                                       | 1                   | 0,00   |
| 09/2026      |                                                    | THB             | 2 820      | \$                | 84        | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
| 09/2026      |                                                    | \$              | 237        | INR               | 22 702    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 09/2026      |                                                    |                 | 869        | MXN               | 15 045    | 0                  | (10)                  | (10)                                    | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    | CAD             | 627        | £                 | 337       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    | CHF             | 506        |                   | 476       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    | €               | 793        |                   | 688       | 4                  | 0                     | 4                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    | £               | 5 478      | €                 | 6 346     | 0                  | (11)                  | (11)                                    | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    |                 | 258        | ¥                 | 55 500    | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    |                 | 2 492      | \$                | 3 338     | 25                 | (1)                   | 24                                      | 0,01                |        |
| 07/2026      |                                                    | NOK             | 825        | £                 | 65        | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    | NZD             | 1 624      |                   | 715       | 19                 | 0                     | 19                                      | 0,01                |        |
| 07/2026      |                                                    | \$              | 2 748      |                   | 2 071     | 7                  | (7)                   | 0                                       | 0,00                |        |
| 08/2026      |                                                    | €               | 6 246      |                   | 5 399     | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,01                |        |
| 07/2026      |                                                    | \$              | 111        | IDR               | 1 983 449 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    |                 | 92         | INR               | 8 823     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    |                 | 575        | TRY               | 27 047    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 09/2026      |                                                    | IDR             | 1 994 573  | \$                | 111       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| 09/2026      |                                                    | \$              | 54         | IDR               | 957 042   | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
| 07/2026      |                                                    | £               | 679        | €                 | 782       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |        |
| RYL          | 07/2026                                            |                 | 45         | NOK               | 570       | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 20         | SEK               | 250       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 38         | \$                | 50        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | \$              | 682        | £                 | 516       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | €               | 723        |                   | 628       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | £               | 7 903      | \$                | 10 472    | 6                  | (20)                  | (14)                                    | (0,01)              |        |
|              | 07/2026                                            | ¥               | 134 000    | £                 | 624       | 3                  | 0                     | 3                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | \$              | 794        |                   | 593       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 40         | IDR               | 721 084   | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 121        | INR               | 11 569    | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 08/2026                                            |                 | 9 440      | £                 | 7 132     | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,01                |        |
|              | 08/2026                                            |                 | 91         | INR               | 8 728     | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | IDR             | 2 164 435  | \$                | 120       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | THB             | 2 834      |                   | 88        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | \$              | 137        | IDR               | 2 461 556 | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | CAD             | 1 938      | £                 | 1 040     | 10                 | 0                     | 10                                      | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | CNH             | 1 496      | \$                | 221       | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | €               | 17 193     | £                 | 14 913    | 104                | 0                     | 104                                     | 0,05                |        |
|              | 07/2026                                            | £               | 7 574      | €                 | 8 777     | 0                  | (13)                  | (13)                                    | (0,01)              |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 1 477      | \$                | 1 952     | 1                  | (7)                   | (6)                                     | 0,00                |        |
| 07/2026      | \$                                                 | 92              | £          | 69                | 0         | 0                  | 0                     | 0,00                                    |                     |        |
| SCX          | 07/2026                                            |                 | 2 661      | SGD               | 3 446     | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
|              | 08/2026                                            | €               | 8 427      | £                 | 7 280     | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,01                |        |
|              | 08/2026                                            | £               | 69         | \$                | 92        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 08/2026                                            | SGD             | 3 438      |                   | 2 661     | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |        |
|              | 08/2026                                            | \$              | 1 902      | £                 | 1 440     | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | THB             | 11 040     | \$                | 340       | 5                  | 0                     | 5                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | \$              | 737        | £                 | 558       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
|              | 08/2026                                            | COP             | 1 063 602  | \$                | 279       | 0                  | (20)                  | (20)                                    | (0,01)              |        |
|              | 08/2026                                            | £               | 558        |                   | 737       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | AUD             | 120        | £                 | 63        | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |        |
| UAG          | 07/2026                                            | CHF             | 146        |                   | 137       | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | £               | 500        | CAD               | 938       | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            |                 | 1 009      | \$                | 1 347     | 7                  | (1)                   | 6                                       | 0,00                |        |
|              | 07/2026                                            | \$              | 254        | PLN               | 927       | 0                  | (5)                   | (5)                                     | 0,00                |        |
|              | 08/2026                                            | CAD             | 936        | £                 | 500       | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |        |
|              | 09/2026                                            | THB             | 380        | \$                | 12        | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |        |
|              | 12/2026                                            | COP             | 11 704 730 |                   | 2 999     | 0                  | (201)                 | (201)                                   | (0,09)              |        |
|              |                                                    |                 |            |                   |           |                    | £ 410                 | £ (640)                                 | £ (230)             | (0,10) |
|              | Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                 |            |                   |           |                    |                       |                                         | £ (230)             | (0,10) |

## Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                            | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>        |                                  |                                  |                        |
| Credit Suisse AG AT1 Claim             | \$ 200                           | £ 53                             | 0,02                   |
| Total des Autres actifs financiers     |                                  | £ 53                             | 0,02                   |
| Total des Investissements              |                                  | £ 265 622                        | 117,34                 |
| Autres actifs et passifs à court terme |                                  | £ (39 261)                       | (17,34)                |
| Actif net                              |                                  | £ 226 361                        | 100,00                 |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 791 £ (31 décembre 2025 : 0 £) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 6 602 £ (31 décembre 2025 : 6 404 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | £ 0                                                                                        | £ 258 429                                                  | £ 0                                                        | £ 258 429        |
| Fonds d'investissement                        | 4 168                                                                                      | 0                                                          | 0                                                          | 4 168            |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 2 400                                                      | 0                                                          | 2 400            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 390                                                                                        | 182                                                        | 0                                                          | 572              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 53                                                         | 0                                                          | 53               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>£ 4 558</b>                                                                             | <b>£ 261 064</b>                                           | <b>£ 0</b>                                                 | <b>£ 265 622</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur     |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------|
| Valeurs mobilières                            | £ 0                                                                                        | £ 240 014                                                  | £ 0                                                        | £ 240 014        |
| Fonds d'investissement                        | 0                                                                                          | 4 166                                                      | 0                                                          | 4 166            |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 201                                                                                        | (309)                                                      | 0                                                          | (108)            |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 44                                                         | 0                                                          | 44               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>£ 201</b>                                                                               | <b>£ 243 915</b>                                           | <b>£ 0</b>                                                 | <b>£ 244 116</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux<br>d'emprunt | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>emprunté | À payer<br>sur Contrats<br>de prise en<br>pension | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------|-------------------|----------------------|--------------------|---------------------|---------------------------------------------------|------------------------|
| BRC                                           | 3,000 %           | 01/06/2026           | TBD <sup>(1)</sup> | £ (393)             | £ (394)                                           | (0,18)                 |
|                                               | 3,250             | 27/03/2026           | TBD <sup>(1)</sup> | (413)               | (416)                                             | (0,18)                 |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                   |                      |                    |                     | <b>£ (810)</b>                                    | <b>(0,36)</b>          |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | £ 1                                                        | £ 0                     | £ 1                               | £ S/O                                                      | £ S/O                   | £ S/O                             |
| BOA          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | 37                                                         | 0                       | 37                                |
| BPS          | (105)                                                      | 0                       | (105)                             | 146                                                        | 0                       | 146                               |
| BRC          | 22                                                         | 0                       | 22                                | 22                                                         | 0                       | 22                                |
| CBK          | (16)                                                       | 0                       | (16)                              | 78                                                         | 0                       | 78                                |
| DUB          | 5                                                          | 0                       | 5                                 | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| GLM          | (46)                                                       | 0                       | (46)                              | (68)                                                       | 0                       | (68)                              |
| JPM          | (12)                                                       | 0                       | (12)                              | 24                                                         | 0                       | 24                                |
| MBC          | (47)                                                       | 0                       | (47)                              | (4)                                                        | 0                       | (4)                               |
| MYI          | 56                                                         | 0                       | 56                                | (12)                                                       | 0                       | (12)                              |
| NSL          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| RBC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (5)                                                        | 0                       | (5)                               |
| RYL          | (4)                                                        | 0                       | (4)                               | 11                                                         | 0                       | 11                                |
| SCX          | 12                                                         | 0                       | 12                                | (30)                                                       | 0                       | (30)                              |
| SOG          | 113                                                        | 0                       | 113                               | 149                                                        | 0                       | 149                               |
| SSB          | (15)                                                       | 0                       | (15)                              | (6)                                                        | 0                       | (6)                               |
| UAG          | (199)                                                      | 0                       | (199)                             | (17)                                                       | 0                       | (17)                              |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

#### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 58,02            | 66,67                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 18,21            | 16,20                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,50             | 0,46                 |
| Fonds d'investissement                                           | 1,24             | 1,45                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 0,71             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,26             | 0,09                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,42             | 0,16                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,12             | 0,22                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,02             | 0,02                 |
| Autres actifs                                                    | 20,50            | 14,73                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                        | 0,61             | 0,29                 |
| Autriche                                                         | 0,12             | S/O                  |
| Canada                                                           | 0,89             | 1,04                 |
| Îles Caïmans                                                     | 0,18             | 0,37                 |
| Colombie                                                         | 1,18             | 1,04                 |
| Danemark                                                         | 1,74             | 1,26                 |
| France                                                           | 8,27             | 4,31                 |
| Allemagne                                                        | 1,45             | 0,48                 |
| Irlande                                                          | 5,03             | 5,19                 |
| Italie                                                           | 2,10             | 1,62                 |
| Japon                                                            | 0,75             | S/O                  |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                     | 1,10             | 2,11                 |
| Lettonie                                                         | S/O              | 0,04                 |
| Luxembourg                                                       | 0,66             | 1,10                 |
| Mexique                                                          | 0,31             | 0,49                 |
| Pays-Bas                                                         | 4,01             | 4,87                 |
| Norvège                                                          | 0,22             | S/O                  |
| Pérou                                                            | 0,67             | 0,67                 |
| Qatar                                                            | 0,23             | S/O                  |
| Afrique du Sud                                                   | 0,57             | 0,83                 |
| Corée du Sud                                                     | S/O              | 0,22                 |
| Espagne                                                          | 2,87             | 2,66                 |
| Supranationales                                                  | S/O              | 0,20                 |
| Suède                                                            | S/O              | 0,27                 |
| Suisse                                                           | 0,62             | 0,77                 |
| Émirats arabes unis                                              | 0,50             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                      | 48,12            | 49,85                |
| États-Unis                                                       | 31,97            | 28,38                |
| Fonds d'investissement                                           | 1,84             | 1,88                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 1,06             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                    | 0,29             | 0,07                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection                                         | (0,02)           | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,14             | 0,02                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | (0,06)           | (0,29)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | S/O              | 0,00                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | S/O              | (0,03)               |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | S/O              | 0,08                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | (0,10)           | 0,10                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,02             | 0,02                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (17,34)          | (9,91)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |



| DESCRIPTION                                                                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |                                                                               |     |      |             |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-----|------|-------------|------------------------------------------------------|-----|------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-----|----|------|---|-----|-----|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                                   |                                     |                                  |                           | IRLANDE                             |                                     |                                  |                           | NORVÈGE                                                  |                                     |                                  |                           |                                                                               |     |      |             |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           |                                                                               |     |      |             |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Australie & New Zealand Banking Group Ltd.<br>5,145 % éch. 18/08/2036 (d)                            |                                     |                                  |                           | £                                   | 100                                 | 99                               | 0,40                      | PPI Public Property Invest AB<br>4,125 % éch. 21/04/2033 |                                     |                                  |                           | €                                                                             | 100 | 85   | 0,34        |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd.<br>6,250 % éch. 22/10/2031                                    |                                     |                                  |                           | \$                                  | 200                                 | 153                              | 0,62                      | SINGAPOUR                                                |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                 |     |      |             |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Total Australie                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                     |                                     | 252                              | 1,02                      | Foxconn Singapore Pte. Ltd.<br>3,125 % éch. 04/11/2031   |                                     |                                  |                           |                                                                               | 100 | 84   | 0,34        |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| AUTRICHE                                                                                             |                                     |                                  |                           | ITALIE                              |                                     |                                  |                           | SUÈDE                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                               |     |      |             |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           |                                                                               |     |      |             |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| ams-OSRAM AG<br>7,250 % éch. 31/05/2032                                                              |                                     |                                  |                           | €                                   | 100                                 | 89                               | 0,36                      | Lottomatica Group SpA<br>4,625 % éch. 30/04/2032         |                                     |                                  |                           |                                                                               | 100 | 86   | 0,35        |                                                      |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
|                                                                                                      |                                     |                                  |                           | Total Italie                        |                                     |                                  |                           |                                                          |                                     | 168                              | 0,68                      | Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB<br>2,375 % éch. 04/08/2026          |     |      |             |                                                      |     | 0,35 |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| BELGIQUE                                                                                             |                                     |                                  |                           | JAPON                               |                                     |                                  |                           | Verisure Holding AB<br>4,125 % éch. 02/01/2032 (a)       |                                     |                                  |                           | 100                                                                           | 87  | 0,35 | Total Suède |                                                      |     |      | 173  | 0,70                                                                                    |     |    |      |   |     |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           | Sony Group Corp.<br>5,089 % éch. 30/06/2036              |                                     |                                  |                           | \$                                                                            | 200 | 151  | 0,61        | TURQUIE                                              |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Sofina S.A.<br>3,707 % éch. 13/11/2033                                                               |                                     |                                  |                           |                                     | 100                                 | 85                               | 0,35                      | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement turc<br>40,760 % éch. 19/08/2026    |     |      |             | TRY                                                  | 300 | 5    | 0,02 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| ÎLES CAÏMANS                                                                                         |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           | Total Japon                                              |                                     |                                  |                           |                                                                               |     | 228  | 0,92        | ÉMIRATS ARABES UNIS                                  |     |      |      |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Gaci First Investment Co.<br>6,250 % éch. 14/05/2056                                                 |                                     |                                  |                           | \$                                  | 200                                 | 151                              | 0,61                      | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES                             |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                 |     |      |             | First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,697 % éch. 19/08/2031 |     |      |      | £                                                                                       | 100 | 98 | 0,40 |   |     |     |      |
| QNB Finance Ltd.<br>4,679 % éch. 27/04/2029                                                          |                                     |                                  |                           |                                     |                                     | 151                              | 0,61                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,375 % éch. 15/01/2036                       |     |      |             | \$                                                   | 200 | 150  | 0,61 | ROYAUME-UNI                                                                             |     |    |      |   |     |     |      |
| Total Îles Caïmans                                                                                   |                                     |                                  |                           |                                     |                                     | 302                              | 1,22                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                                            |     |      |             |                                                      |     | 948  | 3,83 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                           |     |    |      |   |     |     |      |
| COLOMBIE                                                                                             |                                     |                                  |                           | LUXEMBOURG                          |                                     |                                  |                           | LIBERIA                                                  |                                     |                                  |                           | Allwyn Entertainment Financing UK PLC<br>4,125 % éch. 15/02/2031              |     |      |             | €                                                    | 100 | 85   | 0,34 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES                                                                                |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Heathrow Funding Ltd.<br>2,750 % éch. 09/08/2051                              |     |      |             |                                                      | 500 | 284  | 1,15 | Anglian Water Osprey Financing PLC<br>2,000 % éch. 31/07/2028                           |     |    |      | £ | 200 | 185 | 0,75 |
| TES colombien<br>12,500 % éch. 27/02/2030                                                            |                                     |                                  |                           | COP                                 | 610 800                             | 134                              | 0,54                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Green Palm Bidco SARL<br>6,462 % éch. 30/06/2046                              |     |      |             | \$                                                   | 200 | 153  | 0,62 | Anglian Water Services Financing PLC<br>4,250 % éch. 23/06/2036                         |     |    |      | € | 200 | 172 | 0,70 |
| DANEMARK                                                                                             |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | ION Platform Finance SARL<br>6,500 % éch. 30/09/2030                          |     |      |             | €                                                    | 100 | 69   | 0,28 | Aviva PLC<br>6,875 % éch. 20/05/2058                                                    |     |    |      |   | 100 | 104 | 0,42 |
| Orsted A/S<br>5,125 % éch. 13/09/2034                                                                |                                     |                                  |                           | £                                   | 200                                 | 191                              | 0,77                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Total Luxembourg                                                              |     |      |             |                                                      |     | 306  | 1,24 | BCP Modular Services Finance PLC<br>6,500 % éch. 10/07/2031                             |     |    |      | € | 100 | 75  | 0,30 |
| FRANCE                                                                                               |                                     |                                  |                           | MEXIQUE                             |                                     |                                  |                           | LUXEMBOURG                                               |                                     |                                  |                           | Berkeley Group PLC<br>2,500 % éch. 11/08/2031                                 |     |      |             | £                                                    | 200 | 172  | 0,70 | Blend Funding PLC<br>3,459 % éch. 21/09/2049                                            |     |    |      |   | 800 | 542 | 2,19 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                        |                                     |                                  |                           | ÉMISSIONS SOUVERAINES               |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Cadent Finance PLC<br>2,625 % éch. 22/09/2038                                 |     |      |             |                                                      |     |      |      | 5,260 % éch. 11/06/2034                                                                 |     |    |      |   | 100 | 101 | 0,41 |
| BNP Paribas S.A.<br>2,000 % éch. 13/09/2036                                                          |                                     |                                  |                           |                                     | 200                                 | 145                              | 0,59                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | British Telecommunications Ltd.<br>5,750 % éch. 13/02/2041                              |     |    |      |   | 200 | 191 | 0,77 |
| Crédit Agricole Assurances S.A.<br>5,875 % éch. 17/06/2032 (c)(d)                                    |                                     |                                  |                           | €                                   | 100                                 | 88                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | Broadgate Financing PLC<br>4,999 % éch. 05/10/2033                                      |     |    |      |   | 456 | 452 | 1,83 |
| Électricité de France S.A.<br>5,125 % éch. 22/09/2050                                                |                                     |                                  |                           | £                                   | 400                                 | 323                              | 1,31                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | 5,098 % éch. 05/04/2035                                                                 |     |    |      |   | 84  | 82  | 0,33 |
| 5,500 % éch. 27/03/2037                                                                              |                                     |                                  |                           |                                     | 200                                 | 191                              | 0,77                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | Burberry Group PLC<br>5,750 % éch. 20/06/2030                                           |     |    |      |   | 200 | 202 | 0,82 |
| 5,625 % éch. 25/01/2053                                                                              |                                     |                                  |                           |                                     | 400                                 | 341                              | 1,38                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | Cadent Finance PLC<br>2,625 % éch. 22/09/2038                                           |     |    |      |   | 575 | 406 | 1,64 |
| Engie S.A.<br>4,000 % éch. 01/07/2038 (a)                                                            |                                     |                                  |                           | €                                   | 100                                 | 86                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | Chancellor Masters & Scholars of the University of Cambridge<br>2,350 % éch. 27/06/2078 |     |    |      |   | 200 | 90  | 0,36 |
| 6,125 % éch. 16/01/2032 (c)                                                                          |                                     |                                  |                           | £                                   | 100                                 | 101                              | 0,41                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | Clarion Funding PLC<br>1,875 % éch. 07/09/2051                                          |     |    |      |   | 400 | 179 | 0,72 |
| New Immo Holding S.A.<br>4,875 % éch. 08/12/2028                                                     |                                     |                                  |                           | €                                   | 100                                 | 87                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | 3,125 % éch. 19/04/2048                                                                 |     |    |      |   | 500 | 315 | 1,27 |
| Orange S.A.<br>5,375 % éch. 22/11/2050                                                               |                                     |                                  |                           | £                                   | 100                                 | 88                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | DWR Cymru Financing UK PLC<br>5,750 % éch. 10/09/2044                                   |     |    |      |   | 300 | 274 | 1,11 |
| Total France                                                                                         |                                     |                                  |                           |                                     |                                     | 1 450                            | 5,86                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | 6,250 % éch. 08/09/2037                                                                 |     |    |      |   | 100 | 100 | 0,40 |
| ALLEMAGNE                                                                                            |                                     |                                  |                           | PAYS-BAS                            |                                     |                                  |                           | LIBERIA                                                  |                                     |                                  |                           | Eastern Power Networks PLC<br>5,375 % éch. 26/02/2042                         |     |      |             |                                                      | 400 | 373  | 1,51 | GlaxoSmithKline Capital PLC<br>4,250 % éch. 18/12/2045                                  |     |    |      |   | 200 | 160 | 0,65 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                        |                                     |                                  |                           | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS       |                                     |                                  |                           | LIBERIA                                                  |                                     |                                  |                           | Greene King Finance PLC<br>5,106 % éch. 15/03/2034                            |     |      |             |                                                      | 358 | 353  | 1,43 | Haleon UK Capital PLC<br>3,375 % éch. 29/03/2038                                        |     |    |      |   | 320 | 257 | 1,04 |
| Amprion GmbH<br>4,750 % éch. 28/04/2056                                                              |                                     |                                  |                           | €                                   | 100                                 | 87                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 | HSBC Bank PLC<br>4,750 % éch. 24/03/2046                                                |     |    |      |   | 200 | 168 | 0,68 |
| Birkenstock Group BV & Co. KG<br>4,500 % éch. 15/06/2033                                             |                                     |                                  |                           |                                     | 100                                 | 87                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank,<br>Frankfort-sur-le-Main<br>3,706 % éch. 15/10/2035 |                                     |                                  |                           |                                     | 100                                 | 86                               | 0,35                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Vonovia SE<br>5,500 % éch. 18/01/2036                                                                |                                     |                                  |                           | £                                   | 100                                 | 97                               | 0,39                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Total Allemagne                                                                                      |                                     |                                  |                           |                                     |                                     | 357                              | 1,44                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| GRÈCE                                                                                                |                                     |                                  |                           | PAYS-BAS                            |                                     |                                  |                           | LIBERIA                                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                                        |                                     |                                  |                           | PAYS-BAS                            |                                     |                                  |                           | LIBERIA                                                  |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |
| Metlen Energy & Metals S.A.<br>4,000 % éch. 17/10/2029                                               |                                     |                                  |                           | €                                   | 100                                 | 83                               | 0,34                      | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                            |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,625 % éch. 19/03/2114 |     |      |             | £                                                    | 100 | 75   | 0,30 |                                                                                         |     |    |      |   |     |     |      |

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                                  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                                                | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)                                                       | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET                                                                                                                       |                       |                       |                       |      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|----------------|-------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------|
| Imperial Brands Finance PLC<br>3,875 % éch. 12/02/2034                                           | €                                   | 100                              | £ 85                      | 0,34        | SW Finance PLC<br>3,000 % éch. 28/05/2037<br>7,000 % éch. 16/04/2040 | £                                                                                               | 300<br>400                | £ 213<br>382   | 0,86<br>1,55                        | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                        | \$ 170                                                                                                                                          | £ 131                 | 0,53                  |                       |      |
| INEOS Finance PLC<br>7,875 % éch. 15/11/2031                                                     |                                     | 100                              |                           | 83          | 0,34                                                                 | Telereal Securitisation PLC<br>6,165 % éch. 10/12/2033                                          |                           | 64             | 65                                  | 0,26                                                                                   | Berkshire Hathaway Finance Corp.<br>2,625 % éch. 19/06/2059                                                                                     | £ 400                 | 208                   | 0,84                  |      |
| John Lewis PLC<br>4,250 % éch. 18/12/2034                                                        | £                                   | 222                              |                           | 188         | 0,76                                                                 | Tesco Property Finance PLC<br>5,411 % éch. 13/07/2044<br>5,661 % éch. 13/10/2041                |                           | 84<br>178      | 81<br>176                           | 0,33<br>0,71                                                                           | CoreWeave, Inc.<br>8,500 % éch. 15/07/2032                                                                                                      | € 100                 | 85                    | 0,34                  |      |
| Land Securities Capital Markets PLC<br>2,750 % éch. 22/09/2059                                   |                                     | 301                              |                           | 159         | 0,64                                                                 | Thames Water Super Senior Issuer PLC<br>9,750 % éch. 10/10/2027                                 |                           | 90             | 95                                  | 0,38                                                                                   | GA Global Funding Trust<br>5,414 % éch. 15/12/2032                                                                                              | £ 100                 | 98                    | 0,40                  |      |
| London & Quadrant Housing Trust<br>2,125 % éch. 31/03/2032                                       |                                     | 400                              |                           | 338         | 1,37                                                                 | United Utilities Water Finance PLC<br>5,125 % éch. 06/10/2038                                   |                           |                |                                     |                                                                                        | 6,454 % éch. 11/09/2040                                                                                                                         | 100                   | 102                   | 0,41                  |      |
| M&G PLC<br>5,560 % éch. 20/07/2055                                                               |                                     | 175                              |                           | 167         | 0,68                                                                 | University of Oxford<br>2,544 % éch. 08/12/2117                                                 |                           | 500            | 456                                 | 1,84                                                                                   | GLP Capital LP<br>5,250 % éch. 15/02/2033                                                                                                       | \$ 100                | 74                    | 0,30                  |      |
| Manchester Airport Group Funding PLC<br>2,875 % éch. 30/09/2044                                  |                                     | 350                              |                           | 223         | 0,90                                                                 | Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % éch. 15/04/2032                                             | € 200                     |                |                                     |                                                                                        | Goldman Sachs Group, Inc.<br>5,770 % éch. 22/09/2036                                                                                            | £ 100                 | 101                   | 0,41                  |      |
| Marks & Spencer PLC<br>5,125 % éch. 18/08/2032                                                   |                                     | 100                              |                           | 99          | 0,40                                                                 | Vodafone Group PLC<br>3,000 % éch. 12/08/2056<br>5,125 % éch. 02/12/2052                        | £ 200<br>200              |                | 108<br>165                          | 0,44<br>0,67                                                                           | HCA, Inc.<br>5,700 % éch. 15/11/2055                                                                                                            | \$ 250                | 180                   | 0,73                  |      |
| Meadowhall Finance PLC<br>4,988 % éch. 12/07/2037                                                |                                     | 55                               |                           | 52          | 0,21                                                                 | Weir Group PLC<br>6,875 % éch. 14/06/2028                                                       |                           | 100            | 103                                 | 0,42                                                                                   | LSF12 Pillar Investments US, Inc.<br>5,750 % éch. 15/05/2033                                                                                    | € 100                 | 86                    | 0,35                  |      |
| Miller Homes Group Finco PLC<br>7,000 % éch. 15/05/2029                                          |                                     | 100                              |                           | 100         | 0,40                                                                 | Wellcome Trust Ltd.<br>1,500 % éch. 14/07/2071                                                  |                           | 500            | 163                                 | 0,66                                                                                   | McDonald's Corp.<br>4,125 % éch. 11/06/2054                                                                                                     | £ 300                 | 214                   | 0,87                  |      |
| Mitchells & Butlers Finance PLC<br>5,741 % éch. 15/09/2034                                       |                                     | 293                              |                           | 268         | 1,08                                                                 | Wessex Water Services Finance PLC<br>6,500 % éch. 19/09/2040                                    |                           | 200            | 200                                 | 0,81                                                                                   | Morgan Stanley Finance LLC<br>6,550 % éch. 05/01/2029                                                                                           |                       | 200                   | 199                   | 0,80 |
| Morhomes PLC<br>3,400 % éch. 19/02/2040                                                          |                                     | 300                              |                           | 236         | 0,95                                                                 | Westfield Stratford City Finance PLC<br>5,124 % éch. 05/05/2036                                 |                           | 100            | 101                                 | 0,41                                                                                   | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                                                                                       | \$ 200                | 150                   | 0,61                  |      |
| Motability Operations Group PLC<br>4,875 % éch. 17/01/2043<br>5,625 % éch. 24/01/2054            |                                     | 500<br>200                       |                           | 426<br>177  | 1,72<br>0,72                                                         | WPP Finance<br>2,875 % éch. 14/09/2046                                                          |                           | 100            | 62                                  | 0,25                                                                                   | Realty Income Corp.<br>2,500 % éch. 14/01/2042                                                                                                  | £ 200                 | 128                   | 0,52                  |      |
| National Grid Electricity Transmission PLC<br>2,000 % éch. 16/09/2038<br>2,000 % éch. 17/04/2040 |                                     | 300<br>333                       |                           | 199<br>209  | 0,81<br>0,85                                                         | Yorkshire Water Finance PLC<br>2,750 % éch. 18/04/2041                                          |                           | 450            | 289                                 | 1,17                                                                                   | SBA Tower Trust<br>1,840 % éch. 15/04/2027                                                                                                      | \$ 200                | 147                   | 0,59                  |      |
| NIE Finance PLC<br>5,750 % éch. 07/12/2035                                                       |                                     | 100                              |                           | 101         | 0,41                                                                 |                                                                                                 |                           |                |                                     |                                                                                        | Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,000 % éch. 01/05/2036                                                                                    | 100                   | 76                    | 0,31                  |      |
| Northern Powergrid Northeast PLC<br>3,250 % éch. 01/04/2052                                      |                                     | 200                              |                           | 126         | 0,51                                                                 |                                                                                                 |                           |                |                                     |                                                                                        | Verizon Communications, Inc.<br>3,375 % éch. 27/10/2036                                                                                         | £ 150                 | 122                   | 0,49                  |      |
| Northumbrian Water Finance PLC<br>5,500 % éch. 02/10/2037                                        |                                     | 200                              |                           | 188         | 0,76                                                                 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX          |                           |                |                                     | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                                                                                                                                 |                       | 3 237                 | 13,09                 |      |
| Notting Hill Genesis<br>3,250 % éch. 12/10/2048                                                  |                                     | 241                              |                           | 152         | 0,62                                                                 | Mansard Mortgages PLC<br>4,516 % éch. 15/12/2049                                                | 40                        | 40             | 0,16                                |                                                                                        | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust<br>4,263 % éch. 25/04/2035                                                                        | \$ 92                 | 64                    | 0,26                  |      |
| Peabody Trust<br>3,125 % éch. 31/10/2047                                                         |                                     | 400                              |                           | 249         | 1,01                                                                 | Newgate Funding PLC<br>4,026 % éch. 01/12/2050                                                  | 27                        | 27             | 0,11                                |                                                                                        | Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust<br>4,180 % éch. 15/12/2030                                                         | 1                     | 1                     | 0,00                  |      |
| Platform HG Financing PLC<br>1,625 % éch. 10/08/2055                                             |                                     | 300                              |                           | 118         | 0,48                                                                 |                                                                                                 |                           |                |                                     |                                                                                        | Sequoia Mortgage Trust<br>2,999 % éch. 20/07/2037                                                                                               | 5                     | 3                     | 0,01                  |      |
| Sage Group PLC<br>5,625 % éch. 05/03/2037                                                        |                                     | 150                              |                           | 143         | 0,58                                                                 | ÉTATS-UNIS<br>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                     |                           |                |                                     |                                                                                        |                                                                                                                                                 |                       | 68                    | 0,27                  |      |
| Scottish Widows Ltd.<br>7,000 % éch. 16/06/2043                                                  |                                     | 100                              |                           | 103         | 0,42                                                                 | AES Corp.<br>6,950 % éch. 15/07/2055                                                            | \$ 100                    | 74             | 0,30                                | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                                                      |                                                                                                                                                 |                       |                       |                       |      |
| Severn Trent Utilities Finance PLC<br>4,875 % éch. 24/01/2042                                    |                                     | 200                              |                           | 171         | 0,69                                                                 | Alphabet, Inc.<br>4,000 % éch. 06/11/2044<br>5,500 % éch. 13/11/2041<br>5,875 % éch. 13/02/2058 | € 100<br>100<br>100       | 84<br>97<br>95 | 0,34<br>0,39<br>0,38                |                                                                                        | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA<br>4,000 % éch. 01/07/2056<br>6,000 % éch. 01/08/2056<br>6,500 % éch. 01/08/2056 | 300<br>1 800<br>8 900 | 211<br>1 382<br>6 929 | 0,86<br>5,59<br>28,01 |      |
| Society of Lloyd's<br>4,875 % éch. 07/02/2047                                                    |                                     | 200                              |                           | 200         | 0,81                                                                 | AT&T, Inc.<br>4,250 % éch. 01/06/2043                                                           |                           | 613            | 475                                 | 1,92                                                                                   |                                                                                                                                                 |                       | 8 522                 | 34,46                 |      |
| South West Water Finance PLC<br>5,250 % éch. 15/09/2031                                          |                                     | 100                              |                           | 99          | 0,40                                                                 | Athene Global Funding<br>5,858 % éch. 19/09/2035                                                |                           | 100            | 99                                  | 0,40                                                                                   | Total États-Unis                                                                                                                                |                       | 11 827                | 47,82                 |      |
| Southern Electric Power Distribution PLC<br>4,625 % éch. 20/02/2037                              |                                     | 150                              |                           | 137         | 0,55                                                                 |                                                                                                 |                           |                |                                     |                                                                                        | Total des Valeurs mobilières                                                                                                                    | £ 31 331              | 126,70                |                       |      |
| SSE PLC<br>4,750 % éch. 09/03/2034 (c)                                                           | €                                   | 100                              |                           | 87          | 0,35                                                                 |                                                                                                 |                           |                |                                     |                                                                                        |                                                                                                                                                 |                       |                       |                       |      |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin                                       | Long  | 09/2027              | 12                    | £ (1)                                   | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                     | Long  | 03/2028              | 2                     | 1                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 6                     | 5                                       | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                      | Long  | 09/2026              | 11                    | 4                                       | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre    | Long  | 09/2026              | 3                     | 2                                       | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                  | Court | 09/2026              | 4                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                  | Court | 09/2026              | 4                     | (9)                                     | (0,04)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                    | Court | 09/2026              | 9                     | (1)                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre             | Court | 09/2026              | 23                    | 4                                       | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre             | Court | 09/2026              | 66                    | (13)                                    | (0,05)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre            | Long  | 09/2026              | 42                    | 18                                      | 0,07                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre            | Court | 09/2026              | 7                     | (7)                                     | (0,03)                 |

| Description                                                                                   | Type | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|------|-------------------|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Long | 09/2026           | 2                  | £ 0                                     | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long | 09/2026           | 9                  | 23                                      | 0,09                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long | 09/2026           | 78                 | 126                                     | 0,51                   |
|                                                                                               |      |                   |                    | £ 152                                   | 0,61                   |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |      |                   |                    | £ 152                                   | 0,61                   |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                              | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Indice iTraxx Europe Main 45 Index à 5 ans   | 1,000 %                 | 20/06/2031         | € 550                               | £ 3                                     | 0,01                   |
| Indice iTraxx Europe Senior 44 Index à 5 ans | 1,000                   | 20/12/2030         | 1 200                               | 2                                       | 0,01                   |
|                                              |                         |                    |                                     | £ 5                                     | 0,02                   |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable<br>à payer/<br>à recevoir            | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2028         | £ 210                | £ (2)                                   | (0,01)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2028         | 1 100                | 4                                       | 0,02                   |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 18/03/2031         | 100                  | 0                                       | 0,00                   |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500     | 16/09/2031         | 790                  | 2                                       | 0,01                   |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,750     | 17/09/2030         | 500                  | (2)                                     | (0,01)                 |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 18/03/2036         | 660                  | 13                                      | 0,05                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,000     | 16/09/2036         | 950                  | 1                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 17/09/2055         | 200                  | 1                                       | 0,00                   |
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 18/03/2056         | 900                  | (46)                                    | (0,18)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 4,500     | 16/09/2056         | 610                  | 7                                       | 0,03                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2027         | \$ 3 900             | (24)                                    | (0,10)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,000     | 19/03/2030         | 5 460                | (68)                                    | (0,28)                 |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 17/06/2031         | 1 150                | 0                                       | 0,00                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,250     | 18/06/2035         | 6 100                | 46                                      | 0,19                   |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,500     | 17/09/2055         | 1 500                | 30                                      | 0,12                   |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2027         | 5 500                | (29)                                    | (0,12)                 |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2030         | 4 200                | (47)                                    | (0,19)                 |
| À payer                                            | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/12/2030         | 800                  | (17)                                    | (0,07)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035         | 6 100                | (49)                                    | (0,19)                 |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,750     | 17/09/2035         | 3 300                | 37                                      | 0,15                   |
| À payer                                            | CDI BRL à un an                   | 13,180    | 02/01/2031         | BRL 3 300            | (10)                                    | (0,04)                 |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/09/2027         | CAD 700              | (1)                                     | 0,00                   |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,500     | 16/09/2031         | € 1 750              | (3)                                     | (0,01)                 |
| À payer <sup>(3)</sup>                             | EURIBOR EUR à 6 mois              | 2,750     | 16/09/2036         | 50                   | 0                                       | 0,00                   |
|                                                    |                                   |           |                    |                      | £ (157)                                 | (0,63)                 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                    |                      | £ (152)                                 | (0,61)                 |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe<br>à recevoir | Date<br>d'échéance | Montant<br>notionnel <sup>(2)</sup> | Primes<br>payées/(reçues) | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-----------------|------------------------|
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %                 | 20/12/2030         | € 70                                | £ 12                      | £ (1)                                   | £ 11            | 0,04                   |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                   | 20/12/2030         | 140                                 | 24                        | (1)                                     | 23              | 0,10                   |
|              |                                                   |                         |                    |                                     | £ 36                      | £ (2)                                   | £ 34            | 0,14                   |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

## Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | CNH             | 68                | \$ 10              | £ 0                   | £ 0                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 17                | \$ 10              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 20                | \$ 15              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 8                 | NZD 15             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BOA          | 08/2026           | NZD             | 15                | \$ 8               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 14                | NOK 175            | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 90                | \$ 120             | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 17 617            | 12                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | SGD             | 206               | 161                | 2                     | 2                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$              | 11                | ILS 33             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 100               | INR 9 463          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 15                | \$ 5               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | BRL             | 21                | \$ 4               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | CNH             | 575               | 85                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | £               | 45                | 60                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 1 650 138         | 92                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | ILS             | 14                | 5                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 921             | 20                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 259               | 200                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 594               | 18                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | \$              | 190               | BRL 979            | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 66                | CNY 448            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 3 486             | £ 2 604            | 0                     | (24)                                   | (0,09)              |
|              | 07/2026           |                 | 99                | INR 9 374          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           |                 | 23                | KRW 35 885         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 1                 | PLN 5              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 130               | £ 69               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 12                | \$ 4               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 08/2026           | INR             | 9 473             | 100                | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$              | 10                | BRL 49             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 92 606            | \$ 5               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 448               | 14                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 09/2026           | \$              | 46                | IDR 815 644        | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 5                 | INR 469            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 10                | THB 325            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 5                 | IDR 93 235         | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | €               | 93                | £ 81               | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 23                | \$ 8               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 24                | 14                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 160               | TRY 7 682          | 2                     | 2                                      | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 95                | £ 51               | 1                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 16                | \$ 6               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 1 133             | 12                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 20                | HUF 6 086          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| DUB          | 07/2026           |                 | 10                | IDR 181 685        | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 12                | INR 1 133          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 44                | PLN 164            | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 80                | \$ 28              | 1                     | 1                                      | 0,00                |
| DUB          | 08/2026           | \$              | 100               | INR 9 357          | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 492 747           | \$ 27              | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 395               | 12                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 169               | COP 617 842        | 6                     | 6                                      | 0,02                |
| DUB          | 09/2026           |                 | 9                 | IDR 151 803        | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 14                | MXN 248            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 10/2026           |                 | 96                | PEN 332            | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 11/2026           | PEN             | 394               | \$ 115             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| DUB          | 12/2026           | \$              | 17                | IDR 312 096        | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 1 206             | \$ 235             | 2                     | 2                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | INR             | 565               | 6                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | SGD             | 24                | 19                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | \$              | 256               | CNH 1 741          | 1                     | 1                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 4                 | INR 385            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 20                | PLN 75             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | CNH             | 1 737             | \$ 256             | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| GLM          | 09/2026           | IDR             | 374 246           | 21                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 7                 | IDR 120 413        | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 6                 | INR 568            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 5                 | \$ 1               | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| GLM          | 07/2026           | KRW             | 9 265             | 6                  | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 12                | IDR 222 870        | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 6                 | KRW 9 263          | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 90                | PLN 336            | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
| GLM          | 08/2026           |                 | 176               | BRL 896            | 0                     | (3)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           |                 | 4                 | INR 376            | 0                     | 0                                      | 0,00                |
|              | 09/2026           | COP             | 73 509            | \$ 20              | 0                     | (1)                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 224 175           | 12                 | 0                     | 0                                      | 0,00                |
| GLM          | 09/2026           | THB             | 919               | 28                 | 1                     | 1                                      | 0,00                |

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| JPM                                                | 09/2026           | \$              | 21                | BRL 106            | £ 0                   | £ 0                                     | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           |                 | 28                | IDR 505 266        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           |                 | 28                | INR 2 674          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | BRL             | 1 133             | \$ 220             | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CNH             | 150               | 22                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 88                | £ 76               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | ILS             | 54                | \$ 18              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | INR             | 788               | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | MXN             | 228               | 13                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 64                | £ 48               | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 60                | HUF 18 373         | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 8                 | INR 788            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 8                 | THB 261            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | ILS             | 591               | \$ 201             | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|                                                    | 09/2026           | INR             | 794               | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| MBC                                                | 09/2026           | MXN             | 70                | 4                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 732               | 22                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 13                | INR 1 277          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           |                 | 369               | MXN 6 423          | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|                                                    | 10/2026           |                 | 220               | BRL 1 158          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CHF             | 92                | £ 87               | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 105               | 90                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | £               | 207               | ¥ 44 200           | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           |                 | 145               | \$ 191             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | IDR             | 2 970             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | INR             | 567               | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | KRW             | 15 066            | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | NZD             | 205               | £ 89               | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 10                | BRL 52             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | MYI               | 07/2026         |                   | 49                 | £ 36                  | 0                                       | (1)                 |
| 07/2026                                            |                   |                 | 2                 | IDR 31 407         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   |                 | 7                 | INR 710            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 08/2026                                            |                   | IDR             | 31 407            | \$ 2               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 09/2026                                            |                   | THB             | 470               | 14                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 09/2026                                            |                   | \$              | 25                | INR 2 400          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | CAD             | 83                | £ 45               | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | CHF             | 6                 | 6                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | €               | 100               | 87                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | £               | 1 302             | € 1 509            | 0                     | (3)                                     | (0,01)              |
| 07/2026                                            |                   |                 | 208               | \$ 276             | 1                     | (1)                                     | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | KRW             | 15 301            | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | NOK             | 75                | £ 6                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   | NZD             | 95                | 42                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| NSL                                                |                   | 07/2026         | \$                | 253                | BRL 1 310             | 0                                       | 0                   |
|                                                    | 08/2026           | €               | 1 429             | £ 1 235            | 3                     | 0                                       | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 12                | IDR 206 305        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 9                 | INR 900            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | IDR             | 207 462           | \$ 12              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| RYL                                                | 09/2026           | \$              | 5                 | IDR 92 692         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 180               | £ 135              | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 209               | 181                | 1                     | 0                                       | 0,01                |
| SCX                                                | 07/2026           | £               | 2 347             | \$ 3 106           | 0                     | (6)                                     | (0,03)              |
|                                                    | 07/2026           | NZD             | 41                | £ 18               | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 154               | CNY 1 049          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           |                 | 4                 | IDR 73 000         | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 12                | INR 1 181          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           |                 | 3 106             | £ 2 347            | 8                     | 0                                       | 0,03                |
|                                                    | 08/2026           |                 | 10                | INR 933            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | IDR             | 268 534           | \$ 15              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 324               | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | \$              | 15                | IDR 270 876        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 145               | £ 78               | 1                     | 0                                       | 0,01                |
|                                                    | 07/2026           | CHF             | 89                | 84                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CNH             | 949               | \$ 140             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | €               | 3 010             | £ 2 611            | 19                    | 0                                       | 0,07                |
|                                                    | 07/2026           | £               | 1 492             | € 1 730            | 0                     | (2)                                     | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 393               | SGD 509            | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | €               | 1 730             | £ 1 494            | 2                     | 0                                       | 0,01                |
|                                                    | SSB               | 08/2026         | SGD               | 507                | \$ 393                | 0                                       | 0                   |
| 07/2026                                            |                   | \$              | 233               | £ 176              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
| 07/2026                                            |                   |                 | 30                | IDR 534 788        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG                                                | 08/2026           | £               | 176               | \$ 233             | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CAD             | 142               | £ 76               | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | CHF             | 21                | 20                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | £               | 72                | CAD 135            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           |                 | 85                | € 99               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | THB             | 2 303             | \$ 70              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 21                | PLN 75             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | CAD             | 135               | £ 72               | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 09/2026           | COP             | 1 213 738         | \$ 315             | 0                     | (25)                                    | (0,10)              |
|                                                    | 09/2026           | THB             | 63                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | £ 67               | £ (82)                | £ (15)                                  | (0,06)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | £ 19                                    | 0,08                |

## Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>AUTRES ACTIFS FINANCIERS</b>               |                                     |                                  |                           |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                    | £ 1 600                             | £ 425                            | 1,72                      |
| <b>Total des Autres actifs financiers</b>     |                                     | £ 425                            | 1,72                      |
| <b>Total des Investissements</b>              |                                     | £ 31 775                         | 128,50                    |
| <b>Autres actifs et passifs à court terme</b> |                                     | £ (7 048)                        | (28,50)                   |
| <b>Actif net</b>                              |                                     | £ 24 727                         | 100,00                    |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre vendu avant l'émission.  
 (b) Titre à coupon zéro.  
 (c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.  
 (d) Titre convertible conditionnel.  
 (e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût  | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------|---------|--------------------|-----------------|-------|-----------------|------------------------|
| Flora Food Management BV  | 7,500 % | 31/10/2030         | 20/01/2026      | £ 174 | £ 172           | 0,70                   |

Un montant en numéraire de 867 £ (31 décembre 2025 : 898 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables (Niveau 3) | Juste valeur    |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|-----------------|
| Valeurs mobilières                            | £ 0                                                                                        | £ 31 313                                                   | £ 18                                                    | £ 31 331        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 128                                                                                        | (109)                                                      | 0                                                       | 19              |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 425                                                        | 0                                                       | 425             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>£ 128</b>                                                                               | <b>£ 31 629</b>                                            | <b>£ 18</b>                                             | <b>£ 31 775</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables (Niveau 3) | Juste valeur    |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|-----------------|
| Valeurs mobilières                            | £ 0                                                                                        | £ 32 040                                                   | £ 0                                                     | £ 32 040        |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 36                                                                                         | 79                                                         | 0                                                       | 115             |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 351                                                        | 0                                                       | 351             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>£ 36</b>                                                                                | <b>£ 32 470</b>                                            | <b>£ 0</b>                                              | <b>£ 32 506</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                               |                            |                                      | Au 31 décembre 2025                                           |                            |                                      |
|--------------|---------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des<br>instruments dérivés hors cote | Garantie<br>(reçue)/nantie | Expositions<br>nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des<br>instruments dérivés hors cote | Garantie<br>(reçue)/nantie | Expositions<br>nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | £ S/O                                                         | £ S/O                      | £ S/O                                | £ 1                                                           | £ 0                        | £ 1                                  |
| BOA          | 2                                                             | 0                          | 2                                    | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |
| BPS          | (15)                                                          | 0                          | (15)                                 | 28                                                            | 0                          | 28                                   |
| BRC          | 3                                                             | 0                          | 3                                    | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |
| CBK          | 7                                                             | 0                          | 7                                    | 8                                                             | 0                          | 8                                    |
| DUB          | 3                                                             | 0                          | 3                                    | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |
| GLM          | (4)                                                           | 0                          | (4)                                  | (1)                                                           | 0                          | (1)                                  |
| JPM          | 21                                                            | 0                          | 21                                   | 25                                                            | 0                          | 25                                   |
| MBC          | (1)                                                           | 0                          | (1)                                  | 3                                                             | 0                          | 3                                    |
| MYI          | 2                                                             | 0                          | 2                                    | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |
| RYL          | (1)                                                           | 0                          | (1)                                  | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |
| SCX          | 4                                                             | 0                          | 4                                    | (7)                                                           | 0                          | (7)                                  |
| SOG          | 21                                                            | 0                          | 21                                   | 44                                                            | 0                          | 44                                   |
| SSB          | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  | (4)                                                           | 0                          | (4)                                  |
| UAG          | (23)                                                          | 0                          | (23)                                 | S/O                                                           | S/O                        | S/O                                  |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.



## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 50,99            | 45,79                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 21,87            | 18,18                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,04             | S/O                  |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,43             | 0,16                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,34             | 0,25                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,23             | 0,22                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,99             | 0,70                 |
| Autres actifs                                                    | 25,11            | 34,70                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                                                                                             | 1,02             | 0,39                 |
| Autriche                                                                                              | 0,36             | S/O                  |
| Belgique                                                                                              | 0,35             | 0,33                 |
| Îles Caïmans                                                                                          | 1,22             | 0,96                 |
| Colombie                                                                                              | 0,54             | S/O                  |
| Danemark                                                                                              | 0,77             | 0,74                 |
| France                                                                                                | 5,86             | 5,99                 |
| Allemagne                                                                                             | 1,44             | 0,34                 |
| Grèce                                                                                                 | 0,34             | S/O                  |
| Irlande                                                                                               | 0,81             | 0,78                 |
| Italie                                                                                                | 0,68             | 0,65                 |
| Japon                                                                                                 | 0,92             | S/O                  |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes                                                                          | 3,83             | 4,12                 |
| Liberia                                                                                               | 0,61             | 0,58                 |
| Luxembourg                                                                                            | 1,24             | S/O                  |
| Mexique                                                                                               | 0,30             | 0,60                 |
| Pays-Bas                                                                                              | 3,51             | 2,56                 |
| Norvège                                                                                               | 0,34             | S/O                  |
| Singapour                                                                                             | 0,34             | 0,33                 |
| Suède                                                                                                 | 0,70             | 0,72                 |
| Turquie                                                                                               | 0,02             | 0,02                 |
| Émirats arabes unis                                                                                   | 0,40             | S/O                  |
| Royaume-Uni                                                                                           | 53,28            | 59,38                |
| États-Unis                                                                                            | 47,82            | 45,48                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | 0,61             | 0,16                 |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O              | 0,00                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                              |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                      | 0,02             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                               | (0,63)           | (0,10)               |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                              |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                      | 0,14             | 0,14                 |
| Contrats de change à terme                                                                            | (0,06)           | 0,24                 |
| Autres actifs financiers                                                                              | 1,72             | 1,36                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                | (28,50)          | (25,78)              |
| Actif net                                                                                             | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>              |                                     |                                  |                           | <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                           |                                     |                                  |                           | <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>                      |                                     |                                  |                           |
| <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>              |                                     |                                  |                           | <b>CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b>         |                                     |                                  |                           |
| Altice France S.A.                     | \$ 399                              | \$ 408                           | 0,03                      | Diversified Healthcare Trust                        | \$ 3 025                            | \$ 2 771                         | 0,18                      | Newmark Group, Inc.                            | \$ 5 825                            | \$ 6 106                         | 0,40                      |
| 10,548 % éch. 31/05/2031               |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 01/03/2031                             | 25                                  | 25                               | 0,00                      | 7,500 % éch. 12/01/2029                        |                                     |                                  |                           |
| B&G Foods, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/02/2028                             |                                     |                                  |                           | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                |                                     |                                  |                           |
| 7,144 % éch. 10/10/2029                | 4 599                               | 4 540                            | 0,30                      | 7,250 % éch. 15/10/2030                             | 3 975                               | 4 096                            | 0,27                      | 5,300 % éch. 13/09/2027                        | 200                                 | 199                              | 0,01                      |
| Bausch Health Cos., Inc.               |                                     |                                  |                           | EF Holdco                                           |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 29/09/2028                        | 2 091                               | 2 088                            | 0,14                      |
| 9,894 % éch. 08/10/2030                | 3 134                               | 3 046                            | 0,20                      | 7,375 % éch. 30/09/2030                             | 1 450                               | 1 445                            | 0,09                      | 6,125 % éch. 30/09/2030                        | 5 150                               | 5 067                            | 0,33                      |
| Coreweave Financing DDTL LLC           |                                     |                                  |                           | Encore Capital Group, Inc.                          |                                     |                                  |                           | OneMain Finance Corp.                          |                                     |                                  |                           |
| 0,500 % - 8,113 % éch.                 |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/04/2031                             | 300                                 | 304                              | 0,02                      | 3,500 % éch. 15/01/2027                        | 6 025                               | 5 977                            | 0,39                      |
| 17/11/2031 µ                           | 1 000                               | 1 021                            | 0,07                      | 6,625 % éch. 01/06/2032                             | 600                                 | 601                              | 0,04                      | 6,625 % éch. 15/05/2029                        | 2 450                               | 2 501                            | 0,16                      |
| Finastra USA, Inc.                     |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/05/2030                             | 4 125                               | 4 384                            | 0,29                      | 6,750 % éch. 15/09/2033                        | 1 650                               | 1 635                            | 0,11                      |
| 7,746 % éch. 15/09/2032                | 1 721                               | 1 591                            | 0,10                      | Everglades Re Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/05/2031                        | 2 100                               | 2 171                            | 0,14                      |
| INEOS U.S. Finance LLC                 |                                     |                                  |                           | 10,289 % éch. 22/05/2033                            | 250                                 | 250                              | 0,02                      | Orange Capital RE DAC                          |                                     |                                  |                           |
| 6,644 % éch. 07/02/2031                | 320                                 | 285                              | 0,02                      | 12,039 % éch. 22/05/2033                            | 250                                 | 250                              | 0,02                      | 8,103 % éch. 17/01/2029                        | € 250                               | 297                              | 0,02                      |
| 6,894 % éch. 18/02/2030                | 0                                   | 0                                | 0,00                      | First Eagle Holdings, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                                     |                                  |                           |
| Renaissance Holding Corp.              |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 15/08/2032                             | 650                                 | 655                              | 0,04                      | 0,000 % éch. 05/04/2032 (d)                    | \$ 1 650                            | 1 344                            | 0,09                      |
| 7,663 % éch. 05/04/2030                | 2 706                               | 2 158                            | 0,14                      | Freedom Mortgage Holdings LLC                       |                                     |                                  |                           | Park Intermediate Holdings LLC                 |                                     |                                  |                           |
| Spirit Airlines, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/05/2031                             | 1 325                               | 1 287                            | 0,08                      | 5,875 % éch. 01/10/2028                        | 400                                 | 400                              | 0,03                      |
| 0,000 % éch. 14/07/2026                | 1 405                               | 827                              | 0,05                      | 9,125 % éch. 15/05/2031                             | 3 200                               | 3 312                            | 0,22                      | Pebblebrook Hotel LP                           |                                     |                                  |                           |
| Stepstone Group Midco GmbH             |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 01/02/2029                             | 1 425                               | 1 478                            | 0,10                      | 6,375 % éch. 15/10/2029                        | 2 900                               | 2 951                            | 0,19                      |
| 8,176 % éch. 19/08/2032                |                                     |                                  |                           | FS KKR Capital Corp.                                |                                     |                                  |                           | PennyMac Financial Services, Inc.              |                                     |                                  |                           |
| 19/12/2031                             | 5 996                               | 4 861                            | 0,32                      | 6,125 % éch. 15/01/2031                             | 1 000                               | 962                              | 0,06                      | 5,750 % éch. 15/09/2031                        | 700                                 | 664                              | 0,04                      |
| TransDigm, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/08/2031                             | 2 700                               | 2 690                            | 0,18                      | 6,875 % éch. 15/02/2033                        | 1 025                               | 1 000                            | 0,06                      |
| 5,894 % éch. 22/03/2030                | 574                                 | 574                              | 0,04                      | FTAI Aviation Investors LLC                         |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 15/11/2030                        | 3 025                               | 3 068                            | 0,20                      |
| 6,144 % éch. 28/02/2031                | 12 710                              | 12 726                           | 0,83                      | 7,000 % éch. 01/05/2031                             | 5 725                               | 5 934                            | 0,39                      | PRA Group, Inc.                                |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 19/01/2032                | 2 119                               | 2 122                            | 0,14                      | Golden Bear Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 31/01/2030                        | 625                                 | 645                              | 0,04                      |
| 6,144 % éch. 19/08/2032                | 973                                 | 974                              | 0,06                      | 13,300 % éch. 08/01/2029                            | 250                                 | 257                              | 0,02                      | Purple Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,144 % éch. 13/02/2033                | 300                                 | 300                              | 0,02                      | Greystar Real Estate Partners LLC                   |                                     |                                  |                           | 12,676 % éch. 06/06/2031                       | 300                                 | 308                              | 0,02                      |
| U.S. Renal Care, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 01/09/2030                             | 1 100                               | 1 148                            | 0,07                      | Quercus RE DAC                                 |                                     |                                  |                           |
| 8,758 % éch. 28/06/2028                | 2 907                               | 2 866                            | 0,19                      | GSG Bidco Ltd.                                      |                                     |                                  |                           | 10,149 % éch. 06/01/2031                       | € 250                               | 290                              | 0,02                      |
| Virgin Media Bristol LLC               |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/06/2031                             | € 950                               | 1 090                            | 0,07                      | 13,324 % éch. 07/01/2031                       | 300                                 | 348                              | 0,02                      |
| 6,967 % éch. 31/03/2031                | 2 585                               | 2 301                            | 0,15                      | Herbie Re Ltd.                                      | \$ 250                              | 250                              | 0,02                      | Recoletos RE DAC                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     | 40 600                           | 2,66                      | 7,760 % éch. 07/01/2030                             |                                     |                                  |                           | 5,289 % éch. 06/07/2032                        | \$ 250                              | 250                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Howard Hughes Corp.                                 |                                     |                                  |                           | RFNA LP                                        |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 01/03/2032                             | 225                                 | 223                              | 0,01                      | 7,875 % éch. 15/02/2030                        | 675                                 | 681                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | HUB International Ltd.                              |                                     |                                  |                           | RHP Hotel Properties LP                        |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 15/06/2030                             | 5 700                               | 5 853                            | 0,38                      | 6,500 % éch. 01/04/2032                        | 1 025                               | 1 049                            | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Hudson Pacific Properties LP                        |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 15/07/2028                        | 175                                 | 179                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,950 % éch. 15/02/2028                             | 1 275                               | 1 264                            | 0,08                      | RLJ Lodging Trust LP                           |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Icahn Enterprises LP                                |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/07/2026                        | 325                                 | 325                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/05/2027                             | 1 600                               | 1 582                            | 0,10                      | 4,000 % éch. 15/09/2029                        | 1 025                               | 977                              | 0,06                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 15/06/2030                             | 800                                 | 747                              | 0,05                      | Rocket Cos., Inc.                              |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 15/01/2029                             | 775                                 | 761                              | 0,05                      | 6,125 % éch. 01/08/2030                        | 4 125                               | 4 198                            | 0,27                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 15/11/2029                            | 2 125                               | 2 098                            | 0,14                      | 6,125 % éch. 01/08/2031                        | 2 350                               | 2 402                            | 0,16                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | ION Platform Finance U.S., Inc.                     |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/08/2029                        | 3 400                               | 3 475                            | 0,23                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 30/09/2032                             | 4 125                               | 2 994                            | 0,20                      | 7,125 % éch. 01/02/2032                        | 1 075                               | 1 116                            | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Iron Mountain Information Management Services, Inc. |                                     |                                  |                           | Service Properties Trust                       |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/07/2032                             | 1 450                               | 1 394                            | 0,09                      | 0,000 % éch. 30/09/2028 (d)                    | 2 400                               | 2 228                            | 0,15                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Iron Mountain, Inc.                                 |                                     |                                  |                           | SLM Corp.                                      |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/09/2027                             | 6 176                               | 6 168                            | 0,40                      | 6,500 % éch. 31/01/2030                        | 2 350                               | 2 384                            | 0,16                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/03/2028                             | 475                                 | 475                              | 0,03                      | Starwood Property Trust, Inc.                  |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 15/07/2030                             | 300                                 | 296                              | 0,02                      | 4,375 % éch. 15/01/2027                        | 200                                 | 200                              | 0,01                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/02/2029                             | 1 175                               | 1 198                            | 0,08                      | 5,250 % éch. 15/10/2028                        | 975                                 | 971                              | 0,06                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Jane Street Group                                   |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/01/2031                        | 4 000                               | 3 980                            | 0,26                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/05/2033                             | 4 450                               | 4 579                            | 0,30                      | 6,000 % éch. 15/04/2030                        | 575                                 | 577                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 30/04/2031                             | 8 100                               | 8 379                            | 0,55                      | 6,125 % éch. 01/06/2031                        | 1 000                               | 1 006                            | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Jefferies Finance LLC                               |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/07/2030                        | 1 350                               | 1 381                            | 0,09                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/08/2028                             | 1 075                               | 1 039                            | 0,07                      | 6,500 % éch. 15/10/2030                        | 950                                 | 973                              | 0,06                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Jefferson Capital Holdings LLC                      |                                     |                                  |                           | Stingray Compute LLC                           |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 15/02/2029                             | 1 400                               | 1 468                            | 0,10                      | 6,000 % éch. 15/06/2031                        | 975                                 | 978                              | 0,06                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Locke Tavern Re Ltd.                                |                                     |                                  |                           | Stonepeak Motion Holdco Ltd.                   |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 7,800 % éch. 11/04/2033                             | 250                                 | 251                              | 0,02                      | 6,125 % éch. 15/07/2033 (a)                    | 1 000                               | 1 002                            | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Longleaf Pine Re Ltd.                               |                                     |                                  |                           | Torrey Pines Re Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 21,453 % éch. 27/05/2031                            | 250                                 | 255                              | 0,02                      | 9,586 % éch. 07/06/2032                        | 250                                 | 257                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Lower Ferry Re Ltd.                                 |                                     |                                  |                           | 9,810 % éch. 07/06/2034                        | 250                                 | 256                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,260 % éch. 08/07/2033                             | 500                                 | 500                              | 0,03                      | 10,656 % éch. 07/06/2032                       | 250                                 | 258                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Luca RE Ltd.                                        |                                     |                                  |                           | United Wholesale Mortgage LLC                  |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 10,800 % éch. 22/07/2031                            | 250                                 | 260                              | 0,02                      | 5,750 % éch. 15/06/2027                        | 250                                 | 248                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | Millrose Properties, Inc.                           |                                     |                                  |                           | Uniti Group LP                                 |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/09/2032                             | 350                                 | 353                              | 0,02                      | 6,000 % éch. 15/01/2030                        | 1 075                               | 1 051                            | 0,07                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 01/08/2030                             | 1 700                               | 1 724                            | 0,11                      | Ursa Re Ltd.                                   |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | MPT Operating Partnership LP                        |                                     |                                  |                           | 11,021 % éch. 22/02/2028                       | 250                                 | 258                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/10/2027                             | 1 500                               | 1 456                            | 0,09                      | 11,260 % éch. 07/06/2028                       | 350                                 | 360                              | 0,02                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/02/2032                             | 2 350                               | 2 408                            | 0,16                      | USI, Inc.                                      |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | Navient Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/01/2032                        | 600                                 | 606                              | 0,04                      |
|                                        |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/03/2027                             | 625                                 | 620                              | 0,04                      | UWM Holdings LLC                               |                                     |                                  |                           |
|                                        |                                     |                                  |                           | 9,375 % éch. 15/10/2031                             | 225                                 | 224                              | 0,01                      | 6,250 % éch. 15/03/2031                        | 2 700                               | 2 408                            | 0,16                      |

| DESCRIPTION                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Veraison Re Ltd.<br>6,421 % éch. 08/03/2034                | \$ 300                              | \$ 304                           | 0,02                      | ATS Corp.<br>4,125 % éch. 15/12/2028                                                         | \$ 1 290                            | \$ 1 259                         | 0,08                      | Carvana Co.<br>9,000 % éch. 01/06/2030                           | \$ 4 228                            | \$ 4 374                         | 0,29                      |
| VFH Parent LLC<br>7,500 % éch. 15/06/2031                  | 1 500                               | 1 570                            | 0,10                      | Avianca Midco PLC<br>10,250 % éch. 07/01/2032 (a)                                            | 775                                 | 775                              | 0,05                      | Caturus Energy LLC<br>7,125 % éch. 15/05/2031                    | 350                                 | 347                              | 0,02                      |
| Vornado Realty LP<br>5,750 % éch. 01/02/2033               | 1 925                               | 1 933                            | 0,13                      | Avis Budget Car Rental LLC<br>4,750 % éch. 01/04/2028                                        | 3 775                               | 3 715                            | 0,24                      | CBS Corp.<br>4,850 % éch. 01/07/2042                             | 475                                 | 321                              | 0,02                      |
| Voyager Aviation Holdings LLC<br>8,500 % éch. 09/05/2026 ^ | 802                                 | 0                                | 0,00                      | 5,750 % éch. 15/07/2027                                                                      | 333                                 | 335                              | 0,02                      | CCO Holdings LLC<br>4,500 % éch. 15/08/2030                      | 1 625                               | 1 512                            | 0,10                      |
| Windrose Re Ltd.<br>8,782 % éch. 11/02/2033                | 250                                 | 250                              | 0,02                      | 8,375 % éch. 15/06/2032                                                                      | 175                                 | 176                              | 0,01                      | 4,500 % éch. 01/05/2032                                          | 3 800                               | 3 357                            | 0,22                      |
| WS Escrow LLC<br>7,750 % éch. 01/06/2033                   | 1 225                               | 1 259                            | 0,08                      | Axalta Coating Systems LLC<br>3,375 % éch. 15/02/2029                                        | 2 025                               | 1 939                            | 0,13                      | 4,750 % éch. 01/03/2030                                          | 1 275                               | 1 210                            | 0,08                      |
| WULF Compute LLC<br>7,750 % éch. 15/10/2030                | 2 700                               | 2 838                            | 0,19                      | 4,750 % éch. 15/06/2027                                                                      | 600                                 | 599                              | 0,04                      | 4,750 % éch. 01/02/2032                                          | 3 350                               | 2 990                            | 0,20                      |
|                                                            |                                     | 202 159                          | 13,27                     | Axon Enterprise, Inc.<br>6,125 % éch. 15/03/2030                                             | 2 755                               | 2 817                            | 0,19                      | 5,000 % éch. 01/02/2028                                          | 2 900                               | 2 865                            | 0,19                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/03/2033                                                                      | 1 000                               | 1 026                            | 0,07                      | 5,125 % éch. 01/05/2027                                          | 377                                 | 376                              | 0,02                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | B&G Foods, Inc.<br>8,000 % éch. 15/09/2028                                                   | 2 825                               | 2 831                            | 0,19                      | 7,000 % éch. 01/02/2033 (h)                                      | 3 350                               | 3 288                            | 0,22                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 15/06/2031                                                                     | 1 500                               | 1 386                            | 0,09                      | 7,375 % éch. 01/02/2036                                          | 550                                 | 540                              | 0,04                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | B.C. Ltd.<br>10,000 % éch. 15/04/2032                                                        | 8 134                               | 8 244                            | 0,54                      | Celanese U.S. Holdings LLC<br>1,400 % éch. 05/08/2026            | 825                                 | 822                              | 0,05                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | B.C. Unlimited Liability Co.<br>3,875 % éch. 15/01/2028                                      | 4 000                               | 3 927                            | 0,26                      | 7,000 % éch. 15/02/2031                                          | 400                                 | 412                              | 0,03                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/10/2030                                                                      | 2 425                               | 2 291                            | 0,15                      | Centene Corp.<br>2,450 % éch. 15/07/2028                         | 850                                 | 808                              | 0,05                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/01/2028                                                                      | 2 000                               | 1 979                            | 0,13                      | 3,000 % éch. 15/10/2030                                          | 925                                 | 838                              | 0,06                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/06/2029                                                                      | 3 175                               | 3 224                            | 0,21                      | 3,375 % éch. 15/02/2030                                          | 3 450                               | 3 217                            | 0,21                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Bath & Body Works, Inc.<br>6,750 % éch. 01/07/2036                                           | 650                                 | 652                              | 0,04                      | 4,625 % éch. 15/12/2029                                          | 1 300                               | 1 262                            | 0,08                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 01/11/2035                                                                      | 1 300                               | 1 332                            | 0,09                      | Central Parent LLC<br>8,000 % éch. 15/06/2029                    | 1 225                               | 796                              | 0,05                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/06/2029                                                                      | 800                                 | 810                              | 0,05                      | Central Parent, Inc.<br>7,250 % éch. 15/06/2029                  | 500                                 | 325                              | 0,02                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Bausch & Lomb Corp.<br>8,375 % éch. 01/10/2028                                               | 3 150                               | 3 241                            | 0,21                      | Cerdia Finanz GmbH<br>9,375 % éch. 03/10/2031                    | 1 000                               | 898                              | 0,06                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Bausch Health Cos., Inc.<br>4,875 % éch. 01/06/2028                                          | 296                                 | 274                              | 0,02                      | Champ Acquisition Corp.<br>8,375 % éch. 01/12/2031               | 625                                 | 656                              | 0,04                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/02/2029                                                                      | 2 250                               | 1 695                            | 0,11                      | Champions Financing, Inc.<br>8,750 % éch. 15/02/2029             | 700                                 | 681                              | 0,04                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 11,000 % éch. 30/09/2028                                                                     | 366                                 | 373                              | 0,02                      | Charlotte Buyer, Inc.<br>8,000 % éch. 30/06/2031                 | 950                                 | 962                              | 0,06                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Beach Acquisition Bidco LLC (10,000 % en numéraire ou 10,750 % de<br>rémunération en nature) |                                     |                                  |                           | Chobani LLC<br>4,625 % éch. 15/11/2028                           | 2 000                               | 1 982                            | 0,13                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 10,000 % éch. 15/07/2033 (b)                                                                 | 2 200                               | 2 499                            | 0,16                      | 7,625 % éch. 01/07/2029                                          | 1 275                               | 1 316                            | 0,09                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Beacon Mobility Corp.<br>7,250 % éch. 01/08/2030                                             | 2 750                               | 2 865                            | 0,19                      | Churchill Downs, Inc.<br>5,500 % éch. 01/04/2027                 | 700                                 | 700                              | 0,05                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Beazer Homes USA, Inc.<br>8,000 % éch. 15/01/2032                                            | 1 200                               | 1 206                            | 0,08                      | 6,750 % éch. 01/05/2031                                          | 2 700                               | 2 751                            | 0,18                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                              | 3 025                               | 3 087                            | 0,20                      | Cipher Compute LLC<br>7,125 % éch. 15/11/2030                    | 350                                 | 364                              | 0,02                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | BioMarin Pharmaceutical, Inc.<br>5,500 % éch. 15/02/2034                                     | 325                                 | 320                              | 0,02                      | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.<br>7,125 % éch. 15/02/2031  | 1 925                               | 1 994                            | 0,13                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Block, Inc.<br>5,625 % éch. 15/08/2030                                                       | 1 200                               | 1 204                            | 0,08                      | 7,500 % éch. 15/03/2033                                          | 1 650                               | 1 738                            | 0,11                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/08/2033                                                                      | 75                                  | 76                               | 0,01                      | 7,750 % éch. 15/04/2028                                          | 1 225                               | 1 230                            | 0,08                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/05/2032                                                                      | 4 775                               | 4 877                            | 0,32                      | Cleveland-Cliffs, Inc.<br>6,750 % éch. 15/04/2030                | 1 850                               | 1 853                            | 0,12                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Bombardier, Inc.<br>5,875 % éch. 15/01/2035                                                  | 1 550                               | 1 558                            | 0,10                      | 7,500 % éch. 15/09/2031                                          | 1 650                               | 1 671                            | 0,11                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 15/11/2030                                                                      | 3 200                               | 3 387                            | 0,22                      | 7,625 % éch. 15/01/2034                                          | 1 425                               | 1 424                            | 0,09                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Bond U.S. Bidco, Inc.<br>7,125 % éch. 15/06/2033                                             | 2 425                               | 2 450                            | 0,16                      | Cloud Software Group, Inc.<br>6,500 % éch. 31/03/2029            | 5 225                               | 5 074                            | 0,33                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Borr IHC Ltd.<br>8,750 % éch. 15/01/2032                                                     | 3 450                               | 3 372                            | 0,22                      | 6,625 % éch. 15/08/2033                                          | 1 850                               | 1 605                            | 0,11                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 9,000 % éch. 15/01/2034                                                                      | 1 525                               | 1 476                            | 0,10                      | 8,250 % éch. 30/06/2032                                          | 1 025                               | 961                              | 0,06                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Brink's Co.<br>4,625 % éch. 15/10/2027                                                       | 675                                 | 672                              | 0,04                      | 9,000 % éch. 30/09/2029                                          | 4 600                               | 4 468                            | 0,29                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Builders FirstSource, Inc.<br>4,250 % éch. 01/02/2032                                        | 3 575                               | 3 333                            | 0,22                      | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.<br>6,750 % éch. 15/04/2032 | 2 375                               | 2 307                            | 0,15                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/05/2035                                                                      | 1 250                               | 1 276                            | 0,08                      | 6,875 % éch. 15/01/2030                                          | 2 000                               | 1 995                            | 0,13                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Caesars Entertainment, Inc.<br>6,500 % éch. 15/02/2032                                       | 2 750                               | 2 685                            | 0,18                      | 8,750 % éch. 15/04/2030                                          | 2 100                               | 2 073                            | 0,14                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Canada Cartage Corp.<br>9,750 % éch. 08/05/2031                                              | 1 000                               | 971                              | 0,06                      | CMG Media Corp.<br>8,875 % éch. 18/06/2029                       | 700                                 | 513                              | 0,03                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Canpack Group, Inc.<br>6,000 % éch. 15/05/2031                                               | 2 250                               | 2 264                            | 0,15                      | Cogent Communications Group LLC<br>6,500 % éch. 01/07/2032       | 4 225                               | 3 807                            | 0,25                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Carnival Corp. Ltd.<br>5,125 % éch. 01/05/2029                                               | 1 375                               | 1 374                            | 0,09                      | 7,000 % éch. 15/06/2027                                          | 2 450                               | 2 434                            | 0,16                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/06/2031                                                                      | 1 275                               | 1 299                            | 0,09                      | Coherent Corp.<br>5,000 % éch. 15/12/2029                        | 4 800                               | 4 729                            | 0,31                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Carnival UK Ltd.<br>1,000 % éch. 28/10/2029                                                  | € 5 000                             | 5 346                            | 0,35                      | Columbus McKinnon Corp.<br>7,125 % éch. 01/02/2033               | 2 900                               | 2 908                            | 0,19                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Carpenter Technology Corp.<br>5,625 % éch. 01/03/2034                                        | \$ 650                              | 650                              | 0,04                      | Commercial Metals Co.<br>3,875 % éch. 15/02/2031                 | 725                                 | 680                              | 0,04                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           | Cars.com, Inc.<br>6,375 % éch. 01/11/2028                                                    | 150                                 | 149                              | 0,01                      | 4,375 % éch. 15/03/2032                                          | 425                                 | 403                              | 0,03                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/11/2033                                          | 1 125                               | 1 119                            | 0,07                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           | Community Health Systems, Inc.<br>5,250 % éch. 15/05/2030        | 3 650                               | 3 447                            | 0,23                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 01/04/2030                                          | 2 450                               | 2 202                            | 0,14                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 15/01/2034                                          | 5 225                               | 5 462                            | 0,36                      |
|                                                            |                                     |                                  |                           |                                                                                              |                                     |                                  |                           | 10,875 % éch. 15/01/2032                                         | 1 984                               | 2 139                            | 0,14                      |

# Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Connect Finco SARL                                                         | \$ 2 875                            | \$ 3 029                         | 0,20                      | ELK Grove Village Property LLC        | \$ 1 050                            | \$ 1 058                         | 0,07                      | Granite Construction, Inc.                                                       | \$ 775                              | \$ 790                           | 0,05                      |
| 9,000 % éch. 15/09/2029                                                    |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/06/2031               |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/06/2034                                                          |                                     |                                  |                           |
| Connect Holding LLC                                                        | 4 550                               | 4 561                            | 0,30                      | Ellucian Holdings, Inc.               | 1 875                               | 1 817                            | 0,12                      | Graphic Packaging International LLC                                              | 225                                 | 224                              | 0,01                      |
| 10,500 % éch. 03/04/2031                                                   |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/12/2029               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/07/2027                                                          |                                     |                                  |                           |
| Consolidated Energy Finance S.A.                                           | 375                                 | 360                              | 0,02                      | Emerald Borrower LP                   | 1 075                               | 1 100                            | 0,07                      | Gray Media, Inc.                                                                 | 2 900                               | 2 086                            | 0,14                      |
| 5,625 % éch. 15/10/2028                                                    |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/12/2030               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/10/2030                                                          |                                     |                                  |                           |
| 12,000 % éch. 15/02/2031                                                   | 275                                 | 285                              | 0,02                      | Encompass Health Corp.                | 125                                 | 124                              | 0,01                      | 5,375 % éch. 15/11/2031                                                          | 431                                 | 289                              | 0,02                      |
| Cooper-Standard Automotive, Inc.                                           | 1 200                               | 1 210                            | 0,08                      | 4,500 % éch. 01/02/2028               |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 15/07/2032                                                          | 4 400                               | 4 251                            | 0,28                      |
| 9,250 % éch. 01/03/2031                                                    |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 01/06/2034               | 1 975                               | 1 972                            | 0,13                      | 10,500 % éch. 15/07/2029                                                         | 877                                 | 926                              | 0,06                      |
| Core & Main LP                                                             | 1 425                               | 1 433                            | 0,09                      | Engerizer Holdings, Inc.              | 250                                 | 248                              | 0,02                      | Griffon Corp.                                                                    | 4 100                               | 4 103                            | 0,27                      |
| 6,000 % éch. 01/07/2034 (a)                                                |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/06/2028               |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 01/03/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
| Core Scientific Finance LLC                                                | 4 950                               | 5 023                            | 0,33                      | EquipmentShare.com, Inc.              | 3 100                               | 3 050                            | 0,20                      | GSG Bidco Ltd.                                                                   | € 1 025                             | 1 163                            | 0,08                      |
| 7,750 % éch. 15/05/2031                                                    |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 01/07/2034 (a)           | 325                                 | 338                              | 0,02                      | 5,375 % éch. 15/06/2036                                                          |                                     |                                  |                           |
| CoreWeave, Inc.                                                            | 2 950                               | 2 919                            | 0,19                      | 8,625 % éch. 15/05/2032               |                                     |                                  |                           | HealthEquity, Inc.                                                               | \$ 1 700                            | 1 654                            | 0,11                      |
| 9,000 % éch. 01/02/2031                                                    |                                     |                                  |                           | Esab Corp.                            | 1 125                               | 1 129                            | 0,07                      | 4,500 % éch. 01/10/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 01/06/2030                                                    | 3 050                               | 3 072                            | 0,20                      | 5,625 % éch. 01/04/2031               |                                     |                                  |                           | Hertz Corp.                                                                      | 1 325                               | 1 080                            | 0,07                      |
| 9,625 % éch. 15/07/2032                                                    | 1 200                               | 1 184                            | 0,08                      | EW Scripps Co.                        | 4 225                               | 3 702                            | 0,24                      | 12,625 % éch. 15/07/2029                                                         |                                     |                                  |                           |
| 9,750 % éch. 01/10/2031                                                    | 4 150                               | 4 144                            | 0,27                      | 9,875 % éch. 15/08/2030               |                                     |                                  |                           | Hess Midstream Operations LP                                                     | 650                                 | 655                              | 0,04                      |
| CQP Holdco LP                                                              | 4 050                               | 3 977                            | 0,26                      | Excelerate Energy LP                  | 2 775                               | 2 928                            | 0,19                      | 5,875 % éch. 01/03/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 15/06/2031                                                    |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 15/05/2030               |                                     |                                  |                           | Hilton Domestic Operating Co., Inc.                                              | 4 800                               | 4 396                            | 0,29                      |
| Crocs, Inc.                                                                | 900                                 | 874                              | 0,06                      | Fair Isaac Corp.                      | 1 525                               | 1 493                            | 0,10                      | 3,625 % éch. 15/02/2032                                                          | 650                                 | 659                              | 0,04                      |
| 4,250 % éch. 15/03/2029                                                    |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/06/2028               | 3 750                               | 3 696                            | 0,24                      | 6,125 % éch. 01/04/2032                                                          |                                     |                                  |                           |
| Crowdstrike Holdings, Inc.                                                 | 3 225                               | 3 078                            | 0,20                      | 6,250 % éch. 15/09/2034               |                                     |                                  |                           | HNI Corp.                                                                        | 600                                 | 591                              | 0,04                      |
| 3,000 % éch. 15/02/2029                                                    |                                     |                                  |                           | Fertitta Entertainment LLC            | 2 395                               | 2 350                            | 0,15                      | 5,125 % éch. 18/01/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| CSC Holdings LLC                                                           | 1 625                               | 965                              | 0,06                      | 6,750 % éch. 15/01/2030               |                                     |                                  |                           | Howard Midstream Energy Partners LLC                                             | 1 525                               | 1 580                            | 0,10                      |
| 3,375 % éch. 15/02/2031                                                    | 1 950                               | 1 160                            | 0,08                      | Fiberco SpA                           | 225                                 | 218                              | 0,01                      | 7,375 % éch. 15/07/2032                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 01/12/2030                                                    | 3 200                               | 768                              | 0,05                      | 6,000 % éch. 30/09/2034               | 1 550                               | 1 555                            | 0,10                      | Hybar LLC                                                                        | 950                                 | 956                              | 0,06                      |
| 4,625 % éch. 01/12/2030                                                    | 1 175                               | 738                              | 0,05                      | 6,375 % éch. 15/11/2033               | 2 425                               | 2 493                            | 0,16                      | 7,375 % éch. 01/07/2034                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 01/02/2028                                                    | 1 975                               | 1 325                            | 0,09                      | 7,200 % éch. 18/07/2036               |                                     |                                  |                           | iHeartCommunications, Inc.                                                       | 2 825                               | 2 638                            | 0,17                      |
| 5,500 % éch. 15/04/2027                                                    | 3 200                               | 758                              | 0,05                      | Fiesta Purchaser, Inc.                | 675                                 | 681                              | 0,04                      | 7,750 % éch. 15/08/2030                                                          | 850                                 | 739                              | 0,05                      |
| 5,750 % éch. 15/01/2030                                                    | 1 625                               | 973                              | 0,06                      | 7,875 % éch. 01/03/2031               |                                     |                                  |                           | 10,875 % éch. 01/05/2030                                                         |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 01/02/2029                                                    | 1 250                               | 339                              | 0,02                      | First Student Bidco, Inc.             | 3 100                               | 2 971                            | 0,20                      | IHO Verwaltungs GmbH                                                             | 800                                 | 832                              | 0,05                      |
| 7,500 % éch. 01/04/2028                                                    | 1 975                               | 1 216                            | 0,08                      | 4,000 % éch. 31/07/2029               |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 15/05/2033                                                          |                                     |                                  |                           |
| 11,750 % éch. 31/01/2029                                                   |                                     |                                  |                           | Flora Food Management BV              | € 775                               | 884                              | 0,06                      | IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature) | 425                                 | 429                              | 0,03                      |
| CVR Energy, Inc.                                                           | 1 025                               | 1 021                            | 0,07                      | 7,500 % éch. 31/10/2030               |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/05/2029 (b)                                                      |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/02/2031                                                    | 375                                 | 371                              | 0,02                      | FMC Corp.                             | \$ 375                              | 295                              | 0,02                      | IHO Verwaltungs GmbH (7,750 % en numéraire ou 8,500 % de rémunération en nature) | 525                                 | 544                              | 0,04                      |
| 7,875 % éch. 15/02/2034                                                    | 600                                 | 600                              | 0,04                      | 6,375 % éch. 18/05/2053               | 2 750                               | 2 864                            | 0,19                      | 7,750 % éch. 15/11/2030 (b)                                                      |                                     |                                  |                           |
| Darling Ingredients, Inc.                                                  |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/06/2031               |                                     |                                  |                           | IHO Verwaltungs GmbH (8,000 % en numéraire ou 8,750 % de rémunération en nature) | 275                                 | 287                              | 0,02                      |
| 5,250 % éch. 15/04/2027                                                    |                                     |                                  |                           | Fortescue Treasury Pty. Ltd.          | 245                                 | 233                              | 0,02                      | 8,000 % éch. 15/11/2032 (b)                                                      |                                     |                                  |                           |
| DaVita, Inc.                                                               | 1 100                               | 1 020                            | 0,07                      | 4,375 % éch. 01/04/2031               | 2 041                               | 2 027                            | 0,13                      | Industrial F&B Investments, Inc.                                                 | 3 725                               | 3 799                            | 0,25                      |
| 3,750 % éch. 15/02/2031                                                    | 1 775                               | 1 721                            | 0,11                      | 4,500 % éch. 15/09/2027               | 1 487                               | 1 506                            | 0,10                      | 7,750 % éch. 11/02/2033                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 01/06/2030                                                    |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 15/04/2030               | 340                                 | 350                              | 0,02                      | INEOS Finance PLC                                                                | 750                                 | 746                              | 0,05                      |
| Delek Logistics Partners LP                                                | 2 325                               | 2 315                            | 0,15                      | 6,125 % éch. 15/04/2032               |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/05/2028 (h)                                                      | 1 650                               | 1 606                            | 0,11                      |
| 6,875 % éch. 01/06/2034                                                    |                                     |                                  |                           | Fortress Intermediate, Inc.           | 3 025                               | 3 079                            | 0,20                      | 7,500 % éch. 15/04/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| Deluxe Corp.                                                               | 1 025                               | 1 062                            | 0,07                      | 7,500 % éch. 01/06/2031               |                                     |                                  |                           | INEOS Quattro Finance PLC                                                        | 475                                 | 446                              | 0,03                      |
| 8,125 % éch. 15/09/2029                                                    |                                     |                                  |                           | Froneri Lux FinCo SARL                | 1 575                               | 1 546                            | 0,10                      | 9,625 % éch. 15/03/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| Dexco Global, Inc.                                                         | 750                                 | 619                              | 0,04                      | 6,000 % éch. 01/08/2032               | 845                                 | 828                              | 0,05                      | Ingevity Corp.                                                                   | 9 800                               | 9 500                            | 0,62                      |
| 7,500 % éch. 15/04/2032                                                    |                                     |                                  |                           | Full House Resorts, Inc.              |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/11/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
| Directv Financing LLC                                                      | 125                                 | 127                              | 0,01                      | 8,250 % éch. 15/02/2028               |                                     |                                  |                           | Ingram Micro, Inc.                                                               | 2 125                               | 2 088                            | 0,14                      |
| 8,875 % éch. 01/02/2030                                                    | 2 900                               | 2 949                            | 0,19                      | Gaia Purchaser, Inc.                  | 1 450                               | 1 468                            | 0,10                      | 4,750 % éch. 15/05/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| 9,250 % éch. 01/06/2032                                                    |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch. 15/07/2033 (a)           |                                     |                                  |                           | Insulet Corp.                                                                    | 3 150                               | 3 197                            | 0,21                      |
| Discovery Communications LLC                                               | 875                                 | 814                              | 0,05                      | Gap, Inc.                             | 3 650                               | 3 442                            | 0,23                      | 6,500 % éch. 01/04/2033                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/05/2030                                                    | 2 750                               | 2 710                            | 0,18                      | 8,750 % éch. 30/04/2034               |                                     |                                  |                           | IQVIA, Inc.                                                                      | 1 275                               | 1 298                            | 0,09                      |
| 3,950 % éch. 20/03/2028                                                    | 400                                 | 333                              | 0,02                      | Gen Digital, Inc.                     | 2 975                               | 3 030                            | 0,20                      | 6,250 % éch. 01/06/2032                                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,350 % éch. 01/06/2040                                                    |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 30/09/2030               | 1 850                               | 1 808                            | 0,12                      | JetBlue Airways Corp.                                                            | 4 375                               | 3 968                            | 0,26                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.                                            | 1 925                               | 1 907                            | 0,13                      | GFL Environmental, Inc.               | 2 700                               | 2 627                            | 0,17                      | 9,875 % éch. 20/09/2031                                                          |                                     |                                  |                           |
| 4,054 % éch. 15/03/2029                                                    | 2 625                               | 2 357                            | 0,15                      | 4,000 % éch. 01/08/2028               |                                     |                                  |                           | KBR, Inc.                                                                        | 825                                 | 815                              | 0,05                      |
| 4,279 % éch. 15/03/2032                                                    | 4 650                               | 3 412                            | 0,22                      | 4,375 % éch. 15/08/2029               |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 30/09/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 15/03/2042                                                    | 250                                 | 168                              | 0,01                      | Global Infrastructure Solutions, Inc. | 2 275                               | 2 289                            | 0,15                      | 6,500 % éch. 01/09/2029                                                          | 1 500                               | 1 481                            | 0,10                      |
| 5,141 % éch. 15/03/2052                                                    |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/07/2034 (a)           | 1 075                               | 1 013                            | 0,07                      | 5,875 % éch. 01/04/2031                                                          | 1 000                               | 1 003                            | 0,07                      |
| DISH DBS Corp.                                                             | 2 550                               | 2 524                            | 0,17                      | Go Daddy Operating Co. LLC            | 513                                 | 513                              | 0,03                      | Kodiak Gas Services LLC                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 01/12/2026                                                    | 3 605                               | 3 495                            | 0,23                      | 3,500 % éch. 01/03/2029               |                                     |                                  |                           | 5,875 % éch. 01/04/2031                                                          |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 01/12/2028                                                    | 130                                 | 125                              | 0,01                      | 5,250 % éch. 01/12/2027               |                                     |                                  |                           | Kraken Oil & Gas Partners LLC                                                    | 2 300                               | 2 250                            | 0,15                      |
| 7,375 % éch. 01/07/2028                                                    | 1 650                               | 1 650                            | 0,11                      | Goat Holdco LLC                       | 1 800                               | 1 846                            | 0,12                      | 7,125 % éch. 15/05/2031                                                          | 650                                 | 657                              | 0,04                      |
| 7,750 % éch. 01/07/2026                                                    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/02/2032               |                                     |                                  |                           | 7,625 % éch. 15/08/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| DISH Network Corp.                                                         | 3 175                               | 3 265                            | 0,21                      | goeasy Ltd.                           | 150                                 | 134                              | 0,01                      | Lamar Media Corp.                                                                | 275                                 | 257                              | 0,02                      |
| 11,750 % éch. 15/11/2027                                                   |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/05/2030               | 1 200                               | 1 082                            | 0,07                      | 3,625 % éch. 15/01/2031                                                          | 1 400                               | 1 375                            | 0,09                      |
| Dorman Products, Inc.                                                      | 625                                 | 633                              | 0,04                      | 6,875 % éch. 15/02/2031               | 725                                 | 712                              | 0,05                      | 3,750 % éch. 15/02/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/06/2034                                                    |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 01/10/2030               |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 01/11/2033                                                          |                                     |                                  |                           |
| EchoStar Corp.                                                             | 5 800                               | 6 271                            | 0,41                      | 9,250 % éch. 01/12/2028               |                                     |                                  |                           | Lamb Weston Holdings, Inc.                                                       | 1 175                               | 1 168                            | 0,08                      |
| 10,750 % éch. 30/11/2029                                                   |                                     |                                  |                           | Golar LNG Ltd.                        | 1 300                               | 1 323                            | 0,09                      | 4,875 % éch. 15/05/2028                                                          |                                     |                                  |                           |
| EchoStar Corp. (6,750 % en numéraire ou 6,750 % de rémunération en nature) | 2 625                               | 2 672                            | 0,18                      | 7,500 % éch. 02/10/2030               |                                     |                                  |                           | LBM Acquisition LLC                                                              | 6 356                               | 4 625                            | 0,30                      |
| 6,750 % éch. 30/11/2030 (b)                                                |                                     |                                  |                           | Goodyear Tire & Rubber Co.            | 550                                 | 526                              | 0,03                      | 6,250 % éch. 15/01/2029                                                          | 2 375                               | 2 118                            | 0,14                      |
| Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC                                           | 3 800                               | 3 806                            | 0,25                      | 5,000 % éch. 15/07/2029               |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 15/06/2031                                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/02/2032                                                    |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 15/07/2032               |                                     |                                  |                           | Level 3 Financing, Inc.                                                          | 57                                  | 55                               | 0,00                      |
| Element Solutions, Inc.                                                    | 1 200                               | 1 172                            | 0,08                      |                                       |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 15/07/2029                                                          |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 01/09/2028                                                    |                                     |                                  |                           |                                       |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           |

| DESCRIPTION                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,875 % éch. 15/06/2029                         | \$ 675                              | \$ 670                           | 0,04                      | Neptune Bidco U.S., Inc.                                | \$ 2 425                            | \$ 2 475                         | 0,16                      | Photo Holdings LLC                                           | \$ 2 000                            | \$ 2 062                         | 0,14                      |
| 6,875 % éch. 30/06/2033                         | 2 325                               | 2 390                            | 0,16                      | 9,290 % éch. 15/04/2029                                 | 1 700                               | 1 721                            | 0,11                      | 12,000 % éch. 01/07/2031                                     | 675                                 | 688                              | 0,05                      |
| 7,000 % éch. 31/03/2034                         | 2 925                               | 3 018                            | 0,20                      | 9,500 % éch. 15/02/2033                                 | 2 800                               | 2 904                            | 0,19                      | Pioneer Opco LLC                                             |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/01/2036                         | 2 350                               | 2 525                            | 0,17                      | 10,375 % éch. 15/05/2031                                |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/05/2033                                      |                                     |                                  |                           |
| LifePoint Health, Inc.                          |                                     |                                  |                           | Nexstar Media, Inc.                                     |                                     |                                  |                           | PLS Group Ltd.                                               |                                     |                                  |                           |
| 5,375 % éch. 15/01/2029                         | 1 450                               | 1 392                            | 0,09                      | 6,500 % éch. 15/09/2033                                 | 3 200                               | 3 202                            | 0,21                      | 6,875 % éch. 01/05/2031                                      | 1 000                               | 1 025                            | 0,07                      |
| 7,000 % éch. 01/05/2034                         | 2 725                               | 2 614                            | 0,17                      | 7,250 % éch. 15/04/2034                                 | 1 925                               | 1 922                            | 0,13                      | PM General Purchaser LLC                                     |                                     |                                  |                           |
| 8,375 % éch. 15/02/2032                         | 875                                 | 912                              | 0,06                      | Nissan Motor Co. Ltd.                                   |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 01/10/2028                                      | 800                                 | 693                              | 0,05                      |
| 9,875 % éch. 15/08/2030                         | 950                                 | 1 002                            | 0,07                      | 4,345 % éch. 17/09/2027                                 | 1 075                               | 1 058                            | 0,07                      | Post Holdings, Inc.                                          |                                     |                                  |                           |
| 10,000 % éch. 01/06/2032                        | 2 525                               | 2 524                            | 0,17                      | 4,810 % éch. 17/09/2030                                 | 400                                 | 373                              | 0,02                      | 4,500 % éch. 15/09/2031                                      | 2 779                               | 2 608                            | 0,17                      |
| Light & Wonder International, Inc.              |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 17/07/2032                                 | 300                                 | 311                              | 0,02                      | 4,625 % éch. 15/04/2030                                      | 6 300                               | 6 090                            | 0,40                      |
| 7,250 % éch. 15/11/2029                         | 250                                 | 255                              | 0,02                      | 8,125 % éch. 17/07/2035                                 | 550                                 | 583                              | 0,04                      | 6,375 % éch. 01/03/2033                                      | 1 000                               | 993                              | 0,07                      |
| 7,500 % éch. 01/09/2031                         | 1 325                               | 1 374                            | 0,09                      | Noble Finance LLC                                       |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/03/2036                                      | 600                                 | 594                              | 0,04                      |
| Lithia Motors, Inc.                             |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/06/2034                                 | 1 150                               | 1 128                            | 0,07                      | Precision Drilling Corp.                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/12/2027                         | 1 275                               | 1 270                            | 0,08                      | 8,000 % éch. 15/04/2030                                 | 4 950                               | 5 131                            | 0,34                      | 6,875 % éch. 15/01/2029                                      | 500                                 | 503                              | 0,03                      |
| Live Nation Entertainment, Inc.                 |                                     |                                  |                           | Nordstrom, Inc.                                         |                                     |                                  |                           | Prime Healthcare Services, Inc.                              |                                     |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 15/01/2028                         | 1 815                               | 1 781                            | 0,12                      | 4,250 % éch. 01/08/2031                                 | 850                                 | 799                              | 0,05                      | 9,375 % éch. 01/09/2029                                      | 1 675                               | 1 751                            | 0,12                      |
| 6,500 % éch. 15/05/2027                         | 1 300                               | 1 301                            | 0,09                      | 5,000 % éch. 15/01/2044                                 | 1 550                               | 1 095                            | 0,07                      | Primo Water Holdings, Inc.                                   |                                     |                                  |                           |
| Lsf12 Helix Parent LLC                          |                                     |                                  |                           | Northriver Midstream Finance LP                         |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 30/04/2029                                      | 3 325                               | 3 248                            | 0,21                      |
| 7,125 % éch. 01/02/2033                         | 825                                 | 801                              | 0,05                      | 6,750 % éch. 15/07/2032                                 | 1 025                               | 1 039                            | 0,07                      | 6,250 % éch. 01/04/2029                                      | 3 000                               | 3 013                            | 0,20                      |
| Madison IAQ LLC                                 |                                     |                                  |                           | NOVA Chemicals Corp.                                    |                                     |                                  |                           | Qnity Electronics, Inc.                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 30/06/2028                         | 2 325                               | 2 289                            | 0,15                      | 4,250 % éch. 15/05/2029                                 | 1 600                               | 1 557                            | 0,10                      | 5,750 % éch. 15/08/2032                                      | 1 675                               | 1 686                            | 0,11                      |
| MajorDrive Holdings LLC                         |                                     |                                  |                           | Novelis Corp.                                           |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/08/2033                                      | 375                                 | 382                              | 0,03                      |
| 6,375 % éch. 01/06/2029                         | 625                                 | 526                              | 0,03                      | 4,750 % éch. 30/01/2030                                 | 1 975                               | 1 912                            | 0,13                      | Quikrete Holdings, Inc.                                      |                                     |                                  |                           |
| Masterbrand, Inc.                               |                                     |                                  |                           | NuStar Logistics LP                                     |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 01/03/2032                                      | 1 400                               | 1 430                            | 0,09                      |
| 7,000 % éch. 15/07/2032                         | 300                                 | 304                              | 0,02                      | 6,375 % éch. 01/10/2030                                 | 2 500                               | 2 585                            | 0,17                      | 6,750 % éch. 01/03/2033                                      | 1 725                               | 1 759                            | 0,12                      |
| Match Group Holdings LLC                        |                                     |                                  |                           | OAK-Eagle Acquireco, Inc.                               |                                     |                                  |                           | QXO Building Products, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 01/06/2028                         | 2 825                               | 2 788                            | 0,18                      | 7,250 % éch. 01/07/2033                                 | 4 950                               | 5 181                            | 0,34                      | 6,500 % éch. 15/07/2031                                      | 1 250                               | 1 275                            | 0,08                      |
| 5,000 % éch. 15/12/2027                         | 1 950                               | 1 944                            | 0,13                      | 8,750 % éch. 01/07/2034                                 | 3 700                               | 3 929                            | 0,26                      | 6,750 % éch. 30/04/2032                                      | 4 075                               | 4 210                            | 0,28                      |
| Mauser Packaging Solutions Holding Co.          |                                     |                                  |                           | Olin Corp.                                              |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/07/2034                                      | 1 525                               | 1 566                            | 0,10                      |
| 7,875 % éch. 15/04/2030                         | 4 605                               | 4 710                            | 0,31                      | 6,625 % éch. 01/04/2033                                 | 1 175                               | 1 162                            | 0,08                      | Radiology Partners, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| Maxam Prill SARL                                |                                     |                                  |                           | Olympus Water U.S. Holding Corp.                        |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/07/2032                                      | 1 125                               | 1 175                            | 0,08                      |
| 7,750 % éch. 15/07/2030                         | 1 125                               | 1 160                            | 0,08                      | 4,250 % éch. 01/10/2028                                 | 3 375                               | 3 276                            | 0,22                      | Radiology Partners, Inc. (9,781 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| McAfee Corp.                                    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 01/08/2032                                 | 1 400                               | 1 369                            | 0,09                      | 9,781 % éch. 15/02/2030 (b)                                  | 596                                 | 593                              | 0,04                      |
| 7,375 % éch. 15/02/2030                         | 1 925                               | 1 637                            | 0,11                      | ON Semiconductor Corp.                                  |                                     |                                  |                           | Rain Carbon, Inc.                                            |                                     |                                  |                           |
| McGraw-Hill Education, Inc.                     |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 01/09/2028                                 | 4 275                               | 4 172                            | 0,27                      | 12,250 % éch. 01/09/2029                                     | 575                                 | 614                              | 0,04                      |
| 5,750 % éch. 01/08/2028                         | 1 270                               | 1 266                            | 0,08                      | OneSky Flight LLC                                       |                                     |                                  |                           | Rakuten Group, Inc.                                          |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 01/09/2031                         | 2 750                               | 2 797                            | 0,18                      | 8,875 % éch. 15/12/2029                                 | 300                                 | 317                              | 0,02                      | 8,125 % éch. 15/12/2029 (e)                                  | 425                                 | 436                              | 0,03                      |
| 8,000 % éch. 01/08/2029                         | 850                                 | 852                              | 0,06                      | Ontario Gaming GTA LP                                   |                                     |                                  |                           | 9,750 % éch. 15/04/2029                                      | 3 800                               | 4 132                            | 0,27                      |
| Medline Borrower LP                             |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 01/08/2030                                 | 525                                 | 521                              | 0,03                      | 11,250 % éch. 15/02/2027                                     | 2 000                               | 2 067                            | 0,14                      |
| 5,250 % éch. 01/10/2029                         | 2 300                               | 2 287                            | 0,15                      | Open Text Holdings, Inc.                                |                                     |                                  |                           | Rand Parent LLC                                              |                                     |                                  |                           |
| Meridian Arc Holdco LLC                         |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/02/2030                                 | 4 275                               | 3 919                            | 0,26                      | 8,500 % éch. 15/02/2030                                      | 975                                 | 1 011                            | 0,07                      |
| 6,250 % éch. 30/04/2031                         | 3 584                               | 3 594                            | 0,24                      | 4,125 % éch. 01/12/2031                                 | 675                                 | 593                              | 0,04                      | Raven Acquisition Holdings LLC                               |                                     |                                  |                           |
| Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc. |                                     |                                  |                           | Option Care Health, Inc.                                |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/11/2031                                      | 4 400                               | 4 304                            | 0,28                      |
| 7,375 % éch. 15/02/2031                         | 1 750                               | 1 478                            | 0,10                      | 4,375 % éch. 31/10/2029                                 | 600                                 | 577                              | 0,04                      | RB Global Holdings, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| Michaels Cos., Inc.                             |                                     |                                  |                           | Organon & Co.                                           |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/03/2028                                      | 75                                  | 76                               | 0,01                      |
| 8,500 % éch. 15/03/2033                         | 4 050                               | 4 014                            | 0,26                      | 4,125 % éch. 30/04/2028                                 | 2 500                               | 2 470                            | 0,16                      | 7,750 % éch. 15/03/2031                                      | 1 492                               | 1 549                            | 0,10                      |
| 11,000 % éch. 15/03/2034                        | 2 400                               | 2 352                            | 0,15                      | Outfront Media Capital LLC                              |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC                               |                                     |                                  |                           |
| Midwest Gaming Borrower LLC                     |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/06/2034                                 | 2 150                               | 2 147                            | 0,14                      | 7,500 % éch. 30/03/2045                                      | 5 125                               | 5 111                            | 0,34                      |
| 4,875 % éch. 01/05/2029                         | 2 035                               | 1 982                            | 0,13                      | Par Petroleum LLC                                       |                                     |                                  |                           | Rivian Holdings LLC                                          |                                     |                                  |                           |
| Mineral Resources Ltd.                          |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 01/06/2034                                 | 700                                 | 709                              | 0,05                      | 10,000 % éch. 15/01/2031                                     | 3 125                               | 3 115                            | 0,20                      |
| 6,000 % éch. 01/05/2032                         | 2 090                               | 2 069                            | 0,14                      | Paradigm Parent LLC and Paradigm Parent CO-Issuer, Inc. |                                     |                                  |                           | ROBLOX Corp.                                                 |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 01/05/2034                         | 3 260                               | 3 208                            | 0,21                      | 8,750 % éch. 17/04/2032                                 | 650                                 | 583                              | 0,04                      | 3,875 % éch. 01/05/2030                                      | 2 425                               | 2 293                            | 0,15                      |
| 7,000 % éch. 01/04/2031                         | 1 050                               | 1 088                            | 0,07                      | Paramount Global                                        |                                     |                                  |                           | Rockies Express Pipeline LLC                                 |                                     |                                  |                           |
| Mitler Brands Acquisition Holdco, Inc.          |                                     |                                  |                           | 3,375 % éch. 15/02/2028                                 | 325                                 | 316                              | 0,02                      | 4,800 % éch. 15/05/2030                                      | 800                                 | 785                              | 0,05                      |
| 6,750 % éch. 01/04/2032                         | 750                                 | 744                              | 0,05                      | 3,700 % éch. 01/06/2028                                 | 1 575                               | 1 528                            | 0,10                      | Rogers Communications, Inc.                                  |                                     |                                  |                           |
| MIWD Holdco LLC                                 |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 01/06/2029                                 | 450                                 | 432                              | 0,03                      | 7,000 % éch. 15/04/2055                                      | 275                                 | 282                              | 0,02                      |
| 5,500 % éch. 01/02/2030                         | 600                                 | 565                              | 0,04                      | 4,200 % éch. 19/05/2032                                 | 550                                 | 477                              | 0,03                      | 7,125 % éch. 15/04/2055                                      | 350                                 | 360                              | 0,02                      |
| Molina Healthcare, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 15/01/2045                                 | 3 625                               | 2 310                            | 0,15                      | Roller Bearing Co. of America, Inc.                          |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/11/2030                         | 300                                 | 280                              | 0,02                      | 4,900 % éch. 15/08/2044                                 | 2 625                               | 1 736                            | 0,11                      | 4,375 % éch. 15/10/2029                                      | 1 450                               | 1 416                            | 0,09                      |
| 3,875 % éch. 15/05/2032                         | 375                                 | 339                              | 0,02                      | 4,950 % éch. 15/01/2031                                 | 1 825                               | 1 697                            | 0,11                      | RR Donnelley & Sons Co.                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 15/06/2028                         | 925                                 | 909                              | 0,06                      | 5,250 % éch. 01/04/2044                                 | 500                                 | 344                              | 0,02                      | 9,500 % éch. 01/08/2029                                      | 1 725                               | 1 790                            | 0,12                      |
| 6,500 % éch. 15/02/2031                         | 750                                 | 764                              | 0,05                      | 5,850 % éch. 01/09/2043                                 | 2 275                               | 1 705                            | 0,11                      | Ryan Specialty LLC                                           |                                     |                                  |                           |
| Moss Creek Resources Holdings, Inc.             |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 28/02/2057                                 | 225                                 | 184                              | 0,01                      | 5,875 % éch. 01/08/2032                                      | 1 425                               | 1 403                            | 0,09                      |
| 8,250 % éch. 01/09/2031                         | 900                                 | 893                              | 0,06                      | 6,875 % éch. 30/04/2036                                 | 800                                 | 751                              | 0,05                      | Sabre GBLB, Inc.                                             |                                     |                                  |                           |
| Murphy Oil USA, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 30/07/2030                                 | 500                                 | 525                              | 0,03                      | 10,750 % éch. 15/11/2029                                     | 921                                 | 886                              | 0,06                      |
| 3,750 % éch. 15/02/2031                         | 2 375                               | 2 223                            | 0,15                      | Park River Holdings, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 10,750 % éch. 15/03/2030                                     | 1 106                               | 1 056                            | 0,07                      |
| Nabors Industries, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 15/03/2031                                 | 1 725                               | 1 742                            | 0,11                      | SCIH Salt Holdings, Inc.                                     |                                     |                                  |                           |
| 7,625 % éch. 15/11/2032                         | 4 925                               | 5 042                            | 0,33                      | Performance Food Group, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 01/05/2028                                      | 2 200                               | 2 171                            | 0,14                      |
| National Mentor Holdings, Inc.                  |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 01/08/2029                                 | 3 356                               | 3 259                            | 0,21                      | Sadrill Finance Ltd.                                         |                                     |                                  |                           |
| 10,500 % éch. 15/12/2030                        | 2 875                               | 3 032                            | 0,20                      | Perrigo Finance Unlimited Co.                           |                                     |                                  |                           | 8,375 % éch. 01/08/2030                                      | 5 200                               | 5 455                            | 0,36                      |
| NCL Corp. Ltd.                                  |                                     |                                  |                           | 4,900 % éch. 15/12/2044                                 | 275                                 | 202                              | 0,01                      | Seagate Data Storage Technology Pte. Ltd.                    |                                     |                                  |                           |
| 6,750 % éch. 01/02/2032                         | 875                                 | 874                              | 0,06                      | Petco Health & Wellness Co., Inc.                       |                                     |                                  |                           | 4,091 % éch. 01/06/2029                                      | 350                                 | 341                              | 0,02                      |
| NCR Atleos Corp.                                |                                     |                                  |                           | 8,250 % éch. 01/02/2031                                 | 75                                  | 76                               | 0,01                      | 4,125 % éch. 15/01/2031                                      | 2 375                               | 2 261                            | 0,15                      |
| 9,500 % éch. 01/04/2029                         | 1 975                               | 2 107                            | 0,14                      | PetSmart LLC                                            |                                     |                                  |                           | 9,625 % éch. 01/12/2032                                      | 2 000                               | 2 206                            | 0,15                      |
| NCR Voyix Corp.                                 |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/09/2032                                 | 697                                 | 698                              | 0,05                      |                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,250 % éch. 01/10/2030                         | 1 200                               | 1 092                            | 0,07                      |                                                         |                                     |                                  |                           |                                                              |                                     |                                  |                           |



## Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Service Corp. International              |                                     |                                  |                           | TopBuild Corp.                     |                                     |                                  |                           | Victra Holdings LLC                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/08/2030                  | \$ 2 125                            | \$ 1 973                         | 0,13                      | 3,625 % éch. 15/03/2029            | \$ 4 275                            | \$ 4 275                         | 0,28                      | 8,750 % éch. 15/09/2029                                                               | \$ 1 025                            | \$ 1 058                         | 0,07                      |
| 4,625 % éch. 15/12/2027                  | 600                                 | 597                              | 0,04                      | 4,125 % éch. 15/02/2032            | 5 650                               | 5 722                            | 0,38                      | Viking Cruises Ltd.                                                                   |                                     |                                  |                           |
| Shutterfly Finance LLC                   |                                     |                                  |                           | Toucan FinCo Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 15/02/2029                                                               | 2 100                               | 2 108                            | 0,14                      |
| 8,500 % éch. 01/10/2027                  | 141                                 | 141                              | 0,01                      | 9,500 % éch. 15/05/2030            | 1 790                               | 1 689                            | 0,11                      | 9,125 % éch. 15/07/2031                                                               | 6 625                               | 6 945                            | 0,46                      |
| Simmons Foods, Inc.                      |                                     |                                  |                           | TransDigm, Inc.                    |                                     |                                  |                           | Virgin Media Finance PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 01/03/2029                  | 5 400                               | 5 220                            | 0,34                      | 6,000 % éch. 15/01/2033            | 2 950                               | 2 981                            | 0,20                      | 5,000 % éch. 15/07/2030                                                               | 2 875                               | 2 189                            | 0,14                      |
| Sirius XM Radio LLC                      |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 31/01/2034            | 900                                 | 919                              | 0,06                      | Virgin Media Secured Finance PLC                                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,125 % éch. 01/09/2026                  | 2 000                               | 1 994                            | 0,13                      | 7,125 % éch. 01/12/2031            | 800                                 | 829                              | 0,05                      | 4,500 % éch. 15/08/2030                                                               | 3 075                               | 2 614                            | 0,17                      |
| 3,875 % éch. 01/09/2031                  | 2 400                               | 2 181                            | 0,14                      | Transocean International Ltd.      |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/05/2029                                                               | 6 025                               | 5 723                            | 0,38                      |
| 4,125 % éch. 01/07/2030                  | 3 525                               | 3 320                            | 0,22                      | 7,875 % éch. 15/10/2032            | 675                                 | 705                              | 0,05                      | Viridian                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,000 % éch. 01/08/2027                  | 2 746                               | 2 744                            | 0,18                      | 8,250 % éch. 15/05/2029            | 3 800                               | 3 926                            | 0,26                      | 10,000 % éch. 15/10/2030                                                              | 700                                 | 744                              | 0,05                      |
| 5,875 % éch. 15/04/2032                  | 2 925                               | 2 893                            | 0,19                      | 8,500 % éch. 15/05/2031            | 1 850                               | 1 922                            | 0,13                      | VistaJet Malta Finance PLC                                                            |                                     |                                  |                           |
| SK Invictus Intermediate SARL            |                                     |                                  |                           | 8,750 % éch. 15/02/2030            | 3 045                               | 3 166                            | 0,21                      | 8,750 % éch. 15/01/2032 (h)                                                           | 5 475                               | 5 428                            | 0,36                      |
| 5,000 % éch. 30/10/2029                  | 825                                 | 809                              | 0,05                      | Travel & Leisure Co.               |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 01/06/2028                                                               | 1 600                               | 1 621                            | 0,11                      |
| Skeena Resources Ltd.                    |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 01/03/2030            | 1 050                               | 1 017                            | 0,07                      | Vmed O2 UK Financing PLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 01/04/2031                  | 1 425                               | 1 498                            | 0,10                      | 6,125 % éch. 01/09/2033            | 200                                 | 198                              | 0,01                      | 4,250 % éch. 31/01/2031                                                               | 1 450                               | 1 194                            | 0,08                      |
| Smyrna Ready Mix Concrete LLC            |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 01/06/2031            | 2 250                               | 2 265                            | 0,15                      | 4,750 % éch. 15/07/2031                                                               | 625                                 | 514                              | 0,03                      |
| 6,000 % éch. 01/11/2028                  | 700                                 | 702                              | 0,05                      | Trident TPI Holdings, Inc.         |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 15/04/2032                                                               | 2 890                               | 2 614                            | 0,17                      |
| Snap, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 12,750 % éch. 31/12/2028           | 3 475                               | 3 484                            | 0,23                      | VOC Escrow Ltd.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| 6,875 % éch. 01/03/2033                  | 3 278                               | 3 197                            | 0,21                      | TriNet Group, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/02/2028                                                               | 650                                 | 650                              | 0,04                      |
| 6,875 % éch. 15/03/2034                  | 3 125                               | 3 028                            | 0,20                      | 3,500 % éch. 01/03/2029            | 2 975                               | 2 810                            | 0,18                      | Voyager Parent LLC                                                                    |                                     |                                  |                           |
| Solaris Energy Infrastructure LLC        |                                     |                                  |                           | Tutor Perini Corp.                 |                                     |                                  |                           | 9,250 % éch. 01/07/2032                                                               | 3 354                               | 3 549                            | 0,23                      |
| 6,375 % éch. 15/05/2031                  | 650                                 | 658                              | 0,04                      | 6,625 % éch. 15/07/2033 (a)        | 4 500                               | 4 531                            | 0,30                      | VZ Secured Financing BV                                                               |                                     |                                  |                           |
| Sotheby's                                |                                     |                                  |                           | U.S. Acute Care Solutions LLC      |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/01/2033                                                               | 4 900                               | 4 694                            | 0,31                      |
| 8,250 % éch. 15/04/2031                  | 1 025                               | 1 020                            | 0,07                      | 9,750 % éch. 15/05/2029            | 3 900                               | 3 682                            | 0,24                      | Wayfair LLC                                                                           |                                     |                                  |                           |
| Specialty Building Products Holdings LLC |                                     |                                  |                           | U.S. Foods, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 7,125 % éch. 31/05/2034                                                               | 175                                 | 180                              | 0,01                      |
| 7,750 % éch. 15/10/2029                  | 575                                 | 530                              | 0,03                      | 7,250 % éch. 15/01/2032            | 775                                 | 805                              | 0,05                      | 7,250 % éch. 31/10/2029                                                               | 1 090                               | 1 126                            | 0,07                      |
| Speedway Motorsports LLC                 |                                     |                                  |                           | UKG, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 7,750 % éch. 15/09/2030                                                               | 2 850                               | 2 998                            | 0,20                      |
| 4,875 % éch. 01/11/2027                  | 1 269                               | 1 258                            | 0,08                      | 6,875 % éch. 01/02/2031            | 4 775                               | 4 642                            | 0,30                      | WBI Operating LLC                                                                     |                                     |                                  |                           |
| SS&C Technologies, Inc.                  |                                     |                                  |                           | Under Armour, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 15/10/2030                                                               | 1 525                               | 1 534                            | 0,10                      |
| 6,500 % éch. 01/06/2032                  | 2 725                               | 2 750                            | 0,18                      | 7,250 % éch. 15/07/2030            | 825                                 | 833                              | 0,05                      | Weatherford International Ltd.                                                        |                                     |                                  |                           |
| Stagwell Global LLC                      |                                     |                                  |                           | United Rentals North America, Inc. |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/10/2033                                                               | 6 275                               | 6 406                            | 0,42                      |
| 5,625 % éch. 15/08/2029                  | 5 100                               | 4 923                            | 0,32                      | 3,750 % éch. 15/01/2032            | 2 200                               | 2 041                            | 0,13                      | Whirlpool Corp.                                                                       |                                     |                                  |                           |
| Staples, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/02/2031            | 250                                 | 236                              | 0,02                      | 6,125 % éch. 15/06/2030                                                               | 275                                 | 254                              | 0,02                      |
| 10,750 % éch. 01/09/2029                 | 2 675                               | 2 554                            | 0,17                      | 5,375 % éch. 15/11/2033            | 1 925                               | 1 897                            | 0,12                      | 6,500 % éch. 15/06/2033                                                               | 825                                 | 716                              | 0,05                      |
| Star Parent, Inc.                        |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/03/2034            | 2 475                               | 2 540                            | 0,17                      | White Cap Supply Holdings LLC                                                         |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 01/10/2030                  | 1 400                               | 1 467                            | 0,10                      | Uniti Services LLC                 |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 15/11/2030                                                               | 1 625                               | 1 649                            | 0,11                      |
| Station Casinos LLC                      |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/10/2033            | 1 300                               | 1 369                            | 0,09                      | Wildfire Intermediate Holdings LLC                                                    |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/02/2028                  | 3 100                               | 3 066                            | 0,20                      | Universal Entertainment Corp.      |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 15/10/2029                                                               | 700                                 | 718                              | 0,05                      |
| 6,625 % éch. 15/03/2032                  | 1 825                               | 1 854                            | 0,12                      | 9,875 % éch. 01/08/2029            | 450                                 | 435                              | 0,03                      | Williams Scotsman, Inc.                                                               |                                     |                                  |                           |
| Stonepeak Nile Parent LLC                |                                     |                                  |                           | Univision Communications, Inc.     |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/06/2029                                                               | 400                                 | 409                              | 0,03                      |
| 7,250 % éch. 15/03/2032                  | 1 100                               | 1 140                            | 0,07                      | 8,500 % éch. 31/07/2031            | 600                                 | 603                              | 0,04                      | Windstream Services LLC                                                               |                                     |                                  |                           |
| Sunoco LP                                |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 15/04/2033            | 4 125                               | 4 064                            | 0,27                      | 8,250 % éch. 01/10/2031                                                               | 3 200                               | 3 376                            | 0,22                      |
| 4,500 % éch. 15/05/2029                  | 200                                 | 196                              | 0,01                      | 9,375 % éch. 01/08/2032            | 3 325                               | 3 381                            | 0,22                      | WR Grace Holdings LLC                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 01/10/2029                  | 250                                 | 243                              | 0,02                      | Valaris Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/08/2029                                                               | 225                                 | 212                              | 0,01                      |
| 5,625 % éch. 15/03/2031                  | 1 800                               | 1 788                            | 0,12                      | 8,375 % éch. 30/04/2030            | 5 025                               | 5 221                            | 0,34                      | 6,625 % éch. 15/08/2032                                                               | 2 925                               | 2 839                            | 0,19                      |
| 6,250 % éch. 01/07/2033                  | 2 400                               | 2 423                            | 0,16                      | Valvoline, Inc.                    |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 01/08/2033                                                               | 900                                 | 877                              | 0,06                      |
| 6,625 % éch. 15/08/2032                  | 325                                 | 331                              | 0,02                      | 3,625 % éch. 15/06/2031            | 550                                 | 508                              | 0,03                      | Wyndham Hotels & Resorts, Inc.                                                        |                                     |                                  |                           |
| 7,000 % éch. 01/05/2029                  | 1 300                               | 1 336                            | 0,09                      | Venture Global Calcasieu Pass LLC  |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/08/2028                                                               | 2 975                               | 2 934                            | 0,19                      |
| Surgery Center Holdings, Inc.            |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/08/2031            | 3 125                               | 2 935                            | 0,19                      | Wynn Las Vegas LLC                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 15/04/2032                  | 1 150                               | 1 166                            | 0,08                      | 6,000 % éch. 01/05/2036            | 5 225                               | 5 284                            | 0,35                      | 5,250 % éch. 15/05/2027                                                               | 8 050                               | 8 051                            | 0,53                      |
| SV RNO Property Owner LLC                |                                     |                                  |                           | Venture Global LNG, Inc.           |                                     |                                  |                           | Wynn Resorts Finance LLC                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 01/03/2031                  | 1 025                               | 1 011                            | 0,07                      | 6,375 % éch. 15/12/2034            | 150                                 | 148                              | 0,01                      | 7,125 % éch. 15/02/2031                                                               | 3 250                               | 3 436                            | 0,23                      |
| Sword Purchaser LLC                      |                                     |                                  |                           | 6,625 % éch. 15/06/2036            | 100                                 | 99                               | 0,01                      | XPLR Infrastructure Operating Partners LP                                             |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/04/2033                  | 750                                 | 777                              | 0,05                      | 7,000 % éch. 15/01/2030            | 2 143                               | 2 187                            | 0,14                      | 8,625 % éch. 15/03/2033                                                               | 1 175                               | 1 260                            | 0,08                      |
| 10,500 % éch. 15/04/2034                 | 400                                 | 419                              | 0,03                      | 8,375 % éch. 01/06/2031            | 8 231                               | 8 571                            | 0,56                      | Yum! Brands, Inc.                                                                     |                                     |                                  |                           |
| Synergy Infrastructure Holdings LLC      |                                     |                                  |                           | 9,500 % éch. 01/02/2029            | 4 125                               | 4 442                            | 0,29                      | 3,625 % éch. 15/03/2031                                                               | 2 000                               | 1 862                            | 0,12                      |
| 7,000 % éch. 15/07/2034                  | 750                                 | 761                              | 0,05                      | 9,875 % éch. 01/02/2032            | 600                                 | 641                              | 0,04                      | 4,625 % éch. 31/01/2032                                                               | 4 000                               | 3 829                            | 0,25                      |
| 7,875 % éch. 01/12/2030                  | 600                                 | 629                              | 0,04                      | Venture Global Plaquemines LNG LLC |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 15/11/2037                                                               | 1 000                               | 1 086                            | 0,07                      |
| Talos Production, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 15/12/2030            | 4 775                               | 4 888                            | 0,32                      | Zayo Group Holdings, Inc. (5,750 % en numéraire et 3,500 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 9,000 % éch. 01/02/2029                  | 750                                 | 782                              | 0,05                      | 6,500 % éch. 15/01/2034            | 2 475                               | 2 580                            | 0,17                      | 9,250 % éch. 09/03/2030 (b)                                                           | 820                                 | 820                              | 0,05                      |
| Teleflex, Inc.                           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 15/06/2034            | 3 500                               | 3 648                            | 0,24                      | Zayo Group Holdings, Inc. (7,125 % en numéraire et 6,625 % de rémunération en nature) |                                     |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/01/2032                  | 675                                 | 681                              | 0,04                      | 6,750 % éch. 15/01/2036            | 642                                 | 681                              | 0,04                      | 13,750 % éch. 09/09/2030 (b)                                                          | 3 659                               | 3 619                            | 0,24                      |
| Tenet Healthcare Corp.                   |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/05/2033            | 550                                 | 604                              | 0,04                      | Zebra Technologies Corp.                                                              |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 15/11/2032                  | 25                                  | 25                               | 0,00                      | Veritiv Operating Co.              |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/06/2032                                                               | 1 650                               | 1 671                            | 0,11                      |
| 6,750 % éch. 15/05/2031                  | 375                                 | 384                              | 0,03                      | 10,500 % éch. 30/11/2030           | 1 200                               | 1 229                            | 0,08                      | ZF North America Capital, Inc.                                                        |                                     |                                  |                           |
| Tenneco, Inc.                            |                                     |                                  |                           | Versant Media Group, Inc.          |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 23/04/2030                                                               | 4 550                               | 4 516                            | 0,30                      |
| 8,000 % éch. 17/11/2028                  | 300                                 | 302                              | 0,02                      | 7,250 % éch. 30/01/2031            | 2 050                               | 2 122                            | 0,14                      | 7,500 % éch. 24/03/2031                                                               | 2 625                               | 2 645                            | 0,17                      |
| TGS ASA                                  |                                     |                                  |                           | Vertiv Group Corp.                 |                                     |                                  |                           | Ziggo BV                                                                              |                                     |                                  |                           |
| 8,500 % éch. 15/01/2030                  | 3 875                               | 4 075                            | 0,27                      | 4,125 % éch. 15/11/2028            | 4 900                               | 4 855                            | 0,32                      | 4,875 % éch. 15/01/2030                                                               | 4 700                               | 4 415                            | 0,29                      |
| Tidewater, Inc.                          |                                     |                                  |                           | VF Corp.                           |                                     |                                  |                           | ZipRecruiter, Inc.                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 9,125 % éch. 15/07/2030                  | 1 400                               | 1 499                            | 0,10                      | 2,950 % éch. 23/04/2030            | 1 387                               | 1 265                            | 0,08                      | 5,000 % éch. 15/01/2030                                                               | 675                                 | 525                              | 0,03                      |
| TK Elevator U.S. Newco, Inc.             |                                     |                                  |                           | Viacom, Inc.                       |                                     |                                  |                           | ZoomInfo Technologies LLC                                                             |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 15/07/2027                  | 559                                 | 559                              | 0,04                      | 4,375 % éch. 15/03/2043            | 275                                 | 178                              | 0,01                      | 3,875 % éch. 01/02/2029                                                               | 725                                 | 590                              | 0,04                      |
|                                          |                                     |                                  |                           | Viavi Solutions, Inc.              |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 01/10/2029            | 350                                 | 334                              | 0,02                      |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           | </                                 |                                     |                                  |                           |                                                                                       |                                     |                                  |                           |



| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | ACTIONS   | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITES</b>       |                                     |                                  |                           | <b>BONS DE SOUSCRIPTION</b>             |                                     |                                  |                           | <b>TITRES PRIVILEGIES</b>                |           |                                  |                           |
| AES Corp.                               |                                     |                                  |                           | PG&E Corp.                              |                                     |                                  |                           | Revlon Group Holdings LLC -Exp.          |           |                                  |                           |
| 7,600 % éch. 15/01/2055                 | \$ 2 700                            | \$ 2 772                         | 0,18                      | 6,850 % éch. 15/09/2056                 | \$ 3 610                            | \$ 3 599                         | 0,24                      | 28/04/2028                               | 30 870    | \$ 0                             | 0,00                      |
| Aethon United BR LP                     |                                     |                                  |                           | PR RNO Property Owner LLC               |                                     |                                  |                           | Spirit Aviation Holdings, Inc. -         |           |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 01/10/2029                 | 1 100                               | 1 144                            | 0,08                      | 6,500 % éch. 01/05/2031                 | 5 650                               | 5 646                            | 0,37                      | Exp. 11/03/2035                          | 71 078    | 2                                | 0,00                      |
| AmeriGas Partners LP                    |                                     |                                  |                           | Puget Energy, Inc.                      |                                     |                                  |                           |                                          |           | 2                                | 0,00                      |
| 6,875 % éch. 01/06/2031                 | 1 075                               | 1 089                            | 0,07                      | 7,000 % éch. 15/09/2056                 | 1 875                               | 1 898                            | 0,12                      |                                          |           | 2                                | 0,00                      |
| Antero Midstream Partners LP            |                                     |                                  |                           | 7,250 % éch. 15/09/2056                 | 850                                 | 868                              | 0,06                      |                                          |           |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/01/2028                 | 275                                 | 275                              | 0,02                      | Talen Energy Supply LLC                 |                                     |                                  |                           | <b>INSTRUMENTS A COURT TERME</b>         |           |                                  |                           |
| Clearway Energy Operating LLC           |                                     |                                  |                           | 6,500 % éch. 01/02/2036                 | 3 450                               | 3 480                            | 0,23                      | <b>BILLETS A COURT TERME</b>             |           |                                  |                           |
| 3,750 % éch. 15/02/2031                 | 3 300                               | 3 062                            | 0,20                      | Tallgrass Energy Partners LP            |                                     |                                  |                           | Discovery Global Holdings, Inc.          |           |                                  |                           |
| ContourGlobal Power Holdings S.A.       |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 15/01/2028                 | 825                                 | 824                              | 0,05                      | 3,755 % éch. 15/03/2027                  | \$ 1 150  | 1 143                            | 0,07                      |
| 6,750 % éch. 28/02/2030                 | 1 475                               | 1 499                            | 0,10                      | 6,000 % éch. 01/09/2031                 | 125                                 | 124                              | 0,01                      | Kona Spc Ltd.                            |           |                                  |                           |
| Edison International                    |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 15/03/2034                 | 450                                 | 455                              | 0,03                      | 5,718 % éch. 15/09/2026                  | € 1 000   | 1 144                            | 0,08                      |
| 8,125 % éch. 15/06/2053                 | 1 500                               | 1 542                            | 0,10                      | Telecom Italia SpA                      |                                     |                                  |                           | Total des Instruments à court terme      |           | 2 287                            | 0,15                      |
| Electricité de France S.A.              |                                     |                                  |                           | 7,875 % éch. 31/07/2028                 | € 200                               | 247                              | 0,02                      |                                          |           |                                  |                           |
| 9,125 % éch. 15/03/2033 (e)             | 2 075                               | 2 410                            | 0,16                      | TerraForm Power Operating LLC           |                                     |                                  |                           | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b> |           |                                  |                           |
| Emera U.S. Finance LLC                  |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 31/01/2028                 | \$ 2 325                            | 2 312                            | 0,15                      | PIMCO Funds: Global Investors            |           |                                  |                           |
| 6,650 % éch. 01/10/2056                 | 1 450                               | 1 469                            | 0,10                      | TXNM Energy, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Series plc - Fonds PIMCO                 |           |                                  |                           |
| 6,850 % éch. 01/10/2056                 | 750                                 | 768                              | 0,05                      | 7,000 % éch. 31/07/2056                 | 2 125                               | 2 149                            | 0,14                      | European High Yield Bond                 |           |                                  |                           |
| Genesis Energy LP                       |                                     |                                  |                           | Uniti Group LP                          |                                     |                                  |                           | Fund (f)                                 | 1 743 573 | 26 612                           | 1,75                      |
| 6,750 % éch. 15/03/2034                 | 1 975                               | 1 961                            | 0,13                      | 6,500 % éch. 15/02/2029                 | 2 025                               | 2 011                            | 0,13                      | PIMCO Funds: Global Investors            |           |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 15/05/2032                 | 1 400                               | 1 444                            | 0,09                      | 8,625 % éch. 15/06/2032                 | 3 475                               | 3 628                            | 0,24                      | Series plc - Fonds Global                |           |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 15/05/2033                 | 1 625                               | 1 691                            | 0,11                      | Veon Midco BV                           |                                     |                                  |                           | High Yield Bond ESG                      |           |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 15/01/2029                 | 2 125                               | 2 195                            | 0,14                      | 3,375 % éch. 25/11/2027                 | 282                                 | 276                              | 0,02                      | Fund (f)                                 | 423 897   | 4 905                            | 0,32                      |
| 8,875 % éch. 15/04/2030                 | 300                                 | 314                              | 0,02                      | VoltaGrid LLC                           |                                     |                                  |                           | PIMCO Select Funds plc - Fonds           |           |                                  |                           |
| High Ridge Brands Co.                   |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 01/11/2030                 | 625                                 | 649                              | 0,04                      | PIMCO US Dollar Short-Term               |           |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 15/03/2025 ^               | 2 500                               | 41                               | 0,00                      |                                         |                                     |                                  |                           | Floating NAV Fund (f)                    | 5 499     | 55                               | 0,00                      |
| Hilcorp Energy LP                       |                                     |                                  |                           |                                         |                                     | 74 203                           | 4,87                      |                                          |           | 31 572                           | 2,07                      |
| 6,000 % éch. 15/04/2030                 | 600                                 | 591                              | 0,04                      | Total des Obligations et billets privés |                                     | 1 317 922                        | 86,49                     | <b>FONDS NEGOCIES EN BOURSE</b>          |           |                                  |                           |
| 6,000 % éch. 01/02/2031                 | 200                                 | 194                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS DU TRESOR AMERICAIN</b>  |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO             |           |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 01/11/2028                 | 1 675                               | 1 680                            | 0,11                      | <b>BILLETS DU TRESOR AMERICAIN</b>      |                                     |                                  |                           | US Dollar Short Maturity                 |           |                                  |                           |
| 8,375 % éch. 01/11/2033                 | 650                                 | 677                              | 0,04                      | <b>BILLETS DU TRESOR AMERICAIN</b>      |                                     |                                  |                           | UCITS ETF (f)                            | 165 934   | 16 673                           | 1,09                      |
| Leeward Renewable Energy Operations LLC |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 28/02/2031                 | 15 825                              | 15 361                           | 1,01                      |                                          |           |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 01/07/2029                 | 282                                 | 269                              | 0,02                      | 4,000 % éch. 31/07/2032                 | 2 050                               | 2 021                            | 0,13                      | Total des Fonds d'investissement         |           | \$ 48 245                        | 3,16                      |
| Lumen Technologies, Inc.                |                                     |                                  |                           | 4,125 % éch. 15/02/2036                 | 390                                 | 380                              | 0,03                      |                                          |           |                                  |                           |
| 7,600 % éch. 15/09/2039                 | 575                                 | 550                              | 0,04                      |                                         |                                     | 17 762                           | 1,17                      |                                          |           |                                  |                           |
| NGL Energy Operating LLC                |                                     |                                  |                           | <b>ACTIONS</b>                          |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 8,125 % éch. 15/02/2029                 | 1 775                               | 1 838                            | 0,12                      | <b>ACTIONS ORDINAIRES</b>               |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| NRG Energy, Inc.                        |                                     |                                  |                           | <b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>        |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 3,375 % éch. 15/02/2029                 | 1 325                               | 1 264                            | 0,08                      | <b>INDUSTRIE</b>                        |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 3,625 % éch. 15/02/2031                 | 1 075                               | 999                              | 0,07                      | <b>CHC Group LLC (c)</b>                |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/01/2028                 | 425                                 | 425                              | 0,03                      | Clear Channel Outdoor Holdings,         |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 15/07/2029                 | 3 900                               | 3 906                            | 0,26                      | Inc. (c)                                |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 5,875 % éch. 15/05/2034                 | 2 525                               | 2 513                            | 0,16                      | 167 378                                 |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 15/05/2036                 | 1 850                               | 1 852                            | 0,12                      | 405                                     |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| Pattern Energy Operations LP            |                                     |                                  |                           | 0,03                                    |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 4,500 % éch. 15/08/2028                 | 1 050                               | 1 029                            | 0,07                      | <b>INDUSTRIE</b>                        |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| PBF Holding Co. LLC                     |                                     |                                  |                           | <b>CHC Group LLC (c)</b>                |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 7,250 % éch. 01/06/2034                 | 425                                 | 421                              | 0,03                      | DreamWell Ltd. (c)(g)                   |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 15/09/2030                 | 925                                 | 943                              | 0,06                      | 926                                     |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
| 9,875 % éch. 15/03/2030                 | 3 000                               | 3 210                            | 0,21                      | Spirit Aviation Holdings, Inc. (c)      |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 234 400                                 |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | SSB Manufacturing Co. (c)(g)            |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 926                                     |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 0                                       |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 13                                      |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 418                                     |                                     |                                  |                           |                                          |           |                                  |                           |

## CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie                          | Taux<br>prêteur | Date de<br>règlement | Date<br>d'échéance | Montant<br>du principal | Garanti par                                                                       | Garantie<br>(reçue) | Contrats de mise<br>en pension, à<br>la valeur | Produits<br>des Contrats<br>de mise en<br>pension<br>à recevoir <sup>(1)</sup> | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| BRC                                   | 3,720 %         | 30/06/2026           | 01/07/2026         | \$ 68 500               | Titres du Trésor américain protégés contre<br>l'inflation 1,625 % éch. 15/04/2030 | \$ (69 814)         | \$ 68 500                                      | \$ 68 507                                                                      | 4,49                   |
| FICC                                  | 3,640           | 30/06/2026           | 01/07/2026         | 10 300                  | Billets du Trésor américain 0,125 %<br>éch. 15/07/2031                            | (10 506)            | 10 300                                         | 10 301                                                                         | 0,68                   |
| Total des Contrats de mise en pension |                 |                      |                    |                         |                                                                                   | \$ (80 320)         | \$ 78 800                                      | \$ 78 808                                                                      | 5,17                   |

(1) Comprend les intérêts courus.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

## CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                     | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre       | Court | 09/2026              | 88                    | \$ (135)                                | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre  | Long  | 09/2026              | 396                   | (61)                                    | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre  | Long  | 09/2026              | 785                   | 170                                     | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre | Long  | 09/2026              | 1 309                 | 956                                     | 0,06                   |

## Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 242                | \$ 161                            | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Court | 09/2026           | 12                 | (33)                              | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026           | 83                 | 281                               | 0,02                |
|                                                                                               |       |                   |                    | <b>\$ 1 339</b>                   | <b>0,09</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | <b>\$ 1 339</b>                   | <b>0,09</b>         |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence             | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Charter Communications, Inc.    | 5,000 %              | 20/12/2030      | \$ 925                           | \$ (12)                           | 0,00                |
| Discovery Global Holdings, Inc. | 1,000                | 20/12/2026      | 800                              | 5                                 | 0,00                |
| Telecom Italia SpA              | 1,000                | 20/12/2029      | € 800                            | 48                                | 0,00                |
|                                 |                      |                 |                                  | <b>\$ 41</b>                      | <b>0,00</b>         |

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-45 Index à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | \$ 22 369                        | \$ 741                            | 0,05                |
| Indice CDX.HY-46 Index à 5 ans | 5,000                | 20/06/2031      | 110 167                          | 943                               | 0,06                |
|                                |                      |                 |                                  | <b>\$ 1 684</b>                   | <b>0,11</b>         |

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 %   | 19/03/2032      | \$ 2 900          | \$ (38)                           | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250     | 18/06/2055      | 4 075             | 203                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,325     | 31/08/2030      | 19 790            | 353                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2029      | 31 150            | 1 184                             | 0,08                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2031      | 2 850             | 142                               | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750     | 18/12/2033      | 18 475            | 229                               | 0,02                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,916     | 15/11/2053      | 15 250            | 736                               | 0,05                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,998     | 15/11/2053      | 327               | 11                                | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 30/11/2030      | 6 600             | (24)                              | 0,00                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,083     | 15/11/2053      | 500               | 11                                | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | <b>\$ 2 807</b>                   | <b>0,19</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | <b>\$ 4 532</b>                   | <b>0,30</b>         |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD 78          | \$ 56             | \$ 2               | \$ 0                  | \$ 2                                    | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | \$ 3 241        | € 2 855           | 23                 | 0                     | 23                                      | 0,00                |
| CBK          | 07/2026           | € 3 003         | \$ 3 448          | 14                 | 0                     | 14                                      | 0,00                |
| JPM          | 07/2026           | AUD 337         | 240               | 7                  | 0                     | 7                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | £ 76            | 102               | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| MBC          | 07/2026           | AUD 1           | 1                 | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 3 983         | 4 625             | 71                 | 0                     | 71                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | \$ 158          | AUD 230           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 230         | \$ 158            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 870          | € 762             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
| MYI          | 07/2026           | 108             | 95                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
|              | 07/2026           | \$ 83           | £ 62              | \$ 0               | \$ 0                  | \$ 0                                    | 0,00                |
| SOG          | 07/2026           | € 33 354        | \$ 38 909         | 775                | 0                     | 775                                     | 0,05                |
|              | 07/2026           | \$ 129          | AUD 186           | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 42 643          | € 37 485          | 217                | (2)                   | 215                                     | 0,01                |
|              | 08/2026           | AUD 186         | \$ 128            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 37 384        | 42 581            | 0                  | (216)                 | (216)                                   | (0,01)              |
| SSB          | 07/2026           | \$ 100          | £ 76              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 76            | \$ 100            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 1 114           | \$ (220)              | \$ 894                                  | 0,06                |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | \$ 1 516        | € 1 302           | \$ 0               | \$ (27)               | \$ (27)                                 | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | € 11 450        | \$ 13 040         | 0                  | (51)                  | (51)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 176 845      | € 151 903         | 13                 | (3 188)               | (3 175)                                 | (0,21)              |
| CBK          | 07/2026           | 427             | 366               | 0                  | (8)                   | (8)                                     | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 140 534       | \$ 160 279        | 0                  | (394)                 | (394)                                   | (0,03)              |
|              | 08/2026           | \$ 160 495      | € 140 534         | 393                | 0                     | 393                                     | 0,03                |
| MBC          | 07/2026           | € 154 573       | \$ 175 677        | 65                 | (1 112)               | (1 047)                                 | (0,07)              |
|              | 07/2026           | \$ 9 678        | € 8 351           | 0                  | (130)                 | (130)                                   | (0,01)              |
|              | 08/2026           | 182 299         | 160 238           | 1 148              | 0                     | 1 148                                   | 0,07                |
| SCX          | 07/2026           | 160 553         | 138 000           | 0                  | (2 778)               | (2 778)                                 | (0,18)              |
| SOG          | 07/2026           | € 148 313       | \$ 168 706        | 0                  | (860)                 | (860)                                   | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$ 171 038      | € 146 620         | 0                  | (3 407)               | (3 407)                                 | (0,22)              |
|              | 08/2026           | 168 935         | 148 313           | 858                | 0                     | 858                                     | 0,06                |
| SSB          | 07/2026           | 9 494           | 8 328             | 27                 | 0                     | 27                                      | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 8 328         | \$ 9 507          | 0                  | (27)                  | (27)                                    | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 504           | \$ (11 982)           | \$ (9 478)                              | (0,62)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$ 6 092        | £ 4 538           | \$ 0               | \$ (69)               | \$ (69)                                 | (0,01)              |
| BOA                                                | 07/2026           | 313             | 234               | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | £ 4 709         | \$ 6 210          | 0                  | (40)                  | (40)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 6 936        | £ 5 176           | 0                  | (66)                  | (66)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | £ 27            | \$ 36             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 6 208        | £ 4 707           | 40                 | 0                     | 40                                      | 0,00                |
| CBK                                                | 07/2026           | 1 992           | 1 485             | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | 331             | 246               | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           | 6 561           | 4 890             | 0                  | (71)                  | (71)                                    | (0,01)              |
| MYI                                                | 07/2026           | 98              | 73                | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £ 1 109         | \$ 1 460          | 0                  | (13)                  | (13)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 1 460        | £ 1 109           | 12                 | 0                     | 12                                      | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | £ 5 476         | \$ 7 248          | 0                  | (20)                  | (20)                                    | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 233          | £ 174             | 0                  | (3)                   | (3)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 7 248           | 5 476             | 20                 | 0                     | 20                                      | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | £ 5 451         | \$ 7 200          | 0                  | (34)                  | (34)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 7 200        | £ 5 451           | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,00                |
| SSB                                                | 07/2026           | £ 71            | \$ 94             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 94           | £ 71              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 106             | \$ (345)              | \$ (239)                                | (0,02)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ (8 823)                              | (0,58)              |
| Total des Investissements                          |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 1 503 126                            | 98,64               |
| Autres actifs et passifs à court terme             |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 20 648                               | 1,36                |
| Actif net                                          |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 1 523 774                            | 100,00              |

## NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

μ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

## Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

- (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (d) Titre à coupon zéro.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,03 %) :

| Description de l'émetteur     | Date d'achat | Coût            | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-------------------------------|--------------|-----------------|--------------|---------------------|
| Clover Holdings, Inc. 0,000 % | 09/12/2024   | \$ 33           | \$ 42        | 0,00                |
| DreamWell Ltd.                | 24/04/2024   | 1 316           | 8            | 0,00                |
| SSB Manufacturing Co.         | 29/06/2023   | 1 317           | 0            | 0,00                |
|                               |              | <b>\$ 2 666</b> | <b>\$ 50</b> | <b>0,00</b>         |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 9 413 \$ (31 décembre 2025 : 23 009 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 22 508 \$ (31 décembre 2025 : 23 115 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 9 170 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 410                                                                            | \$ 1 377 386                                         | \$ 1 237                                          | \$ 1 379 033        |
| Fonds d'investissement                        | 48 245                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 48 245              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 78 800                                               | 0                                                 | 78 800              |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (135)                                                                             | (2 817)                                              | 0                                                 | (2 952)             |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 48 520</b>                                                                  | <b>\$ 1 453 369</b>                                  | <b>\$ 1 237</b>                                   | <b>\$ 1 503 126</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 373                                                                            | \$ 1 500 863                                         | \$ 2 197                                          | \$ 1 503 433        |
| Fonds d'investissement                        | 54 131                                                                            | 0                                                    | 0                                                 | 54 131              |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 175 900                                              | 0                                                 | 175 900             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 180                                                                               | 5 819                                                | 0                                                 | 5 999               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 54 684</b>                                                                  | <b>\$ 1 682 582</b>                                  | <b>\$ 2 197</b>                                   | <b>\$ 1 739 463</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BRC                                           | 2,200 %        | 22/06/2026        | 31/07/2026         | \$ (2 727)       | \$ (2 728)                               | (0,18)              |
| MYI                                           | 2,150          | 17/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 480)          | (2 483)                                  | (0,16)              |
|                                               | 3,150          | 09/06/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (2 611)          | (2 616)                                  | (0,17)              |
|                                               | 3,450          | 12/12/2025        | 11/12/2027         | (692)            | (705)                                    | (0,05)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                    |                  | <b>\$ (8 532)</b>                        | <b>(0,56)</b>       |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

## Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (67)                                                    | \$ 0                    | \$ (67)                           | \$ 141                                                     | \$ 0                    | \$ 141                            |
| BOA          | (30)                                                       | 0                       | (30)                              | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| BPS          | (3 269)                                                    | 3 480                   | 211                               | 8                                                          | 0                       | 8                                 |
| BRC          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 1 767                                                      | (1 970)                 | (203)                             |
| CBK          | (15)                                                       | 0                       | (15)                              | (120)                                                      | 0                       | (120)                             |
| FAR          | (5)                                                        | 0                       | (5)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | (63)                                                       | 0                       | (63)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| MBC          | 44                                                         | 0                       | 44                                | 1 727                                                      | (2 010)                 | (283)                             |
| MYI          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 0                                                          | (10)                    | (10)                              |
| NSL          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | (2 781)                                                    | 2 980                   | 199                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| SOG          | (2 635)                                                    | 2 710                   | 75                                | 1 704                                                      | (1 780)                 | (76)                              |
| SSB          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 12                                                         | 0                       | 12                                |
| UAG          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 9                                                          | 0                       | 9                                 |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

## Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 9,09             | 9,82                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 77,40            | 73,12                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 0,34             | 0,09                 |
| Fonds d'investissement                                           | 3,04             | 2,99                 |
| Contrats de mise en pension                                      | 4,96             | 9,71                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,10             | 0,01                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,29             | 0,08                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,23             | 0,33                 |
| Autres actifs                                                    | 4,55             | 3,85                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                          | 2,66             | 4,46                 |
| Obligations et billets privés                                                                            | 86,49            | 81,03                |
| Obligations du Trésor américain                                                                          | 1,17             | 1,02                 |
| Actions ordinaires                                                                                       | 0,03             | 0,05                 |
| Bons de souscription                                                                                     | 0,00             | 0,00                 |
| Titres privilégiés                                                                                       | 0,00             | 0,00                 |
| Instruments à court terme                                                                                | 0,15             | 0,07                 |
| Fonds d'investissement                                                                                   | 3,16             | 3,12                 |
| Contrats de mise en pension                                                                              | 5,17             | 10,13                |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                         |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                            | 0,09             | (0,02)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,11             | 0,03                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,19             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,06             | (0,03)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,64)           | 0,33                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | 1,36             | (0,22)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |

# Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VALEURS MOBILIÈRES</b>               |                                     |                                  |                           | <b>BPCE S.A.</b>                                 |                                     |                                  |                           | <b>5,918 % éch. 20/03/2028</b>              |                                     |                                  |                           |
| <b>CÉRÉTIÉS CONSORTIAUX ET CESSIONS</b> |                                     |                                  |                           | <b>5,417 % éch. 13/01/2037</b>                   |                                     |                                  |                           | <b>6,798 % éch. 07/11/2028</b>              |                                     |                                  |                           |
| Discovery Global Holdings, Inc.         |                                     |                                  |                           | 5,716 % éch. 18/01/2030                          | \$ 500                              | \$ 490                           | 0,11                      | 7,350 % éch. 04/11/2027                     | \$ 300                              | \$ 304                           | 0,07                      |
| 6,144 % éch. 03/06/2033                 | \$ 1 079                            | \$ 1 080                         | 0,24                      | 5,936 % éch. 30/05/2035                          | 250                                 | 255                              | 0,06                      | FS KKR Capital Corp.                        | 400                                 | 413                              | 0,09                      |
| République du Panama                    |                                     |                                  |                           | 6,612 % éch. 19/10/2027                          | 650                                 | 667                              | 0,15                      | 7,875 % éch. 15/01/2029                     | 700                                 | 719                              | 0,16                      |
| 3,886 % éch. 05/03/2027                 | € 800                               | 916                              | 0,21                      | 7,003 % éch. 19/10/2034                          | 200                                 | 201                              | 0,05                      | FTAI Aviation Investors LLC                 |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     | 1 996                            | 0,45                      | Brookfield Finance, Inc.                         | 250                                 | 272                              | 0,06                      | 7,875 % éch. 01/12/2030                     | 300                                 | 314                              | 0,07                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>    |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 30/03/2051                          | 400                                 | 273                              | 0,06                      | GA Global Funding Trust                     |                                     |                                  |                           |
| <b>BANQUE ET FINANCE</b>                |                                     |                                  |                           | 5,330 % éch. 15/01/2036                          | 100                                 | 98                               | 0,02                      | 4,500 % éch. 18/09/2030                     | 150                                 | 145                              | 0,03                      |
| AerCap Ireland Capital DAC              |                                     |                                  |                           | CaixaBank S.A.                                   |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 13/01/2030                     | 400                                 | 402                              | 0,09                      |
| 3,000 % éch. 29/10/2028                 | \$ 1 100                            | 1 059                            | 0,24                      | 5,801 % éch. 26/05/2031                          | AUD 800                             | 564                              | 0,13                      | Gaci First Investment Co.                   |                                     |                                  |                           |
| 3,400 % éch. 29/10/2033                 | 500                                 | 445                              | 0,10                      | Cantor Fitzgerald LP                             |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 14/05/2029                     | 900                                 | 897                              | 0,20                      |
| Aircastle Ltd.                          |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 12/12/2028                          | \$ 300                              | 312                              | 0,07                      | 5,125 % éch. 14/02/2053                     | 600                                 | 518                              | 0,12                      |
| 2,850 % éch. 26/01/2028                 | 300                                 | 291                              | 0,07                      | Capital One Financial Corp.                      |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 14/05/2056                     | 600                                 | 601                              | 0,14                      |
| 5,950 % éch. 15/02/2029                 | 500                                 | 512                              | 0,11                      | 4,722 % éch. 30/01/2032                          | 600                                 | 592                              | 0,13                      | Global Atlantic Fin Co.                     |                                     |                                  |                           |
| 6,500 % éch. 18/07/2028                 | 500                                 | 515                              | 0,12                      | 7,964 % éch. 02/11/2034                          | 300                                 | 345                              | 0,08                      | 4,400 % éch. 15/10/2029                     | 800                                 | 777                              | 0,17                      |
| Akellus Residential Property AB         |                                     |                                  |                           | CBRE Services, Inc.                              |                                     |                                  |                           | GLP Capital LP                              |                                     |                                  |                           |
| 3,950 % éch. 25/03/2031                 | € 1 300                             | 1 488                            | 0,33                      | 4,800 % éch. 15/06/2030                          | 200                                 | 200                              | 0,04                      | 3,250 % éch. 15/01/2032                     | 700                                 | 627                              | 0,14                      |
| Ally Financial, Inc.                    |                                     |                                  |                           | CI Financial Corp.                               |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/01/2031                     | 300                                 | 284                              | 0,06                      |
| 6,184 % éch. 26/07/2035                 | \$ 470                              | 478                              | 0,11                      | 4,750 % éch. 03/04/2028                          | CAD 500                             | 357                              | 0,08                      | 5,625 % éch. 15/09/2034                     | 700                                 | 695                              | 0,16                      |
| 6,992 % éch. 13/06/2029                 | 470                                 | 487                              | 0,11                      | 6,000 % éch. 20/09/2027                          | 300                                 | 217                              | 0,05                      | 5,750 % éch. 01/06/2028                     | 700                                 | 708                              | 0,16                      |
| American Tower Corp.                    |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 30/05/2029                          | \$ 200                              | 210                              | 0,05                      | 6,250 % éch. 15/09/2054                     | 600                                 | 603                              | 0,14                      |
| 2,750 % éch. 15/01/2027                 | 1 700                               | 1 684                            | 0,38                      | Citadel Finance LLC                              |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| 3,650 % éch. 15/03/2027                 | 1 700                               | 1 691                            | 0,38                      | 4,750 % éch. 14/02/2029                          | 500                                 | 492                              | 0,11                      | 3,641 % éch. 05/03/2032 (e)                 | CAD 900                             | 630                              | 0,14                      |
| 5,650 % éch. 15/03/2033                 | 369                                 | 381                              | 0,09                      | Citibank N.A.                                    |                                     |                                  |                           | 4,369 % éch. 21/10/2031                     | \$ 1 100                            | 1 076                            | 0,24                      |
| Antares Holdings LP                     |                                     |                                  |                           | 5,570 % éch. 30/04/2034                          | 1 750                               | 1 814                            | 0,41                      | 4,516 % éch. 21/01/2032                     | 500                                 | 491                              | 0,11                      |
| 2,750 % éch. 15/01/2027                 | 1 600                               | 1 577                            | 0,35                      | Commerzbank AG                                   |                                     |                                  |                           | 5,016 % éch. 23/10/2035                     | 1 400                               | 1 376                            | 0,31                      |
| 6,500 % éch. 08/02/2029                 | 250                                 | 251                              | 0,06                      | 5,694 % éch. 12/06/2031                          | AUD 1 100                           | 771                              | 0,17                      | 5,330 % éch. 23/07/2035                     | 1 100                               | 1 104                            | 0,25                      |
| 6,625 % éch. 10/06/2031                 | 250                                 | 250                              | 0,06                      | Commonwealth Bank of Australia                   |                                     |                                  |                           | 6,484 % éch. 24/10/2029                     | 1 600                               | 1 660                            | 0,37                      |
| Ares Finance Co. LLC                    |                                     |                                  |                           | 3,784 % éch. 14/03/2032 (d)                      | \$ 400                              | 374                              | 0,08                      | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.         |                                     |                                  |                           |
| 4,125 % éch. 30/06/2051                 | 200                                 | 200                              | 0,04                      | Constellation Global Funding                     |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 29/04/2033                     | € 200                               | 229                              | 0,05                      |
| Ares Strategic Income Fund              |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 22/10/2030                          | 200                                 | 196                              | 0,04                      | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                                     |                                  |                           |
| 4,850 % éch. 15/01/2029                 | 300                                 | 294                              | 0,07                      | Cooperative Rabobank UA                          |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 01/07/2034                     | \$ 100                              | 102                              | 0,02                      |
| Asurion LLC                             |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 29/06/2027 (b)(d)                   | € 400                               | 461                              | 0,10                      | Highwoods Realty LP                         |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 31/12/2032                 | 600                                 | 605                              | 0,14                      | 5,447 % éch. 05/03/2030                          | \$ 200                              | 204                              | 0,05                      | 4,200 % éch. 15/04/2029                     | 200                                 | 196                              | 0,04                      |
| Aviva PLC                               |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/08/2033 (b)(d)                   | € 1 600                             | 1 860                            | 0,42                      | Host Hotels & Resorts LP                    |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 30/09/2032 (b)(d)          | £ 200                               | 279                              | 0,06                      | Corebridge Financial, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 15/09/2030                     | 700                                 | 662                              | 0,15                      |
| Avolon Holdings Funding Ltd.            |                                     |                                  |                           | 6,375 % éch. 15/09/2054                          | \$ 500                              | 497                              | 0,11                      | HPS Corporate Lending Fund                  |                                     |                                  |                           |
| 4,700 % éch. 30/01/2031                 | \$ 200                              | 197                              | 0,04                      | CPI Property Group S.A.                          |                                     |                                  |                           | 5,150 % éch. 02/04/2029                     | 1 000                               | 980                              | 0,22                      |
| Azule Energy Finance PLC                |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 05/02/2033                          | £ 625                               | 774                              | 0,17                      | HSBC Holdings PLC                           |                                     |                                  |                           |
| 8,250 % éch. 22/01/2031                 | 900                                 | 901                              | 0,20                      | Crédit Agricole Assurances S.A.                  |                                     |                                  |                           | 4,086 % éch. 12/05/2036                     | € 500                               | 581                              | 0,13                      |
| 8,625 % éch. 22/01/2033                 | 300                                 | 301                              | 0,07                      | 5,875 % éch. 17/06/2032 (b)(d)                   | € 2 000                             | 2 326                            | 0,52                      | 4,583 % éch. 19/06/2029                     | \$ 600                              | 598                              | 0,13                      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.    |                                     |                                  |                           | Crédit Agricole S.A.                             |                                     |                                  |                           | 6,597 % éch. 26/05/2037                     | AUD 1 700                           | 1 216                            | 0,27                      |
| 4,968 % éch. 08/05/2031                 | 1 000                               | 999                              | 0,22                      | 7,250 % éch. 23/09/2028 (b)(d)                   | 400                                 | 486                              | 0,11                      | 6,750 % éch. 18/11/2032 (b)(d)              | \$ 1 100                            | 1 108                            | 0,25                      |
| Banco Santander S.A.                    |                                     |                                  |                           | Crown Castle, Inc.                               |                                     |                                  |                           | 7,000 % éch. 24/09/2035 (b)(d)              | 1 500                               | 1 543                            | 0,35                      |
| 4,551 % éch. 06/11/2030                 | 800                                 | 787                              | 0,18                      | 3,100 % éch. 15/11/2029                          | \$ 900                              | 853                              | 0,19                      | Huntington Bancshares, Inc.                 |                                     |                                  |                           |
| 4,600 % éch. 15/04/2029                 | 1 200                               | 1 195                            | 0,27                      | CTP NV                                           |                                     |                                  |                           | 6,208 % éch. 21/08/2029                     | 400                                 | 412                              | 0,09                      |
| 5,565 % éch. 17/01/2030                 | 1 000                               | 1 025                            | 0,23                      | 3,375 % éch. 19/07/2030                          | € 600                               | 682                              | 0,15                      | ICPF Finance Pty. Ltd.                      |                                     |                                  |                           |
| 9,625 % éch. 21/11/2028 (b)(d)          | 400                                 | 436                              | 0,10                      | Deutsche Bank AG                                 |                                     |                                  |                           | 6,573 % éch. 07/11/2033                     | AUD 1 100                           | 786                              | 0,18                      |
| Bank Hapoalim B.M.                      |                                     |                                  |                           | 4,469 % éch. 10/12/2031                          | \$ 1 200                            | 1 180                            | 0,27                      | IIFL Finance Ltd.                           |                                     |                                  |                           |
| 4,722 % éch. 14/07/2029                 | 900                                 | 889                              | 0,20                      | 4,725 % éch. 06/02/2032                          | 800                                 | 789                              | 0,18                      | 7,600 % éch. 10/09/2029                     | \$ 700                              | 704                              | 0,16                      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.               |                                     |                                  |                           | 6,750 % éch. 30/10/2035 (b)(d)                   | € 1 000                             | 1 171                            | 0,26                      | Industrial Subordinated Trust 2.0           |                                     |                                  |                           |
| 3,197 % éch. 22/01/2032                 | € 1 000                             | 1 133                            | 0,25                      | EPR Properties                                   |                                     |                                  |                           | 6,550 % éch. 15/04/2036                     | 600                                 | 610                              | 0,14                      |
| Bank of America Corp.                   |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/06/2027                          | \$ 350                              | 349                              | 0,08                      | ING Groep NV                                |                                     |                                  |                           |
| 1,898 % éch. 23/07/2031                 | \$ 3 500                            | 3 122                            | 0,70                      | 4,750 % éch. 15/12/2026                          | 700                                 | 700                              | 0,16                      | 7,250 % éch. 16/11/2034 (b)(d)              | 700                                 | 736                              | 0,17                      |
| 5,288 % éch. 25/04/2034                 | 3 700                               | 3 750                            | 0,84                      | Equinix Europe Financing Corp. LLC               |                                     |                                  |                           | Intesa Sanpaolo SpA                         |                                     |                                  |                           |
| 5,872 % éch. 15/09/2034                 | 1 200                               | 1 255                            | 0,28                      | 4,000 % éch. 19/05/2034                          | € 400                               | 460                              | 0,10                      | 6,625 % éch. 20/06/2033                     | 200                                 | 217                              | 0,05                      |
| Barclays PLC                            |                                     |                                  |                           | Equinix, Inc.                                    |                                     |                                  |                           | 7,200 % éch. 28/11/2033                     | 200                                 | 225                              | 0,05                      |
| 4,219 % éch. 24/05/2030                 | 200                                 | 197                              | 0,04                      | Equitable Holdings, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 7,800 % éch. 28/11/2053                     | 900                                 | 1 087                            | 0,24                      |
| 4,972 % éch. 16/05/2029                 | 500                                 | 502                              | 0,11                      | 6,700 % éch. 28/03/2055                          | 600                                 | 618                              | 0,14                      | 8,248 % éch. 21/11/2033                     | 200                                 | 231                              | 0,05                      |
| 5,851 % éch. 21/03/2035                 | £ 1 300                             | 1 743                            | 0,39                      | Erste Group Bank AG                              |                                     |                                  |                           | JAB Holdings BV                             |                                     |                                  |                           |
| 8,000 % éch. 15/06/2032 (b)(d)          | AUD 1 250                           | 877                              | 0,20                      | 5,875 % éch. 15/04/2033 (b)(d)                   | € 1 000                             | 1 148                            | 0,26                      | 2,200 % éch. 23/11/2030                     | 535                                 | 480                              | 0,11                      |
| BGC Group, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 8,500 % éch. 15/10/2028 (b)(d)                   | 200                                 | 250                              | 0,06                      | 3,750 % éch. 28/05/2051                     | 600                                 | 417                              | 0,09                      |
| 6,150 % éch. 02/04/2030                 | \$ 200                              | 204                              | 0,05                      | F&G Global Funding                               |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase & Co.                        |                                     |                                  |                           |
| Blue Owl Finance LLC                    |                                     |                                  |                           | 4,963 % éch. 08/09/2028                          | \$ 800                              | 804                              | 0,18                      | 2,580 % éch. 22/04/2032                     | 5 100                               | 4 597                            | 1,03                      |
| 6,250 % éch. 18/04/2034                 | 500                                 | 490                              | 0,11                      | Fairfax Financial Holdings Ltd.                  |                                     |                                  |                           | 5,294 % éch. 22/07/2035                     | 400                                 | 404                              | 0,09                      |
| Blue Owl Technology Finance Corp.       |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 29/03/2028                          | € 100                               | 114                              | 0,03                      | 5,350 % éch. 01/06/2034                     | 800                                 | 814                              | 0,18                      |
| 6,125 % éch. 23/01/2031                 | 500                                 | 484                              | 0,11                      | 4,625 % éch. 29/04/2030                          | \$ 900                              | 895                              | 0,20                      | 5,766 % éch. 22/04/2035                     | 1 000                               | 1 041                            | 0,23                      |
| BNP Paribas Cardif S.A.                 |                                     |                                  |                           | Fifth Third Bancorp                              |                                     |                                  |                           | 6,470 % éch. 01/10/2026 (b)                 | 2 900                               | 2 909                            | 0,65                      |
| 4,414 % éch. 27/05/2041                 | € 200                               | 232                              | 0,05                      | 4,772 % éch. 28/07/2030                          | 800                                 | 799                              | 0,18                      | KBC Group NV                                |                                     |                                  |                           |
| 6,125 % éch. 19/12/2033 (b)(d)          | 1 000                               | 1 169                            | 0,26                      | Ford Credit Canada Co. Cie Credit Ford Du Canada |                                     |                                  |                           | 6,250 % éch. 17/09/2031 (b)(d)              | € 200                               | 241                              | 0,05                      |
| BNP Paribas S.A.                        |                                     |                                  |                           | 4,916 % éch. 09/01/2031 (e)                      | CAD 1 300                           | 930                              | 0,21                      | Kilroy Realty LP                            |                                     |                                  |                           |
| 5,625 % éch. 16/02/2033 (b)(d)          | 1 000                               | 1 144                            | 0,26                      | Ford Motor Credit Co. LLC                        |                                     |                                  |                           | 3,050 % éch. 15/02/2030                     | \$ 1 300                            | 1 201                            | 0,27                      |
| 7,375 % éch. 11/06/2030 (b)(d)          | 800                                 | 1 002                            | 0,23                      | 4,125 % éch. 17/08/2027                          | \$ 1 275                            | 1 264                            | 0,28                      | Lazard Group LLC                            |                                     |                                  |                           |
| 7,375 % éch. 10/09/2034 (b)(d)          | \$ 200                              | 209                              | 0,05                      | 5,125 % éch. 05/11/2026                          | 200                                 | 200                              | 0,04                      | 4,500 % éch. 19/09/2028                     | 200                                 | 199                              | 0,04                      |
|                                         |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 6,000 % éch. 15/03/2031                     | 300                                 | 311                              | 0,07                      |
|                                         |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC                    |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           |                                                  |                                     |                                  |                           | 6,068 % éch. 13/06/2036                     | 700                                 | 722                              | 0,16                      |



| DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)<br>€ | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)<br>\$ | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)<br>€ | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers)<br>\$ | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------------|---------------------------|
| 8,500 % éch. 27/09/2027 (b)(d)       | 600                                      | 825                                    | 0,19                      | Sagax AB                              | 1 100                                    | 1 240                                  | 0,28                      |
| Lseg U.S. Fin Corp.                  |                                          |                                        |                           | 3,375 % éch. 26/01/2031               |                                          |                                        |                           |
| 4,250 % éch. 23/03/2029              | \$ 1 000                                 | 989                                    | 0,22                      | Sammons Financial Group, Inc.         | \$ 700                                   | 750                                    | 0,17                      |
| Mapfre S.A.                          |                                          |                                        |                           | 6,875 % éch. 15/04/2034               |                                          |                                        |                           |
| 4,500 % éch. 09/06/2037              | € 600                                    | 699                                    | 0,16                      | Santander Holdings USA, Inc.          | 525                                      | 539                                    | 0,12                      |
| Marex Group PLC                      |                                          |                                        |                           | 6,499 % éch. 09/03/2029               |                                          |                                        |                           |
| 5,680 % éch. 21/04/2031              | \$ 200                                   | 200                                    | 0,04                      | SBL Holdings, Inc.                    | 100                                      | 97                                     | 0,02                      |
| 5,829 % éch. 08/05/2028              | 600                                      | 604                                    | 0,14                      | 5,900 % éch. 26/09/2028               |                                          |                                        |                           |
| Meiji Yasuda Life Insurance Co.      |                                          |                                        |                           | Scentre Group Trust                   | AUD 1 100                                | 726                                    | 0,16                      |
| 6,100 % éch. 11/06/2055              | 400                                      | 405                                    | 0,09                      | 5,350 % éch. 18/09/2035               |                                          |                                        |                           |
| Mercury General Corp.                |                                          |                                        |                           | SELP Finance SARL                     | € 300                                    | 345                                    | 0,08                      |
| 4,400 % éch. 15/03/2027              | 93                                       | 93                                     | 0,02                      | 3,750 % éch. 10/08/2027               |                                          |                                        |                           |
| Metropolitan Life Global Funding     |                                          |                                        |                           | Simon Global Development BV           | 1 300                                    | 1 499                                  | 0,34                      |
| 4,000 % éch. 27/05/2033              | € 1 100                                  | 1 287                                  | 0,29                      | 3,650 % éch. 15/06/2031               |                                          |                                        |                           |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. |                                          |                                        |                           | Sixth Street Lending Partners         | \$ 800                                   | 817                                    | 0,18                      |
| 4,505 % éch. 14/01/2032              | \$ 1 000                                 | 983                                    | 0,22                      | 6,500 % éch. 11/03/2029               |                                          |                                        |                           |
| 4,847 % éch. 21/04/2032              | 1 100                                    | 1 095                                  | 0,25                      | SMBC Aviation Capital Finance DAC     | 700                                      | 689                                    | 0,15                      |
| 5,426 % éch. 17/04/2035              | 400                                      | 406                                    | 0,09                      | 5,250 % éch. 26/11/2035               |                                          |                                        |                           |
| 5,441 % éch. 22/02/2034              | 300                                      | 306                                    | 0,07                      | Sompo Holdings, Inc.                  | 400                                      | 393                                    | 0,09                      |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd.            |                                          |                                        |                           | 5,411 % éch. 22/04/2037               |                                          |                                        |                           |
| 5,049 % éch. 28/01/2031              | 700                                      | 694                                    | 0,16                      | Standard Chartered PLC                | 600                                      | 592                                    | 0,13                      |
| Mizuho Financial Group, Inc.         |                                          |                                        |                           | 4,299 % éch. 13/01/2030               |                                          |                                        |                           |
| 2,869 % éch. 13/09/2030              | 300                                      | 283                                    | 0,06                      | Starwood Property Trust, Inc.         | 600                                      | 604                                    | 0,14                      |
| Morgan Stanley                       |                                          |                                        |                           | 6,125 % éch. 01/06/2031               |                                          |                                        |                           |
| 4,238 % éch. 09/01/2030              | 600                                      | 592                                    | 0,13                      | Stockland Trust                       | AUD 1 500                                | 1 053                                  | 0,24                      |
| 4,356 % éch. 22/10/2031              | 1 300                                    | 1 271                                  | 0,29                      | 6,120 % éch. 21/10/2033               |                                          |                                        |                           |
| 5,173 % éch. 16/01/2030              | 450                                      | 454                                    | 0,10                      | Store Capital LLC                     | \$ 200                                   | 199                                    | 0,04                      |
| 5,250 % éch. 21/04/2034              | 4 100                                    | 4 127                                  | 0,93                      | 4,500 % éch. 15/03/2028               |                                          |                                        |                           |
| 5,831 % éch. 19/04/2035              | 1 000                                    | 1 038                                  | 0,23                      | Store Capital LLC                     | 300                                      | 302                                    | 0,07                      |
| 6,407 % éch. 01/11/2029              | 1 400                                    | 1 450                                  | 0,33                      | 5,400 % éch. 30/04/2030               |                                          |                                        |                           |
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding  |                                          |                                        |                           | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | 900                                      | 884                                    | 0,20                      |
| 5,450 % éch. 12/12/2028              | 400                                      | 407                                    | 0,09                      | 5,046 % éch. 15/01/2037               | 1 300                                    | 1 330                                  | 0,30                      |
| Nationwide Building Society          |                                          |                                        |                           | 5,424 % éch. 09/07/2031               |                                          |                                        |                           |
| 3,960 % éch. 18/07/2030              | 200                                      | 195                                    | 0,04                      | Sun Communities Operating LP          | 800                                      | 720                                    | 0,16                      |
| 5,167 % éch. 12/12/2033              | £ 700                                    | 920                                    | 0,21                      | 2,700 % éch. 15/07/2031               |                                          |                                        |                           |
| NatWest Group PLC                    |                                          |                                        |                           | Swiss RE Subordinated Finance PLC     | € 1 900                                  | 2 214                                  | 0,50                      |
| 5,125 % éch. 12/05/2027 (b)(d)       | 600                                      | 794                                    | 0,18                      | 4,399 % éch. 22/04/2037               |                                          |                                        |                           |
| 7,300 % éch. 19/11/2034 (b)(d)       | \$ 200                                   | 209                                    | 0,05                      | TAG Immobilien AG                     | 1 000                                    | 1 132                                  | 0,25                      |
| 7,500 % éch. 28/02/2032 (b)(d)       | £ 200                                    | 274                                    | 0,06                      | 3,625 % éch. 03/03/2032               |                                          |                                        |                           |
| 7,500 % éch. 03/06/2036 (b)(d)       | 800                                      | 1 072                                  | 0,24                      | TP ICAP Finance PLC                   | £ 400                                    | 545                                    | 0,12                      |
| Neuberger Berman Group LLC           |                                          |                                        |                           | 6,375 % éch. 12/06/2032               |                                          |                                        |                           |
| 4,500 % éch. 15/03/2027              | \$ 1 000                                 | 999                                    | 0,22                      | Trust 2401                            | \$ 400                                   | 425                                    | 0,10                      |
| New Immo Holding S.A.                |                                          |                                        |                           | 7,375 % éch. 13/02/2034               |                                          |                                        |                           |
| 5,500 % éch. 23/04/2031              | € 900                                    | 1 034                                  | 0,23                      | UBS Group AG                          | 300                                      | 304                                    | 0,07                      |
| Newmark Group, Inc.                  |                                          |                                        |                           | 5,428 % éch. 08/02/2030               | 2 000                                    | 2 085                                  | 0,47                      |
| 7,500 % éch. 12/01/2029              | \$ 500                                   | 524                                    | 0,12                      | 5,959 % éch. 12/01/2034               | 1 000                                    | 1 019                                  | 0,23                      |
| Nippon Life Insurance Co.            |                                          |                                        |                           | 6,850 % éch. 10/09/2029 (b)(d)        |                                          |                                        |                           |
| 6,250 % éch. 13/09/2053              | 200                                      | 207                                    | 0,05                      | VICI Properties LP                    | 300                                      | 292                                    | 0,07                      |
| NLG Global Funding                   |                                          |                                        |                           | 3,875 % éch. 15/02/2029               | 400                                      | 384                                    | 0,09                      |
| 5,400 % éch. 23/01/2030              | 500                                      | 508                                    | 0,11                      | 4,125 % éch. 15/08/2030               | 100                                      | 99                                     | 0,02                      |
| NN Group NV                          |                                          |                                        |                           | 4,500 % éch. 15/01/2028               | 709                                      | 709                                    | 0,16                      |
| 5,750 % éch. 11/09/2034 (b)(d)       | € 1 600                                  | 1 867                                  | 0,42                      | 4,750 % éch. 15/02/2028               | 100                                      | 100                                    | 0,02                      |
| Nomura Holdings, Inc.                |                                          |                                        |                           | 5,125 % éch. 15/11/2031               | 800                                      | 794                                    | 0,18                      |
| 4,886 % éch. 02/07/2027              | \$ 500                                   | 504                                    | 0,11                      | 5,125 % éch. 15/05/2032               | 100                                      | 100                                    | 0,02                      |
| 7,000 % éch. 15/07/2030 (b)(d)       | 400                                      | 412                                    | 0,09                      | 5,625 % éch. 01/04/2035               | 400                                      | 406                                    | 0,09                      |
| Norinchukin Bank                     |                                          |                                        |                           | 5,750 % éch. 01/04/2034               |                                          |                                        |                           |
| 4,683 % éch. 10/03/2031              | 1 200                                    | 1 184                                  | 0,27                      | Vicinity Centres Trust                | AUD 900                                  | 614                                    | 0,14                      |
| Nykredit Realkredit A/S              |                                          |                                        |                           | 5,836 % éch. 03/03/2036               |                                          |                                        |                           |
| 1,500 % éch. 01/10/2052              | DKK 546                                  | 66                                     | 0,01                      | Volkswagen Bank GmbH                  | € 100                                    | 115                                    | 0,03                      |
| 1,500 % éch. 01/10/2053              | 2 218                                    | 276                                    | 0,06                      | 4,000 % éch. 26/11/2030               |                                          |                                        |                           |
| Omega Healthcare Investors, Inc.     |                                          |                                        |                           | Vonovia SE                            | AUD 2 000                                | 1 414                                  | 0,32                      |
| 5,200 % éch. 01/07/2030              | \$ 800                                   | 804                                    | 0,18                      | 6,385 % éch. 20/05/2033               |                                          |                                        |                           |
| P3 Group SARL                        |                                          |                                        |                           | Vornado Realty LP                     | \$ 600                                   | 602                                    | 0,14                      |
| 3,375 % éch. 22/03/2031              | € 1 400                                  | 1 580                                  | 0,35                      | 5,750 % éch. 01/02/2033               |                                          |                                        |                           |
| Pacific Life Global Funding          |                                          |                                        |                           | 2,393 % éch. 02/06/2028               | 600                                      | 588                                    | 0,13                      |
| 4,230 % éch. 27/01/2028              | \$ 1 000                                 | 1 001                                  | 0,22                      | 4,351 % éch. 20/05/2029               | 600                                      | 601                                    | 0,13                      |
| 5,692 % éch. 22/04/2031              | AUD 700                                  | 492                                    | 0,11                      | 4,700 % éch. 22/04/2028               | 1 900                                    | 1 908                                  | 0,43                      |
| PPI Public Property Invest AB        |                                          |                                        |                           | 4,897 % éch. 25/07/2033               | 2 100                                    | 2 087                                  | 0,47                      |
| 4,125 % éch. 21/04/2033              | € 1 700                                  | 1 918                                  | 0,43                      | 5,198 % éch. 23/01/2030               | 1 000                                    | 1 011                                  | 0,23                      |
| Protective Life Global Funding       |                                          |                                        |                           | Weyerhaeuser Co.                      |                                          |                                        |                           |
| 5,432 % éch. 14/01/2032              | \$ 700                                   | 715                                    | 0,16                      | 7,375 % éch. 15/03/2032               | 343                                      | 383                                    | 0,09                      |
| QNB Finance Ltd.                     |                                          |                                        |                           | Zurich Finance Ireland DAC            |                                          |                                        |                           |
| 4,538 % éch. 19/09/2027              | 2 000                                    | 1 999                                  | 0,45                      | 5,875 % éch. 23/10/2056               | 500                                      | 501                                    | 0,11                      |
| Realty Income Corp.                  |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
| 3,375 % éch. 20/06/2031              | € 400                                    | 454                                    | 0,10                      |                                       |                                          |                                        |                           |
| RGA Global Funding                   |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
| 5,500 % éch. 11/01/2031              | \$ 100                                   | 103                                    | 0,02                      |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          |                                        |                           |
|                                      |                                          |                                        |                           |                                       |                                          | </                                     |                           |

# Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Burberry Group PLC                       |                                     |                                  |                           | Fedex Freight Holding Co., Inc. |                                     |                                  |                           | Novartis Capital Corp.               |                                     |                                  |                           |
| 5,750 % éch. 20/06/2030                  | £ 200                               | \$ 268                           | 0,06                      | 4,650 % éch. 15/03/2031         | \$ 500                              | \$ 491                           | 0,11                      | 4,100 % éch. 05/11/2030              | \$ 300                              | \$ 295                           | 0,07                      |
| Cameron LNG LLC                          |                                     |                                  |                           | Ferguson Finance PLC            |                                     |                                  |                           | 4,600 % éch. 18/03/2033              | 1 000                               | 991                              | 0,22                      |
| 3,302 % éch. 15/01/2035                  | \$ 1 400                            | 1 223                            | 0,27                      | 3,250 % éch. 02/06/2030         | 300                                 | 283                              | 0,06                      | NTT Finance Corp.                    |                                     |                                  |                           |
| Canadian Natural Resources Ltd.          |                                     |                                  |                           | Flex Intermediate Holdco LLC    |                                     |                                  |                           | 5,502 % éch. 16/07/2035              | 515                                 | 518                              | 0,12                      |
| 5,400 % éch. 15/12/2034                  | 2 400                               | 2 426                            | 0,54                      | 3,363 % éch. 30/06/2031         | 2 100                               | 1 941                            | 0,44                      | Occidental Petroleum Corp.           |                                     |                                  |                           |
| 6,250 % éch. 15/03/2038                  | 300                                 | 317                              | 0,07                      | Flex Ltd.                       |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 15/07/2030              | 300                                 | 338                              | 0,08                      |
| 6,450 % éch. 30/06/2033                  | 100                                 | 108                              | 0,02                      | 4,875 % éch. 12/05/2030         | 200                                 | 200                              | 0,05                      | Oracle Corp.                         |                                     |                                  |                           |
| Carnival Corp. Ltd.                      |                                     |                                  |                           | Flora Food Management BV        |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/07/2046              | 500                                 | 337                              | 0,08                      |
| 4,000 % éch. 31/07/2028                  | 500                                 | 491                              | 0,11                      | 6,875 % éch. 02/07/2029         | € 500                               | 559                              | 0,13                      | 4,000 % éch. 15/11/2047              | 600                                 | 400                              | 0,09                      |
| CDW LLC                                  |                                     |                                  |                           | Fox Corp.                       |                                     |                                  |                           | 4,650 % éch. 06/05/2030              | 600                                 | 589                              | 0,13                      |
| 3,569 % éch. 01/12/2031                  | 900                                 | 827                              | 0,19                      | 6,500 % éch. 13/10/2033 (f)     | \$ 400                              | 426                              | 0,10                      | 5,375 % éch. 27/09/2054              | 800                                 | 628                              | 0,14                      |
| Centene Corp.                            |                                     |                                  |                           | Gartner, Inc.                   |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 27/09/2064              | 400                                 | 310                              | 0,07                      |
| 2,450 % éch. 15/07/2028                  | 252                                 | 240                              | 0,05                      | 3,625 % éch. 15/06/2029         | 1 000                               | 946                              | 0,21                      | 6,150 % éch. 09/11/2029              | 300                                 | 308                              | 0,07                      |
| 2,500 % éch. 01/03/2031                  | 783                                 | 684                              | 0,15                      | 4,950 % éch. 20/03/2031         | 200                                 | 194                              | 0,04                      | 6,250 % éch. 09/11/2032 (f)          | 1 000                               | 1 028                            | 0,23                      |
| 2,625 % éch. 01/08/2031                  | 117                                 | 102                              | 0,02                      | Glencore Funding LLC            |                                     |                                  |                           | Origin Energy Finance Ltd.           |                                     |                                  |                           |
| CGI, Inc.                                |                                     |                                  |                           | 5,508 % éch. 01/04/2036         | 400                                 | 403                              | 0,09                      | 1,000 % éch. 17/09/2029              | € 500                               | 533                              | 0,12                      |
| 4,950 % éch. 14/03/2030                  | 200                                 | 199                              | 0,04                      | Global Payments, Inc.           |                                     |                                  |                           | Paramount Global                     |                                     |                                  |                           |
| Chanel Ceres PLC                         |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 15/03/2028         | 1 000                               | 996                              | 0,22                      | 4,950 % éch. 15/01/2031              | \$ 500                              | 465                              | 0,10                      |
| 0,500 % éch. 31/07/2026                  | € 400                               | 456                              | 0,10                      | Greene King Finance PLC         |                                     |                                  |                           | Petroleos Mexicanos                  |                                     |                                  |                           |
| Charter Communications Operating LLC     |                                     |                                  |                           | 5,318 % éch. 15/09/2031         | £ 81                                | 107                              | 0,02                      | 6,840 % éch. 23/01/2030              | 300                                 | 308                              | 0,07                      |
| 2,250 % éch. 15/01/2029                  | \$ 800                              | 745                              | 0,17                      | Grifols S.A.                    |                                     |                                  |                           | Philip Morris International, Inc.    |                                     |                                  |                           |
| Cheniere Energy Partners LP              |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/05/2030 (e)     | € 246                               | 293                              | 0,07                      | 1,750 % éch. 01/11/2030              | 329                                 | 292                              | 0,07                      |
| 3,250 % éch. 31/01/2032 (f)              | 600                                 | 550                              | 0,12                      | Grupo Nutresa S.A.              |                                     |                                  |                           | 5,250 % éch. 13/02/2034              | 400                                 | 407                              | 0,09                      |
| Choice Hotels International, Inc.        |                                     |                                  |                           | 8,000 % éch. 12/05/2030         | \$ 500                              | 530                              | 0,12                      | 5,750 % éch. 17/11/2032              | 600                                 | 629                              | 0,14                      |
| 5,850 % éch. 01/08/2034                  | 400                                 | 407                              | 0,09                      | Haleon U.S. Capital LLC         |                                     |                                  |                           | Plains All American Pipeline LP      |                                     |                                  |                           |
| CommonSpirit Health                      |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 24/03/2032         | 750                                 | 703                              | 0,16                      | 5,950 % éch. 15/06/2035              | 400                                 | 412                              | 0,09                      |
| 4,975 % éch. 01/09/2035                  | 100                                 | 97                               | 0,02                      | HCA, Inc.                       |                                     |                                  |                           | RD Michigan Property Owner LLC       |                                     |                                  |                           |
| CVS Health Corp.                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 01/09/2030         | 2 325                               | 2 206                            | 0,50                      | 7,500 % éch. 30/03/2045              | 1 000                               | 997                              | 0,22                      |
| 4,780 % éch. 25/03/2038                  | 1 100                               | 1 032                            | 0,23                      | 3,500 % éch. 15/07/2051         | 700                                 | 474                              | 0,11                      | Roper Technologies, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 25/03/2048                  | 600                                 | 530                              | 0,12                      | Heidelberg Materials AG         |                                     |                                  |                           | 4,450 % éch. 15/09/2030              | 400                                 | 395                              | 0,09                      |
| 5,125 % éch. 21/02/2030                  | 1 000                               | 1 011                            | 0,23                      | 3,500 % éch. 10/10/2029         | € 900                               | 1 038                            | 0,23                      | Royal Caribbean Cruises Ltd.         |                                     |                                  |                           |
| 5,450 % éch. 15/09/2035                  | 100                                 | 101                              | 0,02                      | Informa PLC                     |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/05/2033              | 500                                 | 487                              | 0,11                      |
| 5,875 % éch. 01/06/2053                  | 300                                 | 294                              | 0,07                      | JDE Peet's NV                   |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 15/01/2036              | 100                                 | 99                               | 0,02                      |
| 6,050 % éch. 01/06/2054                  | 100                                 | 100                              | 0,02                      | 2,250 % éch. 24/09/2031         | \$ 600                              | 520                              | 0,12                      | 5,500 % éch. 01/04/2028              | 500                                 | 505                              | 0,11                      |
| CVS Pass-Through Trust                   |                                     |                                  |                           | JetBlue Pass-Through Trust      |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 30/09/2031              | 200                                 | 202                              | 0,05                      |
| 6,036 % éch. 10/12/2028                  | 64                                  | 64                               | 0,01                      | 2,750 % éch. 15/11/2033         | 209                                 | 185                              | 0,04                      | Santos Finance Ltd.                  |                                     |                                  |                           |
| Davide Campari-Milano NV                 |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 15/05/2034         | 64                                  | 61                               | 0,01                      | 5,250 % éch. 13/03/2029              | 1 600                               | 1 611                            | 0,36                      |
| 4,250 % éch. 17/06/2033                  | € 1 200                             | 1 397                            | 0,31                      | Kinder Morgan, Inc.             |                                     |                                  |                           | Saudi Arabian Oil Co.                |                                     |                                  |                           |
| Delta Air Lines Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 01/02/2033         | 300                                 | 297                              | 0,07                      | 4,375 % éch. 02/02/2031              | 500                                 | 489                              | 0,11                      |
| 2,000 % éch. 10/12/2029                  | \$ 705                              | 681                              | 0,15                      | Kraft Heinz Foods Co.           |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 17/07/2054              | 600                                 | 569                              | 0,13                      |
| Devon Energy Corp.                       |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 26/01/2039         | 550                                 | 603                              | 0,14                      | Schlumberger Holdings Corp.          |                                     |                                  |                           |
| 5,600 % éch. 15/03/2034                  | 500                                 | 513                              | 0,12                      | Kyndryl Holdings, Inc.          |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 01/06/2034              | 200                                 | 199                              | 0,04                      |
| Diamondback Energy, Inc.                 |                                     |                                  |                           | 3,150 % éch. 15/10/2031         | 500                                 | 417                              | 0,09                      | ServiceNow, Inc.                     |                                     |                                  |                           |
| 5,400 % éch. 18/04/2034                  | 400                                 | 406                              | 0,09                      | Las Vegas Sands Corp.           |                                     |                                  |                           | 5,400 % éch. 15/05/2036              | 700                                 | 700                              | 0,16                      |
| Discovery Global Holdings, Inc.          |                                     |                                  |                           | 5,300 % éch. 15/05/2031         | 1 100                               | 1 096                            | 0,25                      | Sibanye-Stillwater UK Financing PLC  |                                     |                                  |                           |
| 5,050 % éch. 15/03/2042                  | 1 380                               | 1 013                            | 0,23                      | 5,625 % éch. 15/06/2028         | 400                                 | 405                              | 0,09                      | 6,250 % éch. 15/11/2031              | 1 000                               | 990                              | 0,22                      |
| DT Midstream, Inc.                       |                                     |                                  |                           | Live Nation Entertainment, Inc. |                                     |                                  |                           | Skyworks Solutions, Inc.             |                                     |                                  |                           |
| 5,800 % éch. 15/12/2034                  | 550                                 | 562                              | 0,13                      | 3,750 % éch. 15/01/2028         | 500                                 | 491                              | 0,11                      | 3,000 % éch. 01/06/2031              | 100                                 | 90                               | 0,02                      |
| Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. |                                     |                                  |                           | Lonsdale Finance Pty. Ltd.      |                                     |                                  |                           | Snam SpA                             |                                     |                                  |                           |
| 3,900 % éch. 15/11/2049                  | 1 400                               | 1 033                            | 0,23                      | 5,100 % éch. 07/10/2032         | AUD 1 000                           | 673                              | 0,15                      | 5,000 % éch. 28/05/2030              | 300                                 | 302                              | 0,07                      |
| Ecopetrol S.A.                           |                                     |                                  |                           | Maple Parent Holdings Corp.     |                                     |                                  |                           | SoftBank Group Corp.                 |                                     |                                  |                           |
| 8,875 % éch. 13/01/2033                  | 300                                 | 329                              | 0,07                      | 5,050 % éch. 26/03/2031         | \$ 1 100                            | 1 099                            | 0,25                      | 7,250 % éch. 10/07/2032              | 600                                 | 591                              | 0,13                      |
| Eli Lilly & Co.                          |                                     |                                  |                           | Marriott International, Inc.    |                                     |                                  |                           | 7,375 % éch. 22/04/2034              | € 300                               | 358                              | 0,08                      |
| 4,650 % éch. 20/05/2033                  | 500                                 | 497                              | 0,11                      | 3,500 % éch. 15/10/2032         | 200                                 | 184                              | 0,04                      | 8,500 % éch. 22/04/2036              | \$ 900                              | 934                              | 0,21                      |
| Energy Transfer LP                       |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 01/05/2033         | 700                                 | 678                              | 0,15                      | Space Exploration Technologies Corp. |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 15/01/2036                  | 1 200                               | 1 196                            | 0,27                      | 5,250 % éch. 15/10/2035         | 200                                 | 200                              | 0,05                      | 5,350 % éch. 15/07/2031              | 400                                 | 399                              | 0,09                      |
| 5,750 % éch. 15/02/2033                  | 400                                 | 414                              | 0,09                      | Mars, Inc.                      |                                     |                                  |                           | SPIE S.A.                            |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 01/10/2043                  | 100                                 | 99                               | 0,02                      | 5,700 % éch. 01/05/2055         | 500                                 | 493                              | 0,11                      | 3,875 % éch. 18/05/2031              | € 800                               | 912                              | 0,20                      |
| 5,950 % éch. 15/05/2054                  | 1 400                               | 1 341                            | 0,30                      | Meta Platforms, Inc.            |                                     |                                  |                           | Spirit Airlines Pass-Through Trust   |                                     |                                  |                           |
| 6,200 % éch. 01/04/2055                  | 700                                 | 693                              | 0,16                      | 5,400 % éch. 15/08/2054         | 400                                 | 353                              | 0,08                      | 3,650 % éch. 15/08/2031              | \$ 346                              | 312                              | 0,07                      |
| 6,500 % éch. 01/02/2042                  | 100                                 | 106                              | 0,02                      | 5,600 % éch. 15/05/2053         | 800                                 | 728                              | 0,16                      | 4,100 % éch. 01/10/2029              | 233                                 | 226                              | 0,05                      |
| Eni SpA                                  |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/11/2065         | 500                                 | 449                              | 0,10                      | Stellantis NV                        |                                     |                                  |                           |
| 5,950 % éch. 15/05/2054                  | 650                                 | 644                              | 0,14                      | Microchip Technology, Inc.      |                                     |                                  |                           | 6,875 % éch. 16/12/2033 (b)          | € 1 500                             | 1 675                            | 0,38                      |
| Entergy Louisiana LLC                    |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 15/02/2030         | 200                                 | 201                              | 0,05                      | Sutter Health                        |                                     |                                  |                           |
| 5,350 % éch. 15/03/2034                  | 100                                 | 103                              | 0,02                      | Mitchells & Butlers Finance PLC |                                     |                                  |                           | 5,164 % éch. 15/08/2033              | \$ 100                              | 101                              | 0,02                      |
| Enterprise Products Operating LLC        |                                     |                                  |                           | 6,013 % éch. 15/12/2030         | £ 221                               | 294                              | 0,07                      | Synopsys, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| 5,700 % éch. 15/02/2042                  | 300                                 | 304                              | 0,07                      | MPLX LP                         |                                     |                                  |                           | 4,850 % éch. 01/04/2030              | 175                                 | 175                              | 0,04                      |
| EQT Corp.                                |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 15/02/2031         | \$ 900                              | 897                              | 0,20                      | Sysco Corp.                          |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 01/04/2029                  | 200                                 | 205                              | 0,05                      | MSCI, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 25/03/2036              | 600                                 | 578                              | 0,13                      |
| Equifax, Inc.                            |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 15/02/2031         | 300                                 | 284                              | 0,06                      | 5,950 % éch. 01/04/2030              | 400                                 | 415                              | 0,09                      |
| 5,100 % éch. 01/06/2028                  | 200                                 | 202                              | 0,05                      | National Fuel Gas Co.           |                                     |                                  |                           | T-Mobile USA, Inc.                   |                                     |                                  |                           |
| Essent Group Ltd.                        |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/05/2029         | 900                                 | 898                              | 0,20                      | 3,875 % éch. 15/04/2030              | 600                                 | 581                              | 0,13                      |
| 6,250 % éch. 01/07/2029                  | 100                                 | 103                              | 0,02                      | Northern Star Resources Ltd.    |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 15/01/2035              | 1 400                               | 1 352                            | 0,30                      |
| Expand Energy Corp.                      |                                     |                                  |                           | 6,125 % éch. 11/04/2033         | 1 100                               | 1 141                            | 0,26                      | 5,500 % éch. 15/01/2055              | 1 100                               | 1 011                            | 0,23                      |
| 5,700 % éch. 15/01/2035                  | 700                                 | 708                              | 0,16                      |                                 |                                     |                                  |                           | Tapestry, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
|                                          |                                     |                                  |                           |                                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 11/03/2035              | 200                                 | 201                              | 0,05                      |

| DESCRIPTION                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Targa Resources Corp.<br>4,900 % éch. 15/09/2030<br>6,125 % éch. 15/03/2033                   | \$ 280<br>200                       | \$ 281<br>211                    | 0,06<br>0,05              | Arizona Public Service Co.<br>5,500 % éch. 01/09/2035                            | \$ 200                              | \$ 201                           | 0,05                      | Progress Energy, Inc.<br>7,750 % éch. 01/03/2031                                                                             | \$ 204                              | \$ 228                           | 0,05                      |
| Technip Energies NV<br>4,000 % éch. 10/06/2033                                                | € 900                               | 1 035                            | 0,23                      | AT&T, Inc.<br>3,500 % éch. 15/09/2053<br>4,750 % éch. 30/04/2033                 | 2 800<br>1 200                      | 1 819<br>1 175                   | 0,41<br>0,26              | Public Service Co. of Colorado<br>6,250 % éch. 01/09/2037                                                                    | 300                                 | 322                              | 0,07                      |
| Texas Eastern Transmission LP<br>7,000 % éch. 15/07/2032                                      | \$ 700                              | 772                              | 0,17                      | Black Hills Corp.<br>4,550 % éch. 31/01/2031<br>6,000 % éch. 15/01/2035          | 600<br>350                          | 591<br>365                       | 0,13<br>0,08              | Public Service Co. of Oklahoma<br>2,200 % éch. 15/08/2031                                                                    | 200                                 | 176                              | 0,04                      |
| Time Warner Cable LLC<br>5,875 % éch. 15/11/2040                                              | 1 400                               | 1 253                            | 0,28                      | 6,150 % éch. 15/05/2034                                                          | 200                                 | 210                              | 0,05                      | Puget Energy, Inc.<br>7,250 % éch. 15/09/2056                                                                                | 500                                 | 511                              | 0,11                      |
| Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.<br>5,623 % éch. 28/08/2034<br>6,431 % éch. 05/06/2036 | AUD 1 400<br>200                    | 946<br>141                       | 0,21<br>0,03              | Clearway Energy Operating LLC<br>5,750 % éch. 15/01/2034                         | 600                                 | 589                              | 0,13                      | San Diego Gas & Electric Co.<br>5,200 % éch. 15/03/2036<br>5,350 % éch. 01/04/2053                                           | 100<br>1 000                        | 100<br>935                       | 0,02<br>0,21              |
| United Airlines Pass-Through Trust<br>2,700 % éch. 01/11/2033<br>2,875 % éch. 07/04/2030      | \$ 282<br>312                       | 258<br>301                       | 0,06<br>0,07              | Cleveland Electric Illuminating Co.<br>3,500 % éch. 01/04/2028                   | 1 461                               | 1 430                            | 0,32                      | SGSP Australia Assets Pty. Ltd.<br>3,250 % éch. 29/07/2026<br>3,375 % éch. 08/10/2032                                        | € 200<br>200                        | 200<br>225                       | 0,04<br>0,05              |
| 3,100 % éch. 07/04/2030<br>3,700 % éch. 01/09/2031<br>3,750 % éch. 03/03/2028                 | 174<br>373<br>419                   | 167<br>356<br>418                | 0,04<br>0,08<br>0,09      | Connecticut Light and Power Co.<br>4,900 % éch. 01/07/2033                       | 1 000                               | 1 005                            | 0,23                      | Southern California Edison Co.<br>2,750 % éch. 01/02/2032<br>2,850 % éch. 01/08/2029                                         | \$ 1 500<br>800                     | 1 335<br>755                     | 0,30<br>0,17              |
| 4,550 % éch. 25/02/2033<br>5,450 % éch. 15/08/2038                                            | 61<br>282                           | 59<br>288                        | 0,01<br>0,06              | Consolidated Edison Co. of New York, Inc.<br>5,300 % éch. 01/03/2035             | 900                                 | 917                              | 0,21                      | 3,900 % éch. 01/12/2041<br>4,125 % éch. 01/03/2048                                                                           | 108<br>100                          | 85<br>75                         | 0,02<br>0,02              |
| UnitedHealth Group, Inc.<br>4,950 % éch. 15/01/2032                                           | 1 062                               | 1 070                            | 0,24                      | Constellation Energy Generation LLC<br>5,300 % éch. 01/06/2036                   | 800                                 | 796                              | 0,18                      | 4,200 % éch. 01/03/2029<br>5,300 % éch. 01/03/2028<br>6,200 % éch. 15/09/2055                                                | 200<br>600<br>1 300                 | 197<br>606<br>1 294              | 0,04<br>0,14<br>0,29      |
| Universal Music Group NV<br>4,125 % éch. 16/06/2036                                           | € 1 200                             | 1 391                            | 0,31                      | Dominion Energy, Inc.<br>5,450 % éch. 15/03/2035                                 | 800                                 | 812                              | 0,18                      | Southern California Gas Co.<br>5,200 % éch. 01/06/2033                                                                       | 1 300                               | 1 320                            | 0,30                      |
| Var Energi ASA<br>4,950 % éch. 29/04/2086<br>5,875 % éch. 22/05/2030                          | 300<br>900                          | 343<br>927                       | 0,08<br>0,21              | DWR Cymru Financing UK PLC<br>6,250 % éch. 08/09/2037                            | £ 1 000                             | 1 329                            | 0,30                      | Southwest Gas Corp.<br>5,800 % éch. 01/12/2027                                                                               | 885                                 | 900                              | 0,20                      |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,250 % éch. 15/01/2030                                  | 2 000                               | 2 049                            | 0,46                      | Edison International<br>5,450 % éch. 15/06/2029                                  | \$ 1 600                            | 1 616                            | 0,36                      | Southwestern Electric Power Co.<br>5,200 % éch. 01/04/2036                                                                   | 1 100                               | 1 086                            | 0,24                      |
| Venture Global LNG, Inc.<br>6,375 % éch. 15/12/2034                                           | 300                                 | 295                              | 0,07                      | Électricité de France S.A.<br>4,875 % éch. 21/09/2038                            | 400                                 | 370                              | 0,08                      | Southwestern Public Service Co.<br>3,750 % éch. 15/06/2049                                                                   | 500                                 | 369                              | 0,08                      |
| Viper Energy Partners LLC<br>5,700 % éch. 01/08/2035                                          | 200                                 | 203                              | 0,05                      | EnBW International Finance BV<br>6,048 % éch. 30/10/2034                         | AUD 800                             | 560                              | 0,13                      | SPP-Distribucia A/S<br>1,000 % éch. 09/06/2031                                                                               | € 200                               | 200                              | 0,04                      |
| Vmed Q2 UK Financing PLC<br>5,625 % éch. 15/04/2032                                           | € 1 000                             | 1 008                            | 0,23                      | Entergy Arkansas LLC<br>4,950 % éch. 15/01/2036                                  | \$ 200                              | 196                              | 0,04                      | SW Finance PLC<br>6,875 % éch. 07/08/2032<br>6,875 % éch. 14/11/2034                                                         | £ 400<br>600                        | 535<br>797                       | 0,12<br>0,18              |
| VMware LLC<br>2,200 % éch. 15/08/2031                                                         | \$ 1 700                            | 1 498                            | 0,34                      | Entergy Texas, Inc.<br>5,250 % éch. 15/04/2035<br>5,550 % éch. 15/09/2054        | 1 000<br>200                        | 1 005<br>193                     | 0,23<br>0,04              | 7,000 % éch. 16/04/2040                                                                                                      | 500                                 | 634                              | 0,14                      |
| VOC Escrow Ltd.<br>5,000 % éch. 15/02/2028                                                    | 200                                 | 200                              | 0,05                      | EPH Financing International A/S<br>5,875 % éch. 30/11/2029                       | € 300                               | 365                              | 0,08                      | System Energy Resources, Inc.<br>5,300 % éch. 15/12/2034                                                                     | \$ 400                              | 399                              | 0,09                      |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>4,550 % éch. 11/09/2028<br>5,050 % éch. 27/03/2028 | 300<br>794                          | 298<br>798                       | 0,07<br>0,18              | Eversource Energy<br>5,500 % éch. 01/01/2034                                     | \$ 200                              | 204                              | 0,05                      | TDC Net A/S<br>5,000 % éch. 09/08/2032                                                                                       | € 1 000                             | 1 187                            | 0,27                      |
| Weir Group, Inc.<br>5,350 % éch. 06/05/2030                                                   | 200                                 | 202                              | 0,05                      | Interstate Power & Light Co.<br>3,600 % éch. 01/04/2029                          | 600                                 | 585                              | 0,13                      | TXNM Energy, Inc.<br>7,000 % éch. 31/07/2056                                                                                 | \$ 1 400                            | 1 416                            | 0,32                      |
| Western Midstream Operating LP<br>5,500 % éch. 15/12/2035                                     | 1 000                               | 990                              | 0,22                      | Louisville Gas & Electric Co.<br>5,450 % éch. 15/04/2033                         | 500                                 | 514                              | 0,12                      | Veon Midco BV<br>6,950 % éch. 01/06/2031                                                                                     | 700                                 | 699                              | 0,16                      |
| Williams Cos., Inc.<br>5,600 % éch. 15/03/2035                                                | 500                                 | 510                              | 0,11                      | NBN Co. Ltd.<br>5,000 % éch. 28/08/2031                                          | AUD 1 000                           | 687                              | 0,15                      | Vistra Operations Co. LLC<br>6,000 % éch. 15/04/2034                                                                         | 500                                 | 515                              | 0,12                      |
| Woodside Finance Ltd.<br>5,100 % éch. 12/09/2034<br>5,400 % éch. 19/05/2030                   | 900<br>500                          | 885<br>508                       | 0,20<br>0,11              | New York State Electric & Gas Corp.<br>5,850 % éch. 15/08/2033                   | \$ 800                              | 837                              | 0,19                      |                                                                                                                              |                                     | 52 861                           | 11,86                     |
| 6,000 % éch. 19/05/2035                                                                       | 700                                 | 727                              | 0,16                      | Niagara Mohawk Power Corp.<br>5,290 % éch. 17/01/2034                            | 1 000                               | 1 004                            | 0,23                      | Total des Obligations et billets privés                                                                                      |                                     | 357 391                          | 80,22                     |
| Wynn Las Vegas LLC<br>5,250 % éch. 15/05/2027                                                 | 100                                 | 100                              | 0,02                      | Nova Securitisation SARL<br>6,500 % éch. 03/02/2036                              | 600                                 | 565                              | 0,13                      | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Wynn Resorts Finance LLC<br>6,250 % éch. 15/03/2033<br>7,125 % éch. 15/02/2031                | 100<br>300                          | 100<br>317                       | 0,02<br>0,07              | Oklahoma Gas & Electric Co.<br>5,400 % éch. 15/01/2033                           | 200                                 | 205                              | 0,05                      | Billets Maricopa County, Arizona Industrial Development Authority<br>Revenue Notes, Series 2024<br>7,375 % éch. 01/10/2029   |                                     |                                  |                           |
| Yorkshire Water Finance PLC<br>1,750 % éch. 27/10/2032<br>6,000 % éch. 22/07/2033             | £ 400<br>300                        | 422<br>399                       | 0,09<br>0,09              | Oncor Electric Delivery Co. LLC<br>5,700 % éch. 24/06/2033                       | AUD 1 300                           | 906                              | 0,20                      | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 6,375 % éch. 18/11/2034                                                                       | 100                                 | 136                              | 0,03                      | ONEOK, Inc.<br>5,050 % éch. 01/11/2034                                           | \$ 2 300                            | 2 250                            | 0,50                      | Freddie Mac<br>4,498 % éch. 25/12/2055                                                                                       | 473                                 | 475                              | 0,11                      |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc.<br>4,250 % éch. 15/08/2035                                       | \$ 228                              | 210                              | 0,05                      | Orange S.A.<br>4,750 % éch. 13/01/2033                                           | 600                                 | 589                              | 0,13                      | Ginnie Mae<br>3,909 % éch. 20/01/2068<br>4,511 % éch. 20/10/2066                                                             | 251<br>100                          | 250<br>101                       | 0,05<br>0,02              |
|                                                                                               |                                     | 127 398                          | 28,60                     | Pacific Gas & Electric Co.<br>2,100 % éch. 01/08/2027<br>3,250 % éch. 01/06/2031 | 1 800<br>1 400                      | 1 753<br>1 292                   | 0,39<br>0,29              | 4,000 % éch. 01/07/2056<br>5,000 % éch. 01/07/2056                                                                           | 2 300<br>700                        | 2 138<br>690                     | 0,48<br>0,15              |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS                                                                    |                                     |                                  |                           |                                                                                  |                                     |                                  |                           | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>3,000 % éch. 01/05/2052<br>4,500 % éch. 01/09/2052 - 01/10/2052 |                                     |                                  |                           |
| AEP Texas, Inc.<br>5,450 % éch. 15/05/2029                                                    | 200                                 | 204                              | 0,05                      | PacifiCorp<br>4,125 % éch. 15/01/2049<br>6,250 % éch. 15/10/2037                 | 300<br>1 400                        | 228<br>1 471                     | 0,05<br>0,33              | 3,000 % éch. 01/08/2056<br>4,000 % éch. 01/07/2056 - 01/08/2056                                                              | 20<br>14 530                        | 18<br>13 573                     | 0,00<br>3,05              |
| AES Corp.<br>3,950 % éch. 15/07/2030                                                          | 1 300                               | 1 246                            | 0,28                      | 7,125 % éch. 15/08/2056<br>7,375 % éch. 15/09/2055                               | 500<br>300                          | 497<br>303                       | 0,11<br>0,07              | 4,500 % éch. 01/07/2056<br>5,000 % éch. 01/07/2056                                                                           | 1 100<br>25 100                     | 1 054<br>24 668                  | 0,24<br>5,54              |
| Ameren Illinois Co.<br>3,250 % éch. 15/03/2050                                                | 400                                 | 275                              | 0,06                      | Petrobras Global Finance BV<br>5,125 % éch. 10/09/2030                           | 1 200                               | 1 180                            | 0,26                      |                                                                                                                              |                                     | 46 479                           | 10,43                     |
| Anglian Water Services Financing PLC<br>5,375 % éch. 10/11/2033<br>6,000 % éch. 20/06/2039    | £ 900<br>100                        | 1 165<br>127                     | 0,26<br>0,03              | PG&E Corp.<br>6,850 % éch. 15/09/2056                                            | 400                                 | 399                              | 0,09                      |                                                                                                                              |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                                                         |                                     |                                  |                           | New Century Home Equity Loan Trust                                |                                     |                                  |                           | 5,850 % éch. 02/07/2032                                | \$ 600                              | \$ 607                           | 0,14                      |
| Obligations du Trésor américain                                                                |                                     |                                  |                           | 4,468 % éch. 25/02/2036                                           | \$ 182                              | \$ 162                           | 0,04                      | 6,000 % éch. 07/05/2036                                | 500                                 | 500                              | 0,11                      |
| 2,250 % éch. 15/05/2041                                                                        | \$ 1 600                            | \$ 1 167                         | 0,26                      |                                                                   |                                     | 794                              | 0,18                      | New South Wales Treasury Corp.                         |                                     |                                  |                           |
| 4,625 % éch. 15/11/2055                                                                        | 4 600                               | 4 377                            | 0,99                      |                                                                   |                                     |                                  |                           | 1,750 % éch. 20/03/2034                                | AUD 700                             | 382                              | 0,09                      |
| 4,750 % éch. 15/08/2055                                                                        | 1 525                               | 1 480                            | 0,33                      | <b>AUTRES TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                         |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 20/11/2037                                | 900                                 | 520                              | 0,12                      |
| 4,875 % éch. 15/08/2045                                                                        | 269                                 | 267                              | 0,06                      | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.                    |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement péruvien     |                                     |                                  |                           |
| Billets du Trésor américain                                                                    |                                     |                                  |                           | 5,102 % éch. 01/04/2035                                           | 474                                 | 482                              | 0,11                      | 5,400 % éch. 12/08/2034                                | PEN 4 800                           | 1 376                            | 0,31                      |
| 4,000 % éch. 15/11/2035                                                                        | 700                                 | 677                              | 0,15                      |                                                                   |                                     | 1 276                            | 0,29                      | 6,150 % éch. 12/08/2032                                | 700                                 | 222                              | 0,05                      |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                                        | 6 250                               | 6 099                            | 1,37                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                      |                                     |                                  |                           | 6,950 % éch. 12/08/2031                                | 2 992                               | 998                              | 0,22                      |
| 4,250 % éch. 15/08/2035                                                                        | 1 110                               | 1 096                            | 0,24                      | Obligation internationale du gouvernement brésilien               |                                     |                                  |                           | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                     |                                     |                                  |                           |
| 4,375 % éch. 15/05/2036                                                                        | 879                                 | 874                              | 0,20                      | 7,250 % éch. 12/01/2056                                           | 400                                 | 403                              | 0,09                      | 2,800 % éch. 23/06/2030                                | \$ 300                              | 278                              | 0,06                      |
| STRIPS du Trésor américain                                                                     |                                     |                                  |                           | Cassa Depositi e Prestiti SpA                                     |                                     |                                  |                           | Queensland Treasury Corp.                              |                                     |                                  |                           |
| 0,000 % éch. 15/08/2049 (a)                                                                    | 11 700                              | 3 585                            | 0,80                      | 5,875 % éch. 30/04/2029                                           | 500                                 | 517                              | 0,12                      | 2,000 % éch. 22/08/2033                                | AUD 900                             | 511                              | 0,11                      |
| 0,000 % éch. 15/08/2050 (a)                                                                    | 6 800                               | 1 985                            | 0,45                      | Obligation internationale du gouvernement colombien               |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement saoudien     |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                | 21 607                              | 4,85                             |                           | 5,750 % éch. 26/11/2034                                           | € 600                               | 699                              | 0,16                      | 5,125 % éch. 13/01/2028                                | \$ 1 100                            | 1 108                            | 0,25                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b> |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement costaricain             |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement sud-africain |                                     |                                  |                           |
| Commercial Mortgage Trust                                                                      |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 21/11/2030                                           | 1 000                               | 1 203                            | 0,27                      | 8,500 % éch. 31/01/2037                                | ZAR 16 400                          | 997                              | 0,22                      |
| 3,140 % éch. 10/10/2036                                                                        | 700                                 | 691                              | 0,16                      | CPPIB Capital, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | 8,875 % éch. 28/02/2035                                | 46 425                              | 2 935                            | 0,66                      |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                                             |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/01/2031                                           | AUD 200                             | 139                              | 0,03                      | South Australian Government Financing Authority        |                                     |                                  |                           |
| 5,094 % éch. 25/08/2035                                                                        | 24                                  | 21                               | 0,00                      | Eagle Funding Luxco SARL                                          |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 24/05/2035                                | AUD 300                             | 201                              | 0,05                      |
| Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust                                                 |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 17/08/2030                                           | \$ 1 000                            | 1 005                            | 0,23                      | Treasury Corp. of Victoria                             |                                     |                                  |                           |
| 4,155 % éch. 25/11/2034                                                                        | 72                                  | 69                               | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 15/09/2036                                | 1 700                               | 1 120                            | 0,25                      |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                                    |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 20/04/2033                                           | 300                                 | 299                              | 0,07                      | Bon du Trésor britannique                              |                                     |                                  |                           |
| 2,750 % éch. 25/07/2057                                                                        | 134                                 | 131                              | 0,03                      | 5,000 % éch. 30/04/2034                                           | 800                                 | 814                              | 0,18                      | 4,375 % éch. 31/07/2054                                | £ 729                               | 813                              | 0,18                      |
| 3,850 % éch. 25/09/2057                                                                        | 144                                 | 138                              | 0,03                      | Export-Import Bank of India                                       |                                     |                                  |                           |                                                        | 25 884                              | 5,81                             |                           |
| RMAC PLC                                                                                       |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 12/01/2036                                           | 900                                 | 885                              | 0,20                      | <b>ACTIONS</b>                                         |                                     |                                  |                           |
| 4,947 % éch. 15/02/2047                                                                        | £ 418                               | 555                              | 0,12                      | Obligation internationale du gouvernement israélien               |                                     |                                  |                           | <b>TITRES PRIVILÉGIÉS</b>                              |                                     |                                  |                           |
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 19/02/2030                                           | 400                                 | 406                              | 0,09                      | Wells Fargo & Co.                                      |                                     |                                  |                           |
| 3,874 % éch. 15/06/2036                                                                        | \$ 700                              | 657                              | 0,15                      | 5,750 % éch. 12/03/2054                                           | 1 500                               | 1 436                            | 0,32                      | 4,250 % éch. 15/09/2026 (b)                            | 40 800                              | 684                              | 0,15                      |
|                                                                                                | 2 262                               | 0,51                             |                           | Obligation internationale du gouvernement japonais                |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                           | \$ 457 892                          | 102,78                           |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                                                             |                                     |                                  |                           | 2,000 % éch. 20/12/2044                                           | ¥ 230 000                           | 1 122                            | 0,25                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                          |                                     |                                  |                           |
| <b>PRÊTS SUR CAPITAL IMMOBILIER AUTRES</b>                                                     |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2045                                           | 107 600                             | 559                              | 0,13                      | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>               |                                     |                                  |                           |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 2,400 % éch. 20/03/2055                                           | 20 000                              | 91                               | 0,02                      | PIMCO Funds: Global Investors                          |                                     |                                  |                           |
| 4,693 % éch. 25/02/2036                                                                        | 134                                 | 126                              | 0,03                      | 3,200 % éch. 20/09/2055                                           | 50 000                              | 270                              | 0,06                      | Series plc - Fonds PIMCO                               |                                     |                                  |                           |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                            |                                     |                                  |                           | 3,700 % éch. 20/03/2056                                           | 87 150                              | 518                              | 0,12                      | Credit Opportunities Bond Fund (c)                     | 992 063                             | 10 833                           | 2,43                      |
| 4,163 % éch. 25/01/2037                                                                        | 976                                 | 414                              | 0,09                      | Obligation internationale du gouvernement du Koweït               |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement                       | \$ 10 833                           | 2,43                             |                           |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                                               |                                     |                                  |                           | 4,804 % éch. 20/04/2033 (e)                                       | \$ 600                              | 599                              | 0,13                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,863 % éch. 25/05/2037                                                                        | 95                                  | 92                               | 0,02                      | Obligation internationale du gouvernement mexicain                |                                     |                                  |                           |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 19/03/2034                                           | € 600                               | 684                              | 0,15                      |                                                        |                                     |                                  |                           |
|                                                                                                |                                     |                                  |                           | 5,375 % éch. 22/03/2033                                           | \$ 1 700                            | 1 667                            | 0,37                      |                                                        |                                     |                                  |                           |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------------|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre                                      | Long  | 03/2027              | 96                    | \$ (16)                                 | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars                                          | Long  | 06/2027              | 196                   | (55)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre                                     | Long  | 12/2026              | 98                    | 23                                      | 0,01                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre    | Court | 09/2026              | 132                   | (131)                                   | (0,03)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre      | Court | 09/2026              | 23                    | (19)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre                                         | Court | 09/2026              | 113                   | (81)                                    | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 53                    | (92)                                    | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre                     | Court | 09/2026              | 6                     | (27)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre                                       | Court | 09/2026              | 3                     | 0                                       | 0,00                   |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 61                    | (18)                                    | (0,01)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Court | 09/2026              | 396                   | (106)                                   | (0,02)                 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Long  | 09/2026              | 306                   | 189                                     | 0,04                   |
| Contrats à terme standardisés sur Ultra du Trésor américain à 10 ans septembre                | Long  | 09/2026              | 365                   | 296                                     | 0,07                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre           | Long  | 09/2026              | 52                    | 72                                      | 0,02                   |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Long  | 09/2026              | 387                   | 1 077                                   | 0,24                   |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Court | 09/2026              | 21                    | (35)                                    | (0,01)                 |
|                                                                                               |       |                      |                       | \$ 1 077                                | 0,24                   |

### OPTIONS VENDUES

#### OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description                                                                                            | Prix<br>d'exercice | Date<br>d'expiration | Nombre de<br>contrats | Prime  | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------|-----------------|------------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026 | \$ 108,000         | 24/07/2026           | 5                     | \$ (1) | \$ 0            | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026 | 108,500            | 24/07/2026           | 5                     | (2)    | (1)             | 0,00                   |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026 | 109,500            | 24/07/2026           | 6                     | (1)    | (2)             | 0,00                   |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août 2026  | 111,000            | 24/07/2026           | 16                    | (4)    | (2)             | 0,00                   |



| Description                                                                                               | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nombre de contrats | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------|--------------|---------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | \$ 108,250      | 02/07/2026        | 5                  | \$ (1)  | \$ 0         | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750         | 02/07/2026        | 11                 | (2)     | 0            | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250         | 02/07/2026        | 5                  | (1)     | 0            | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,500         | 02/07/2026        | 11                 | (2)     | 0            | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,000         | 10/07/2026        | 5                  | (1)     | (1)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,750         | 10/07/2026        | 5                  | (1)     | 0            | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 108,750         | 17/07/2026        | 7                  | (2)     | (1)          | 0,00                |
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026 | 109,250         | 17/07/2026        | 6                  | (1)     | (1)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 110,250         | 17/07/2026        | 7                  | (1)     | (2)          | 0,00                |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT juillet 2026  | 111,000         | 17/07/2026        | 6                  | (1)     | 0            | 0,00                |
|                                                                                                           |                 |                   |                    | \$ (21) | \$ (10)      | 0,00                |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 1 067 0,24

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Entité de référence                                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| American International Group, Inc.                 | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 500                           | \$ (9)                            | 0,00                |
| AT&T, Inc.                                         | 1,000                | 20/12/2026      | 900                              | (11)                              | 0,00                |
| AT&T, Inc.                                         | 1,000                | 20/06/2028      | 1 000                            | 22                                | 0,01                |
| Boeing Co.                                         | 1,000                | 20/12/2026      | 500                              | 5                                 | 0,00                |
| Boeing Co.                                         | 1,000                | 20/06/2027      | 2 000                            | 136                               | 0,03                |
| Devon Energy Corp.                                 | 1,000                | 20/12/2026      | 200                              | 3                                 | 0,00                |
| Enbridge, Inc.                                     | 1,000                | 20/12/2026      | 900                              | (5)                               | 0,00                |
| Expedia Group, Inc.                                | 1,000                | 20/12/2026      | 300                              | (1)                               | 0,00                |
| General Motors Co.                                 | 5,000                | 20/12/2026      | 710                              | (124)                             | (0,03)              |
| Glencore Finance Europe Ltd.                       | 5,000                | 20/06/2031      | € 300                            | 0                                 | 0,00                |
| Hess Corp.                                         | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 1 200                         | 13                                | 0,00                |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. | 1,000                | 20/12/2026      | 200                              | (4)                               | 0,00                |
| Occidental Petroleum Corp.                         | 1,000                | 20/12/2030      | 900                              | 1                                 | 0,00                |
| Oracle Corp.                                       | 1,000                | 20/06/2030      | 200                              | (7)                               | 0,00                |
| Tesco PLC                                          | 1,000                | 20/12/2027      | € 1 050                          | 15                                | 0,01                |
| Tesco PLC                                          | 1,000                | 20/06/2028      | 100                              | 2                                 | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                | 20/12/2026      | \$ 1 800                         | (35)                              | (0,01)              |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                | 20/06/2028      | 1 100                            | 14                                | 0,00                |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                | 20/12/2028      | 300                              | 5                                 | 0,00                |
| Électricité de France S.A.                         | 1,000                | 20/06/2030      | € 500                            | 5                                 | 0,00                |
|                                                    |                      |                 |                                  | \$ 25                             | 0,01                |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Indice/Tranches                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-45 Index à 5 ans | 1,000 %              | 20/12/2030      | \$ 21 190                        | \$ 4                              | 0,00                |
| Indice CDX.IG-46 Index à 5 ans | 1,000                | 20/06/2031      | 6 450                            | 3                                 | 0,00                |
|                                |                      |                 |                                  | \$ 7                              | 0,00                |

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable        | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                           | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,500 %   | 18/03/2031      | £ 1 400           | \$ (40)                           | (0,01)              |
| À recevoir                        | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 18/03/2036      | 480               | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,325     | 31/08/2030      | \$ 6 150          | 109                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,500     | 20/06/2054      | 5 400             | 489                               | 0,11                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,555     | 28/08/2034      | 500               | 18                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,642     | 15/02/2055      | 500               | 47                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,655     | 15/02/2055      | 100               | 9                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,715     | 15/08/2035      | 10 415            | 193                               | 0,04                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,748     | 03/03/2036      | 600               | 14                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 18/12/2029      | 4 000             | 109                               | 0,02                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,750     | 15/05/2032      | 3 300             | 22                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,775     | 03/03/2036      | 600               | 12                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,807     | 15/02/2055      | 300               | 20                                | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,842     | 04/03/2030      | 700               | 3                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,848     | 15/02/2055      | 1 900             | 111                               | 0,03                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,915     | 15/02/2055      | 700               | 33                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,943     | 15/02/2055      | 700               | 30                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,945     | 15/02/2055      | 800               | 34                                | 0,01                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 3,975     | 15/11/2053      | 300               | 6                                 | 0,00                |
| À recevoir                        | SOFR USD composé-OIS à 1 jour  | 4,000     | 30/11/2030      | 2 040             | (7)                               | 0,00                |

## Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir                   | Indice de taux variable       | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 %   | 15/02/2036      | \$ 12 500         | \$ 42                             | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000     | 17/06/2056      | 2 600             | 33                                | 0,01                |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,085     | 15/11/2053      | 871               | 17                                | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,030    | 04/01/2027      | BRL 30 900        | (196)                             | (0,04)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 12,867    | 02/01/2031      | 2 800             | (18)                              | 0,00                |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,359    | 02/01/2029      | 8 700             | (33)                              | (0,01)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,402    | 02/01/2029      | 21 300            | (80)                              | (0,02)              |
| À payer                                            | CDI BRL à un an               | 13,926    | 04/01/2027      | 44 600            | (71)                              | (0,02)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,000     | 17/12/2035      | AUD 3 100         | (96)                              | (0,02)              |
| À payer                                            | BBR-BBSW AUD à 6 mois         | 4,250     | 19/03/2030      | 10 910            | (186)                             | (0,04)              |
| À recevoir                                         | EURIBOR EUR à 6 mois          | 0,000     | 17/03/2053      | € 3 850           | 2 150                             | 0,48                |
| À recevoir <sup>(3)</sup>                          | EURIBOR EUR à 6 mois          | 3,000     | 16/09/2056      | 2 240             | (3)                               | 0,00                |
|                                                    |                               |           |                 |                   | \$ 2 783                          | 0,62                |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                               |           |                 |                   | \$ 2 815                          | 0,63                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

<sup>(3)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 400,000   | 09/07/2026        | 727                              | \$ 7  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 400,000       | 13/07/2026        | 5 038                            | 35    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ 42 | \$ 0         | 0,00                |

#### OPTIONS VENDUES

##### OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description                                | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime   | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA          | Option de vente - USD contre KRW hors cote | KRW 1 350,000   | 09/07/2026        | 727                              | \$ (3)  | \$ 0         | 0,00                |
|              | Option de vente - USD contre KRW hors cote | 1 350,000       | 13/07/2026        | 5 038                            | (11)    | 0            | 0,00                |
|              |                                            |                 |                   |                                  | \$ (14) | \$ 0         | 0,00                |

#### SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                                 | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Prime  | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,004 %         | 08/07/2026        | 300                              | \$ (1) | \$ (1)       | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,284           | 08/07/2026        | 300                              | (1)    | 0            | 0,00                |
| JPM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,875           | 24/07/2026        | 300                              | 0      | 0            | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 4,135           | 24/07/2026        | 300                              | (1)    | (1)          | 0,00                |
|              |                                                             |                         |                                  |                 |                   |                                  | \$ (3) | \$ (2)       | 0,00                |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Entité de référence                                | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC          | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 %              | 20/12/2026      | \$ 200                           | \$ 1                   | \$ 0                              | \$ 1         | 0,00                |



SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION<sup>(1)</sup>

| Contrepartie | Indice/Tranches                                   | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel <sup>(2)</sup> | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000 %              | 20/12/2030      | € 900                            | \$ 203                 | \$ (12)                           | \$ 191       | 0,04                |
| BPS          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 000                            | 424                    | 2                                 | 426          | 0,10                |
| CBK          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 100                              | 23                     | (2)                               | 21           | 0,01                |
| GST          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 1 100                            | 230                    | 4                                 | 234          | 0,05                |
| JPM          | Indice iTraxx Crossover 44 Index 35-100 % à 5 ans | 5,000                | 20/12/2030      | 2 100                            | 445                    | 2                                 | 447          | 0,10                |
|              |                                                   |                      |                 |                                  | \$ 1 325               | \$ (6)                            | \$ 1 319     | 0,30                |

<sup>(1)</sup> Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

<sup>(2)</sup> Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

## CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 3 991             | \$ 2 854           | \$ 89                 | \$ 89                                   | 0,02                |
|              | 07/2026           | CNH             | 68                | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 565               | 333                | 12                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 40                | CAD 56             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 286               | NZD 507            | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 56                | \$ 40              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 507               | 287                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | ¥               | 1 863             | 12                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 66                | CNH 446            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 102               | 34                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD             | 1 446             | 1 007              | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | BRL             | 239               | 46                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CHF             | 66                | 84                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 1 659             | 1 892              | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | IDR             | 8 418 012         | 470                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 205               | 69                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 15 367            | 160                | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥               | 6 301             | 40                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | KRW             | 27 052            | 18                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | THB             | 2 297             | 70                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 8                 | BRL 40             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 225               | CNH 1 524          | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 99                | ILS 288            | 0                     | (2)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 456               | INR 43 250         | 1                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 113               | KRW 173 483        | 0                     | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 9                 | TWD 294            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 5 666             | \$ 345             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 25                | 8                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 890 910           | 49                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 2 076             | 64                 | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 285               | IDR 5 043 863      | 1                     | (6)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 32                | INR 3 085          | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           |                 | 10                | THB 328            | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 12/2026           |                 | 30                | IDR 538 803        | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BRC          | 07/2026           | ILS             | 246               | \$ 83              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | NZD             | 820               | 485                | 18                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | TRY             | 1 055             | 22                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 502               | CAD 693            | 0                     | (14)                                    | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 729               | TRY 34 783         | 6                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ZAR             | 27 985            | \$ 1 723           | 18                    | 0                                       | 0,01                |
| BSH          | 07/2026           | €               | 2 484             | 2 896              | 56                    | 0                                       | 0,01                |
|              | 07/2026           | ¥               | 33 389            | 210                | 5                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 496               | NZD 878            | 3                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | NZD             | 878               | \$ 497             | 0                     | (3)                                     | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 1 433             | BRL 7 347          | 0                     | (34)                                    | 0,01                |
| CBK          | 07/2026           | DKK             | 466               | \$ 73              | 1                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | €               | 661               | 770                | 15                    | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ILS             | 228               | 79                 | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | INR             | 10 204            | 108                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$              | 98                | IDR 1 765 023      | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 105               | INR 10 204         | 2                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 410               | PEN 1 387          | 0                     | (4)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           |                 | 10                | PLN 35             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | ILS             | 376               | \$ 130             | 4                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR             | 3 258 584         | 181                | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | INR             | 966               | 10                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | MXN             | 39                | 2                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB             | 2 293             | 69                 | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$              | 59                | IDR 1 045 804      | 0                     | (1)                                     | 0,00                |

# Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |      |      |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|------|------|--------|
| DUB          | 09/2026           | \$              | 2                 | PEN                | 8                     | \$                                      | 0                   | \$   | 0    | 0,00   |
|              | 10/2026           | PEN             | 3 679             | \$                 | 1 075                 |                                         | 4                   | (3)  | 1    | 0,00   |
|              | 12/2026           |                 | 2 870             |                    | 821                   |                                         | 0                   | (15) | (15) | 0,00   |
|              | 12/2026           | \$              | 82                | IDR                | 1 493 323             |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 269 867           | \$                 | 15                    |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | INR             | 3 754             |                    | 40                    |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 27                | INR                | 2 559                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 10                | PLN                | 36                    |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 13 013            | \$                 | 804                   | 11                                      | 0                   | 0    | 11   | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 2 128 585         |                    | 118                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
| FAR          | 09/2026           | \$              | 36                | IDR                | 653 643               |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 40                | INR                | 3 780                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | CNH             | 5 862             | \$                 | 862                   |                                         | 0                   | (2)  | (2)  | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 10 247            |                    | 13 779                | 179                                     | 0                   | 0    | 179  | 0,04   |
|              | 07/2026           | INR             | 3 695             |                    | 39                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | PEN             | 1 386             |                    | 410                   | 4                                       | 0                   | 0    | 4    | 0,00   |
|              | 07/2026           | SGD             | 1 490             |                    | 1 168                 | 16                                      | 0                   | 0    | 16   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 224               | CNH                | 1 516                 |                                         | 0                   | (1)  | (1)  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 39                | INR                | 3 695                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 481               | ¥                  | 77 772                |                                         | 0                   | (2)  | (2)  | 0,00   |
| GLM          | 07/2026           |                 | 181               | PLN                | 662                   |                                         | 0                   | (5)  | (5)  | 0,00   |
|              | 07/2026           | ZAR             | 18 539            | \$                 | 1 123                 |                                         | 0                   | (6)  | (6)  | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 188               |                    | 66                    | 3                                       | 0                   | 0    | 3    | 0,00   |
|              | 08/2026           | ¥               | 77 568            |                    | 481                   | 2                                       | 0                   | 0    | 2    | 0,00   |
|              | 08/2026           | PEN             | 2 426             |                    | 717                   | 7                                       | 0                   | 0    | 7    | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 862               | CNH                | 5 849                 |                                         | 2                   | 0    | 2    | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 9                 | £                  | 7                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 19                | INR                | 1 813                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 39 386            | \$                 | 26                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 155               | BRL                | 780                   |                                         | 0                   | (4)  | (4)  | 0,00   |
| IND JPM      | 07/2026           |                 | 3 802             | CAD                | 5 410                 | 11                                      | 0                   | 0    | 11   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 84                | IDR                | 1 508 576             |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 26                | KRW                | 39 380                |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 08/2026           | CAD             | 5 402             | \$                 | 3 802                 |                                         | 0                   | (11) | (11) | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 26                | INR                | 2 470                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 517 411         | \$                 | 84                    |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 44                |                    | 3                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 6 388             |                    | 198                   | 4                                       | 0                   | 0    | 4    | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 168               | IDR                | 3 014 306             |                                         | 0                   | (1)  | (1)  | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 105               | INR                | 10 066                | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
| MBC          | 07/2026           | DKK             | 834               | \$                 | 130                   | 3                                       | 0                   | 0    | 3    | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 16 378            |                    | 11 675                | 329                                     | 0                   | 0    | 329  | 0,08   |
|              | 07/2026           | £               | 28                |                    | 37                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | ILS             | 635               |                    | 213                   | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 15                | IDR                | 263 675               |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 402               | PLN                | 1 466                 |                                         | 0                   | (12) | (12) | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 49                | THB                | 1 630                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 08/2026           | ILS             | 647               | \$                 | 223                   | 5                                       | 0                   | 0    | 5    | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 1 112             | €                  | 974                   | 3                                       | 0                   | 0    | 3    | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 265 141           | \$                 | 15                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
| MYI          | 09/2026           | INR             | 2 282             |                    | 24                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           | MXN             | 140               |                    | 8                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 4 941             |                    | 151                   | 2                                       | 0                   | 0    | 2    | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 50                | INR                | 4 766                 |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           |                 | 1 374             | MXN                | 23 878                |                                         | 0                   | (16) | (16) | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 1 153             | \$                 | 807                   | 9                                       | 0                   | 0    | 9    | 0,00   |
|              | 07/2026           | CHF             | 352               |                    | 449                   | 13                                      | 0                   | 0    | 13   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 8 179             |                    | 9 494                 | 143                                     | 0                   | 0    | 143  | 0,03   |
|              | 07/2026           | £               | 641               |                    | 863                   | 12                                      | 0                   | 0    | 12   | 0,00   |
|              | 07/2026           | IDR             | 20 661            |                    | 1                     | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
| NSL          | 07/2026           | INR             | 3 769             |                    | 40                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | ¥               | 31 112            |                    | 196                   | 4                                       | 0                   | 0    | 4    | 0,00   |
|              | 07/2026           | KRW             | 113 584           |                    | 75                    | 2                                       | 0                   | 0    | 2    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 8 749             | AUD                | 12 680                | 36                                      | 0                   | 0    | 36   | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 257               | DKK                | 1 687                 | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 493               | €                  | 426                   | 0                                       | 0                   | (6)  | (6)  | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 62                | INR                | 5 932                 | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 12 680            | \$                 | 8 744                 |                                         | 0                   | (37) | (37) | (0,01) |
|              | 08/2026           | DKK             | 1 684             |                    | 257                   | 0                                       | 0                   | (1)  | (1)  | 0,00   |
|              | 09/2026           | THB             | 1 410             |                    | 42                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
| RYL          | 09/2026           | \$              | 165               | INR                | 15 823                | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 17                | \$                 | 23                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 558               | £                  | 421                   | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 78                | IDR                | 1 396 381             |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 62                | INR                | 5 987                 | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 159               | TRY                | 7 473                 | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 09/2026           | IDR             | 1 404 212         | \$                 | 78                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 09/2026           | \$              | 36                | IDR                | 638 484               |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 100               | €                  | 88                    | 0                                       | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 34                | IDR                | 611 548               |                                         | 0                   | 0    | 0    | 0,00   |
| SCX          | 07/2026           |                 | 82                | INR                | 7 850                 | 1                                       | 0                   | 0    | 1    | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 478               | ¥                  | 75 900                | 0                                       | 0                   | (11) | (11) | 0,00   |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| SOG          | 08/2026           | \$ 64           | INR 6 136         | \$ 1               | \$ 0                  | \$ 1                                    | 0,00                |
|              | 09/2026           | IDR 1 724 920   | \$ 96             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 2 276       | \$ 70             | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | \$ 91           | IDR 1 642 204     | 1                  | (1)                   | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | DKK 875         | \$ 136            | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | € 35 915        | 41 896            | 836                | 0                     | 836                                     | 0,19                |
|              | 07/2026           | £ 7             | 10                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | ¥ 81 016        | 510               | 11                 | 0                     | 11                                      | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 7 099        | AUD 10 288        | 29                 | 0                     | 29                                      | 0,01                |
|              | 07/2026           | 517             | CHF 418           | 2                  | 0                     | 2                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 361             | CNH 2 443         | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 07/2026           | 53 774          | € 47 274          | 275                | 0                     | 275                                     | 0,06                |
|              | 07/2026           | 1 152           | SGD 1 492         | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | AUD 10 288      | \$ 7 094          | 0                  | (30)                  | (30)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | CHF 417         | 517               | 0                  | (2)                   | (2)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | € 47 274        | 53 847            | 0                  | (275)                 | (275)                                   | (0,06)              |
| SSB          | 08/2026           | SGD 1 489       | 1 152             | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 10           | £ 7               | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | CAD 6 253       | \$ 4 535          | 127                | 0                     | 127                                     | 0,03                |
|              | 07/2026           | \$ 35           | CAD 49            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | 14 420          | £ 10 909          | 60                 | 0                     | 60                                      | 0,01                |
|              | 08/2026           | CAD 49          | \$ 35             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| UAG          | 08/2026           | € 1 110         | 1 268             | 0                  | (4)                   | (4)                                     | 0,00                |
|              | 08/2026           | £ 10 909        | 14 420            | 0                  | (60)                  | (60)                                    | (0,01)              |
|              | 07/2026           | \$ 10           | PLN 36            | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 09/2026           | THB 253         | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 407           | \$ (582)              | \$ 1 825                                | 0,41                |

### CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| BOA          | 07/2026           | € 7 718         | \$ 8 761          | \$ 0               | \$ (63)               | \$ (63)                                 | (0,01)              |
| BPS          | 07/2026           | 47              | \$ 53             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 07/2026           | \$ 40 932       | € 35 134          | 0                  | (763)                 | (763)                                   | (0,17)              |
| BSH          | 07/2026           | 38 670          | 33 167            | 0                  | (751)                 | (751)                                   | (0,17)              |
| CBK          | 07/2026           | 602             | 516               | 0                  | (12)                  | (12)                                    | 0,00                |
| FAR          | 07/2026           | € 30 978        | \$ 35 331         | 0                  | (87)                  | (87)                                    | (0,02)              |
|              | 08/2026           | \$ 35 378       | € 30 978          | 87                 | 0                     | 87                                      | 0,02                |
| MBC          | 07/2026           | € 33 179        | \$ 37 685         | 0                  | (249)                 | (249)                                   | (0,06)              |
|              | 07/2026           | \$ 1 337        | € 1 150           | 0                  | (21)                  | (21)                                    | (0,01)              |
|              | 08/2026           | € 46            | \$ 53             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | \$ 37 736       | € 33 179          | 249                | 0                     | 249                                     | 0,05                |
| SOG          | 07/2026           | € 33 179        | \$ 37 742         | 0                  | (192)                 | (192)                                   | (0,04)              |
|              | 07/2026           | \$ 40 986       | € 35 134          | 0                  | (817)                 | (817)                                   | (0,18)              |
|              | 08/2026           | 37 793          | 33 179            | 192                | 0                     | 192                                     | 0,04                |
|              |                   |                 |                   | \$ 528             | \$ (2 955)            | \$ (2 427)                              | (0,55)              |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution II :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$ 11 978       | £ 8 922           | \$ 0               | \$ (136)              | \$ (136)                                | (0,03)              |
| BOA                                                | 07/2026           | £ 84            | \$ 113            | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | 8 185           | 10 795            | 0                  | (69)                  | (69)                                    | (0,02)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 13 459       | £ 10 046          | 0                  | (126)                 | (126)                                   | (0,03)              |
|                                                    | 08/2026           | £ 25            | \$ 34             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 10 733       | £ 8 139           | 69                 | 0                     | 69                                      | 0,02                |
| BRC                                                | 07/2026           | £ 6             | \$ 8              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| CBK                                                | 07/2026           | 55              | 73                | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 15           | £ 11              | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           | £ 30            | \$ 39             | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 707          | £ 525             | 0                  | (9)                   | (9)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 39              | 30                | 0                  | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           | 12 859          | 9 583             | 0                  | (140)                 | (140)                                   | (0,03)              |
| MBC                                                | 07/2026           | £ 42            | \$ 57             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$ 325          | £ 244             | 1                  | (2)                   | (1)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £ 1 890         | \$ 2 488          | 0                  | (21)                  | (21)                                    | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 2 487        | £ 1 890           | 21                 | 0                     | 21                                      | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | £ 9 485         | \$ 12 554         | 1                  | (35)                  | (34)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 07/2026           | \$ 62           | £ 46              | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | 12 518          | 9 458             | 34                 | 0                     | 34                                      | 0,01                |
| SOG                                                | 07/2026           | £ 9 420         | \$ 12 444         | 0                  | (59)                  | (59)                                    | (0,01)              |
|                                                    | 08/2026           | \$ 12 443       | £ 9 420           | 59                 | 0                     | 59                                      | 0,01                |
| SSB                                                | 07/2026           | £ 133           | \$ 176            | 0                  | (1)                   | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$ 176          | £ 133             | 1                  | 0                     | 1                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |                   | \$ 189             | \$ (599)              | \$ (410)                                | (0,09)              |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |                   |                    |                       | \$ 306                                  | 0,07                |

## Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION                                                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,125 % éch. 29/10/2022 <sup>(a)</sup><br>5,250 % éch. 23/05/2023 <sup>(a)</sup> (d) | \$ 2 100 600                        | \$ 126 36                        | 0,03<br>0,01              |
| Total des Autres actifs financiers                                                                                             |                                     | \$ 162                           | 0,04                      |
| Total des Investissements                                                                                                      |                                     | \$ 473 075                       | 106,19                    |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                                         |                                     | \$ (27 566)                      | (6,19)                    |
| Actif net                                                                                                                      |                                     | \$ 445 509                       | 100,00                    |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (c) Affilié au Fonds.
- (d) Titre convertible conditionnel.
- (e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : 0,13 %) :

| Description de l'émetteur                           | Coupon  | Date<br>d'échéance | Date<br>d'achat | Coût     | Juste<br>valeur | En % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------|---------|--------------------|-----------------|----------|-----------------|------------------------|
| Ford Credit Canada Co. Cie Credit Ford Du Canada    | 4,916 % | 09/01/2031         | 06/01/2026      | \$ 943   | \$ 930          | 0,21                   |
| Goldman Sachs Group, Inc.                           | 3,641   | 05/03/2032         | 26/02/2026      | 658      | 630             | 0,14                   |
| Grifols S.A.                                        | 7,500   | 01/05/2030         | 20/08/2025      | 298      | 293             | 0,07                   |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït | 4,804   | 20/04/2033         | 13/04/2026      | 600      | 599             | 0,13                   |
|                                                     |         |                    |                 | \$ 2 499 | \$ 2 452        | 0,55                   |

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 2 004 \$ (31 décembre 2025 : 2 715 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 12 593 \$ (31 décembre 2025 : 12 194 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 1 780 \$ (31 décembre 2025 : 860 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 684                                                                                     | \$ 456 292                                                 | \$ 916                                                     | \$ 457 892   |
| Fonds d'investissement                        | 10 833                                                                                     | 0                                                          | 0                                                          | 10 833       |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (385)                                                                                      | 4 573                                                      | 0                                                          | 4 188        |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 162                                                        | 0                                                          | 162          |
| Totaux                                        | \$ 11 132                                                                                  | \$ 461 027                                                 | \$ 916                                                     | \$ 473 075   |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des<br>marchés actifs pour des<br>investissements identiques<br>(Niveau 1) | Autres données<br>significatives observables<br>(Niveau 2) | Données<br>significatives<br>non observables<br>(Niveau 3) | Juste valeur |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 725                                                                                     | \$ 353 817                                                 | \$ 941                                                     | \$ 355 483   |
| Fonds d'investissement                        | 10 794                                                                                     | 0                                                          | 0                                                          | 10 794       |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                          | 29 400                                                     | 0                                                          | 29 400       |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 64                                                                                         | 4 771                                                      | 4                                                          | 4 839        |
| Autres actifs financiers                      | 0                                                                                          | 0                                                          | 162                                                        | 162          |
| Totaux                                        | \$ 11 583                                                                                  | \$ 387 988                                                 | \$ 1 107                                                   | \$ 400 678   |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                           | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance    | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|----------------------------------------|----------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                    | 3,500 %        | 24/06/2026        | 08/09/2026         | \$ (936)         | \$ (937)                                 | (0,21)              |
| SCX                                    | 3,500          | 07/05/2026        | TBD <sup>(1)</sup> | (983)            | (988)                                    | (0,22)              |
| Total des Contrats de prise en pension |                |                   |                    |                  | \$ (1 925)                               | (0,43)              |

<sup>(1)</sup> Contrat de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (35)                                                    | \$ 0                    | \$ (35)                           | \$ 231                                                     | \$ (260)                | \$ (29)                           |
| BOA          | 129                                                        | 0                       | 129                               | 253                                                        | (270)                   | (17)                              |
| BPS          | (466)                                                      | 710                     | 244                               | 12                                                         | 0                       | 12                                |
| BRC          | 29                                                         | 0                       | 29                                | 675                                                        | (720)                   | (45)                              |
| BSH          | (724)                                                      | 980                     | 256                               | (47)                                                       | 110                     | 63                                |
| CBK          | 15                                                         | 0                       | 15                                | 32                                                         | 0                       | 32                                |
| DUB          | 11                                                         | 0                       | 11                                | (36)                                                       | 0                       | (36)                              |
| FAR          | 188                                                        | (280)                   | (92)                              | (458)                                                      | 660                     | 202                               |
| GLM          | (1)                                                        | 0                       | (1)                               | 85                                                         | 0                       | 85                                |
| GST          | 234                                                        | (260)                   | (26)                              | 4                                                          | 0                       | 4                                 |
| IND          | 3                                                          | 0                       | 3                                 | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 617                                                        | (630)                   | (13)                              | 125                                                        | 0                       | 125                               |
| MBC          | 157                                                        | 0                       | 157                               | 412                                                        | (520)                   | (108)                             |
| MYC          | 1                                                          | 90                      | 91                                | 13                                                         | 90                      | 103                               |
| MYI          | 1                                                          | (10)                    | (9)                               | (20)                                                       | (10)                    | (30)                              |
| NSL          | 2                                                          | 0                       | 2                                 | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| RYL          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 2                                                          | 0                       | 2                                 |
| SCX          | (8)                                                        | 0                       | (8)                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| SOG          | 30                                                         | 0                       | 30                                | 360                                                        | (270)                   | 90                                |
| SSB          | 123                                                        | 0                       | 123                               | 58                                                         | 0                       | 58                                |
| UAG          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | (32)                                                       | 0                       | (32)                              |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 58,66            | 57,85                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 28,50            | 22,25                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,68             | 0,58                 |
| Fonds d'investissement                                           | 2,10             | 2,45                 |
| Contrats de mise en pension                                      | S/O              | 6,67                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,32             | 0,21                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,73             | 0,87                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,86             | 0,72                 |
| Autres actifs financiers                                         | 0,03             | 0,04                 |
| Autres actifs                                                    | 7,12             | 8,36                 |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur                                                                     | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions                                                                       | 0,45             | 0,32                 |
| Obligations et billets privés                                                                         | 80,22            | 74,30                |
| Obligations et billets municipaux                                                                     | 0,07             | 0,08                 |
| Agences du gouvernement américain                                                                     | 10,43            | 5,63                 |
| Obligations du Trésor américain                                                                       | 4,85             | 3,25                 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux               | 0,51             | 0,60                 |
| Titres adossés à des actifs                                                                           | 0,29             | 0,35                 |
| Émissions souveraines                                                                                 | 5,81             | 5,68                 |
| Titres privilégiés                                                                                    | 0,15             | 0,18                 |
| Fonds d'investissement                                                                                | 2,43             | 2,74                 |
| Contrats de mise en pension                                                                           | S/O              | 7,48                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé                                      |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                                                         | 0,24             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                       |                  |                      |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | 0,00             | 0,00                 |

| Investissements à la juste valeur                                                                        | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés compensés                                                                 |                  |                      |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01             | 0,02                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,00             | 0,01                 |
| Swaps de taux d'intérêt                                                                                  | 0,62             | 0,77                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                                                                 |                  |                      |
| Options achetées                                                                                         |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,01                 |
| Options vendues                                                                                          |                  |                      |
| Options de change                                                                                        | 0,00             | 0,00                 |
| Swaptions de taux d'intérêt                                                                              | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00             | 0,00                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection                                         | 0,30             | 0,14                 |
| Contrats de change à terme                                                                               | 0,41             | (0,27)               |
| Contrats de change à terme couverts                                                                      | (0,64)           | 0,54                 |
| Autres actifs financiers                                                                                 | 0,04             | 0,04                 |
| Autres actifs et passifs à court terme                                                                   | (6,19)           | (1,88)               |
| Actif net                                                                                                | 100,00           | 100,00               |



| DESCRIPTION                                                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)                  | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers)         | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |         |      |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------------------|------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|---------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES                                                                        |                                     |                                  |                           |                     |                                                      |                                  |                           | FRANCE                        |                                             |                                  |                           |         |      |
| AUSTRALIE                                                                                 |                                     |                                  |                           |                     |                                                      |                                  |                           | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS    |                                             |                                  |                           |         |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                                |                                     |                                  |                           |                     |                                                      |                                  |                           | Red & Black Auto Lease France |                                             |                                  |                           |         |      |
| Latitude Australia Personal Loans Trust                                                   |                                     |                                  |                           | Bank of Nova Scotia |                                                      |                                  |                           | 2,513 % éch. 27/06/2039       | €                                           | 2 999                            | \$ 3 431                  | 0,10    |      |
| 5,303 % éch. 17/09/2033                                                                   | AUD                                 | 2 932                            | \$ 2 033                  | 0,06                | 4,638 % éch. 08/09/2028                              | \$ 2 400                         | \$ 2 412                  | 0,07                          |                                             |                                  |                           |         |      |
| Metro Finance Trust                                                                       |                                     |                                  |                           |                     | Canadian Imperial Bank of Commerce                   |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS               |                                  |                           |         |      |
| 5,370 % éch. 16/02/2033                                                                   |                                     | 13 122                           | 9 092                     | 0,26                | 4,243 % éch. 08/09/2028                              | 13 660                           | 13 618                    | 0,39                          | BNP Paribas S.A.                            |                                  |                           |         |      |
| Panorama Auto Trust                                                                       |                                     |                                  |                           |                     | 4,297 % éch. 26/06/2028                              | 10 100                           | 10 107                    | 0,29                          | 1,904 % éch. 30/09/2028                     | \$                               | 2 200                     | 2 128   | 0,06 |
| 5,170 % éch. 15/09/2033                                                                   |                                     | 6 874                            | 4 755                     | 0,13                | 4,438 % éch. 08/09/2028                              | 5 100                            | 5 113                     | 0,14                          | 3,500 % éch. 16/11/2027                     |                                  | 4 100                     | 4 049   | 0,11 |
| 5,230 % éch. 20/04/2034                                                                   |                                     | 20 306                           | 14 058                    | 0,40                | 4,568 % éch. 11/09/2027                              | 1 500                            | 1 502                     | 0,04                          | BPCE S.A.                                   |                                  |                           |         |      |
| 5,270 % éch. 15/03/2033                                                                   |                                     | 8 336                            | 5 777                     | 0,16                | Canadian Natural Resources Ltd.                      |                                  |                           |                               | 3,500 % éch. 23/10/2027                     |                                  | 4 125                     | 4 071   | 0,12 |
| 5,367 % éch. 20/05/2034                                                                   |                                     | 11 000                           | 7 621                     | 0,21                | 3,850 % éch. 01/06/2027                              | 18 300                           | 18 205                    | 0,51                          | 5,612 % éch. 19/10/2027                     |                                  | 2 500                     | 2 511   | 0,07 |
| Pepper SPARKZ Trust                                                                       |                                     |                                  |                           |                     | Enbridge, Inc.                                       |                                  |                           |                               | Crédit Agricole S.A.                        |                                  |                           |         |      |
| 5,300 % éch. 15/01/2033                                                                   |                                     | 3 393                            | 2 352                     | 0,07                | 5,250 % éch. 05/04/2027                              | 5 500                            | 5 532                     | 0,16                          | 4,125 % éch. 10/01/2027                     |                                  | 2 500                     | 2 497   | 0,07 |
| Plenti Auto ABS                                                                           |                                     |                                  |                           |                     | Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust |                                  |                           |                               | 4,400 % éch. 06/07/2027                     | AUD                              | 300                       | 206     | 0,01 |
| 5,399 % éch. 12/08/2033                                                                   |                                     | 3 105                            | 2 154                     | 0,06                | 3,875 % éch. 20/03/2027                              | 6 500                            | 6 475                     | 0,18                          | 4,848 % éch. 11/09/2028                     | \$                               | 5 000                     | 5 030   | 0,14 |
| Plenti PL & Green ABS Trust                                                               |                                     |                                  |                           |                     | Rogers Communications, Inc.                          |                                  |                           |                               | Société Générale S.A.                       |                                  |                           |         |      |
| 5,276 % éch. 11/07/2037                                                                   |                                     | 893                              | 618                       | 0,02                | 3,200 % éch. 15/03/2027                              | 8 400                            | 8 323                     | 0,24                          | 2,797 % éch. 19/01/2028                     |                                  | 1 500                     | 1 486   | 0,04 |
|                                                                                           |                                     |                                  | 48 460                    | 1,37                | Royal Bank of Canada                                 |                                  |                           |                               | 4,729 % éch. 19/02/2027                     |                                  | 500                       | 502     | 0,01 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                             |                                     |                                  |                           |                     | 4,456 % éch. 27/03/2028                              | 13 000                           | 13 037                    | 0,37                          | 5,250 % éch. 19/02/2027                     |                                  | 800                       | 804     | 0,02 |
| SGSP Australia Assets Pty. Ltd.                                                           |                                     |                                  |                           |                     | 4,492 % éch. 18/10/2028                              | 3 900                            | 3 914                     | 0,11                          | 5,292 % éch. 19/01/2028                     |                                  | 17 396                    | 17 499  | 0,50 |
| 3,250 % éch. 29/07/2026                                                                   | \$                                  | 1 000                            | 1 000                     | 0,03                | Total Canada                                         |                                  | 90 036                    | 2,55                          |                                             |                                  |                           | 40 783  | 1,15 |
| 3,500 % éch. 07/07/2027                                                                   |                                     | 6 848                            | 6 771                     | 0,19                | ILES CAÏMANS                                         |                                  |                           |                               |                                             |                                  |                           | 44 214  | 1,25 |
| Transurban Finance Co. Pty. Ltd.                                                          |                                     |                                  |                           |                     | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                           |                                  |                           |                               | ALLEMAGNE                                   |                                  |                           |         |      |
| 3,375 % éch. 22/03/2027                                                                   |                                     | 200                              | 198                       | 0,01                | Bain Capital Credit CLO Ltd.                         |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS               |                                  |                           |         |      |
| Woodside Finance Ltd.                                                                     |                                     |                                  |                           |                     | 4,702 % éch. 21/10/2034                              | 9 800                            | 9 804                     | 0,28                          | Deutsche Bank AG                            |                                  |                           |         |      |
| 3,700 % éch. 15/09/2026                                                                   |                                     | 26 900                           | 26 849                    | 0,76                | 4,816 % éch. 23/10/2034                              | 6 400                            | 6 407                     | 0,18                          | 2,311 % éch. 16/11/2027                     |                                  | 19 000                    | 18 844  | 0,53 |
| 4,900 % éch. 19/05/2028                                                                   |                                     | 700                              | 703                       | 0,02                | Benefit Street Partners CLO Ltd.                     |                                  |                           |                               | 2,552 % éch. 07/01/2028                     |                                  | 7 300                     | 7 228   | 0,20 |
|                                                                                           |                                     |                                  | 35 521                    | 1,01                | 4,825 % éch. 20/04/2035                              | 13 400                           | 13 407                    | 0,38                          | 4,847 % éch. 16/11/2027                     |                                  | 1 700                     | 1 703   | 0,05 |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |                     | Marble Point CLO Ltd.                                |                                  |                           |                               | 5,706 % éch. 08/02/2028                     |                                  | 4 900                     | 4 935   | 0,14 |
| Blackwattle RMBS Trust                                                                    |                                     |                                  |                           |                     | 4,887 % éch. 25/07/2034                              | 13 400                           | 13 415                    | 0,38                          | Total Allemagne                             |                                  |                           | 32 710  | 0,92 |
| 5,049 % éch. 12/12/2056                                                                   | AUD                                 | 248                              | 172                       | 0,00                | Riserva CLO Ltd.                                     |                                  |                           |                               | IRLANDE                                     |                                  |                           |         |      |
| FirstMac Mortgage Funding Trust                                                           |                                     |                                  |                           |                     | 4,725 % éch. 18/01/2034                              | 9 244                            | 9 249                     | 0,26                          | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                  |                                  |                           |         |      |
| 5,030 % éch. 24/09/2052                                                                   |                                     | 2 402                            | 1 660                     | 0,05                | Sound Point CLO Ltd.                                 |                                  |                           |                               | AlbaCore Euro CLO DAC                       |                                  |                           |         |      |
| 5,380 % éch. 16/09/2056                                                                   |                                     | 10 958                           | 7 589                     | 0,21                | 5,087 % éch. 18/04/2031                              | 856                              | 857                       | 0,02                          | 3,194 % éch. 15/07/2035                     | €                                | 15 337                    | 17 577  | 0,50 |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust                                                  |                                     |                                  |                           |                     | Symphony CLO Ltd.                                    |                                  |                           |                               | Ares European CLO DAC                       |                                  |                           |         |      |
| 5,000 % éch. 15/08/2057                                                                   |                                     | 14 428                           | 9 992                     | 0,28                | 4,725 % éch. 19/04/2034                              | 12 900                           | 12 911                    | 0,37                          | 3,512 % éch. 15/07/2037                     |                                  | 2 900                     | 3 318   | 0,09 |
| 5,167 % éch. 13/11/2057                                                                   |                                     | 4 500                            | 3 118                     | 0,09                | 4,823 % éch. 15/10/2035                              | 6 300                            | 6 308                     | 0,18                          | Black Diamond CLO DAC                       |                                  |                           |         |      |
| 5,300 % éch. 15/08/2057                                                                   |                                     | 12 574                           | 8 701                     | 0,25                | Trinitas CLO Ltd.                                    |                                  |                           |                               | 3,263 % éch. 15/05/2032                     |                                  | 424                       | 485     | 0,01 |
| Liberty Trust                                                                             |                                     |                                  |                           |                     | 4,825 % éch. 20/10/2034                              | 13 500                           | 13 516                    | 0,38                          | BNPP AM Euro CLO DAC                        |                                  |                           |         |      |
| 5,405 % éch. 25/09/2056                                                                   |                                     | 5 507                            | 3 821                     | 0,11                | Whetstone Park CLO Ltd.                              |                                  |                           |                               | 2,804 % éch. 15/04/2031                     |                                  | 1 235                     | 1 409   | 0,04 |
| ORDE Trust                                                                                |                                     |                                  |                           |                     | 4,745 % éch. 20/01/2035                              | 13 600                           | 13 609                    | 0,38                          | Cairn CLO DAC                               |                                  |                           |         |      |
| 5,456 % éch. 11/06/2056                                                                   |                                     | 13 906                           | 9 648                     | 0,27                | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                  |                           |                               | 3,434 % éch. 15/01/2040                     |                                  | 3 300                     | 3 776   | 0,11 |
| Pepper Residential Securities Trust                                                       |                                     |                                  |                           |                     | Avolon Holdings Funding Ltd.                         |                                  |                           |                               | Capital Four CLO DAC                        |                                  |                           |         |      |
| 5,299 % éch. 12/07/2067                                                                   |                                     | 577                              | 400                       | 0,01                | 3,250 % éch. 15/02/2027                              | 3 364                            | 3 336                     | 0,09                          | 3,415 % éch. 25/10/2038                     |                                  | 13 400                    | 15 339  | 0,43 |
| Project Cashmere                                                                          |                                     |                                  |                           |                     | 4,200 % éch. 15/04/2029                              | 2 000                            | 1 965                     | 0,06                          | CVC Cordatus Loan Fund DAC                  |                                  |                           |         |      |
| 4,543 % éch. 30/12/2057 (b)                                                               |                                     | 19 700                           | 13 603                    | 0,38                | 4,950 % éch. 15/01/2028                              | 2 475                            | 2 481                     | 0,07                          | 3,066 % éch. 25/04/2036                     |                                  | 12 500                    | 14 300  | 0,41 |
| Resimac Premier Trust                                                                     |                                     |                                  |                           |                     | 6,375 % éch. 04/05/2028                              | 6 600                            | 6 772                     | 0,19                          | 3,285 % éch. 23/01/2039                     |                                  | 11 600                    | 13 282  | 0,38 |
| 5,093 % éch. 11/02/2058                                                                   |                                     | 4 400                            | 3 049                     | 0,09                | QNB Finance Ltd.                                     |                                  |                           |                               | Harvest CLO DAC                             |                                  |                           |         |      |
| Sapphire Trust Central Finance                                                            |                                     |                                  |                           |                     | 4,150 % éch. 23/07/2027                              | 13 800                           | 13 767                    | 0,39                          | 3,523 % éch. 25/07/2037 (b)                 |                                  | 8 300                     | 9 489   | 0,27 |
| 4,999 % éch. 12/02/2067                                                                   |                                     | 313                              | 217                       | 0,01                | 4,221 % éch. 26/08/2027                              | 16 700                           | 16 660                    | 0,47                          | Invesco Euro CLO DAC                        |                                  |                           |         |      |
| Triton Bond Trust                                                                         |                                     |                                  |                           |                     | 4,538 % éch. 19/09/2027                              | 19 100                           | 19 095                    | 0,54                          | 3,277 % éch. 15/07/2037                     |                                  | 11 200                    | 12 821  | 0,36 |
| 5,000 % éch. 15/02/2058                                                                   |                                     | 6 031                            | 4 177                     | 0,12                | SRC Sukuk Ltd.                                       |                                  |                           |                               | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC |                                  |                           |         |      |
| 5,250 % éch. 15/02/2058                                                                   |                                     | 8 500                            | 5 872                     | 0,17                | 5,000 % éch. 27/02/2028                              | 200                              | 201                       | 0,01                          | 3,085 % éch. 25/10/2034                     |                                  | 11 200                    | 12 798  | 0,36 |
| 5,299 % éch. 12/03/2057                                                                   |                                     | 8 383                            | 5 804                     | 0,16                | Suci Second Investment Co.                           |                                  |                           |                               | OCP Euro CLO DAC                            |                                  |                           |         |      |
|                                                                                           |                                     |                                  | 77 823                    | 2,20                | 4,375 % éch. 10/09/2027                              | 7 100                            | 7 079                     | 0,20                          | 3,058 % éch. 20/04/2033                     |                                  | 3 863                     | 4 419   | 0,13 |
| Total Australie                                                                           |                                     |                                  | 161 804                   | 4,58                | Total Îles Caïmans                                   |                                  | 170 839                   | 4,83                          | 3,513 % éch. 15/04/2037                     |                                  | 13 000                    | 14 863  | 0,42 |
| BERMUDES                                                                                  |                                     |                                  |                           |                     | CHILI                                                |                                  |                           |                               | Palmer Square European Loan Funding DAC     |                                  |                           |         |      |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                                |                                     |                                  |                           |                     | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                        |                                  |                           |                               | 3,054 % éch. 15/10/2034                     |                                  | 7 195                     | 8 225   | 0,23 |
| Symphony CLO Ltd.                                                                         |                                     |                                  |                           |                     | Enel Americas S.A.                                   |                                  |                           |                               | Toro European CLO DAC                       |                                  |                           |         |      |
| 4,816 % éch. 23/10/2035                                                                   | \$                                  | 7 100                            | 7 109                     | 0,20                | 4,000 % éch. 25/10/2026                              | 7 400                            | 7 387                     | 0,21                          | 3,194 % éch. 15/07/2034                     |                                  | 6 476                     | 7 412   | 0,21 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                             |                                     |                                  |                           |                     | ÉMISSIONS SOUVERAINES                                |                                  |                           |                               |                                             |                                  |                           | 139 513 | 3,95 |
| Bacardi Ltd.                                                                              |                                     |                                  |                           |                     | Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos       |                                  |                           |                               | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS               |                                  |                           |         |      |
| 2,750 % éch. 15/07/2026                                                                   |                                     | 1 450                            | 1 449                     | 0,04                | 4,700 % éch. 01/09/2030                              | CLP 2 520 000                    | 2 699                     | 0,08                          | AerCap Ireland Capital DAC                  |                                  |                           |         |      |
| Total Bermudes                                                                            |                                     |                                  | 8 558                     | 0,24                | 5,000 % éch. 01/10/2028                              | 490 000                          | 535                       | 0,01                          | 2,450 % éch. 29/10/2026                     | \$                               | 18 470                    | 18 359  | 0,52 |
| CANADA                                                                                    |                                     |                                  |                           |                     | 5,800 % éch. 01/10/2029                              | 1 345 000                        | 1 501                     | 0,04                          | 3,650 % éch. 21/07/2027                     |                                  | 2 100                     | 2 084   | 0,06 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                             |                                     |                                  |                           |                     | Obligation internationale du gouvernement chilien    |                                  |                           |                               | 6,100 % éch. 15/01/2027                     |                                  | 5 330                     | 5 370   | 0,15 |
| Banque de Montréal                                                                        |                                     |                                  |                           |                     | 2,750 % éch. 31/01/2027                              | \$ 2 374                         | 2 352                     | 0,07                          |                                             |                                  |                           | 25 813  | 0,73 |
| 4,709 % éch. 07/12/2027                                                                   | CAD                                 | 2 500                            | 1 798                     | 0,05                | Total Chili                                          |                                  | 14 474                    | 0,41                          | Total Irlande                               |                                  |                           | 165 326 | 4,68 |

## Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ISRAËL</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>MULTINATIONALES</b>                                      |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>         |                                     |                                  |                           |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>Korea National Oil Corp.</b>      |                                     |                                  |                           |
| Bank Hapoalim B.M.                                 |                                     |                                  |                           | NXP BV                                                      |                                     |                                  |                           | 4,705 % éch. 14/11/2026              | \$ 2 700                            | \$ 2 709                         | 0,08                      |
| 4,722 % éch. 14/07/2029                            | \$ 7 900                            | \$ 7 807                         | 0,22                      | 3,150 % éch. 01/05/2027                                     | \$ 7 600                            | \$ 7 522                         | 0,21                      | Total Corée du Sud                   |                                     | 8 116                            | 0,23                      |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.                          |                                     |                                  |                           | <b>PAYS-BAS</b>                                             |                                     |                                  |                           | <b>ESPAGNE</b>                       |                                     |                                  |                           |
| 5,125 % éch. 27/07/2027                            | 7 400                               | 7 416                            | 0,21                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>   |                                     |                                  |                           |
| 5,343 % éch. 29/06/2029                            | 500                                 | 502                              | 0,01                      | ABN AMRO Bank NV                                            |                                     |                                  |                           | Auto ABS Spanish Loans               |                                     |                                  |                           |
| Israel Electric Corp. Ltd.                         |                                     |                                  |                           | 4,327 % éch. 24/02/2027                                     | £ 11 500                            | 15 281                           | 0,43                      | 2,521 % éch. 28/02/2032              | € 899                               | 1 028                            | 0,03                      |
| 4,250 % éch. 14/08/2028                            | 5 700                               | 5 608                            | 0,16                      | 4,639 % éch. 03/12/2028                                     | \$ 20 850                           | 20 935                           | 0,59                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |
| 7,750 % éch. 15/12/2027                            | 3 050                               | 3 172                            | 0,09                      | Cooperatieve Rabobank UA                                    |                                     |                                  |                           | Banco Santander S.A.                 |                                     |                                  |                           |
| 7,875 % éch. 15/12/2026                            | 400                                 | 405                              | 0,01                      | 1,980 % éch. 15/12/2027                                     | 4 900                               | 4 847                            | 0,14                      | 4,622 % éch. 15/04/2029              | \$ 2 600                            | 2 608                            | 0,07                      |
| Total Israël                                       |                                     | 24 910                           | 0,70                      | ENEL Finance International NV                               |                                     |                                  |                           | 4,752 % éch. 15/07/2028              | 6 800                               | 6 837                            | 0,19                      |
| <b>ITALIE</b>                                      |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 25/05/2027                                     | 4 600                               | 4 562                            | 0,13                      | 5,588 % éch. 08/08/2028              | 1 000                               | 1 018                            | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 15/06/2027                                     | 800                                 | 801                              | 0,02                      | Telefonica Emisiones S.A.            |                                     |                                  |                           |
| Intesa Sanpaolo SpA                                |                                     |                                  |                           | ING Groep NV                                                |                                     |                                  |                           | 4,103 % éch. 08/03/2027              | 13 300                              | 13 249                           | 0,38                      |
| 3,875 % éch. 14/07/2027                            | 1 300                               | 1 292                            | 0,04                      | 4,017 % éch. 28/03/2028                                     | 2 000                               | 1 993                            | 0,06                      |                                      |                                     | 23 712                           | 0,67                      |
| <b>JAPON</b>                                       |                                     |                                  |                           | JDE Peet's NV                                               |                                     |                                  |                           | Total Espagne                        |                                     | 24 740                           | 0,70                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | 1,375 % éch. 15/01/2027                                     | 6 352                               | 6 235                            | 0,18                      | <b>SUEDE</b>                         |                                     |                                  |                           |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.               |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     | 55 930                           | 1,58                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |
| 1,538 % éch. 20/07/2027                            | 3 743                               | 3 737                            | 0,11                      | <b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS</b> |                                     |                                  |                           | <b>Swedbank AB</b>                   |                                     |                                  |                           |
| Mizuho Financial Group, Inc.                       |                                     |                                  |                           | <b>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX</b>                   |                                     |                                  |                           | 5,337 % éch. 20/09/2027              | 1 800                               | 1 820                            | 0,05                      |
| 4,486 % éch. 13/07/2030 (b)                        | 6 100                               | 6 103                            | 0,17                      | Domi BV                                                     |                                     |                                  |                           | <b>SUISSE</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 4,707 % éch. 13/05/2031                            | 5 836                               | 5 880                            | 0,17                      | 2,892 % éch. 15/02/2057                                     | € 7 031                             | 8 035                            | 0,23                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |
| Nomura Holdings, Inc.                              |                                     |                                  |                           | Total Pays-Bas                                              |                                     | 63 965                           | 1,81                      | UBS Group AG                         |                                     |                                  |                           |
| 4,886 % éch. 02/07/2027                            | 5 864                               | 5 910                            | 0,17                      | <b>NORVÈGE</b>                                              |                                     |                                  |                           | 1,494 % éch. 10/08/2027              | 5 000                               | 4 983                            | 0,14                      |
| NTT Finance Corp.                                  |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | <b>ÉMIRATS ARABES UNIS</b>           |                                     |                                  |                           |
| 4,465 % éch. 20/06/2029 (b)                        | 15 000                              | 15 003                           | 0,42                      | Var Energi ASA                                              |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |
| 4,620 % éch. 16/07/2028                            | 5 000                               | 4 988                            | 0,14                      | 5,000 % éch. 18/05/2027                                     | \$ 3 000                            | 3 009                            | 0,08                      | Emirates NBD Bank PJSC               |                                     |                                  |                           |
| 4,713 % éch. 16/07/2028                            | 13 100                              | 13 206                           | 0,37                      | <b>PANAMA</b>                                               |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 29/06/2031              | 7 600                               | 7 576                            | 0,21                      |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.                    |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | <b>ROYAUME-UNI</b>                   |                                     |                                  |                           |
| 4,388 % éch. 11/09/2028                            | 400                                 | 402                              | 0,01                      | Obligation internationale du gouvernement panaméen          |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>   |                                     |                                  |                           |
| Tohoku Electric Power Co., Inc.                    |                                     |                                  |                           | 3,875 % éch. 17/03/2028                                     | 1 800                               | 1 775                            | 0,05                      | Curzon Mortgages PLC                 |                                     |                                  |                           |
| 4,324 % éch. 04/03/2031                            | 3 500                               | 3 423                            | 0,10                      | 8,875 % éch. 30/09/2027                                     | 10 018                              | 10 531                           | 0,30                      | 4,592 % éch. 28/07/2049              | £ 6 100                             | 8 099                            | 0,23                      |
| Total Japon                                        |                                     | 58 652                           | 1,66                      | Total Panama                                                |                                     | 12 306                           | 0,35                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b> |                                     |                                  |                           |
| <b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES</b>                |                                     |                                  |                           | <b>PORTUGAL</b>                                             |                                     |                                  |                           | Barclays PLC                         |                                     |                                  |                           |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                 |                                     |                                  |                           | <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                          |                                     |                                  |                           | 2,279 % éch. 24/11/2027              | \$ 7 100                            | 7 039                            | 0,20                      |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                       |                                     |                                  |                           | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A.           |                                     |                                  |                           | 4,565 % éch. 24/05/2030              | 1 000                               | 1 002                            | 0,03                      |
| 4,656 % éch. 23/04/2035                            | 12 300                              | 12 314                           | 0,35                      | 2,918 % éch. 25/10/2035                                     | € 1 835                             | 2 100                            | 0,06                      | 5,128 % éch. 12/03/2028              | 9 900                               | 9 960                            | 0,28                      |
| 4,814 % éch. 22/04/2035                            | 21 500                              | 21 519                           | 0,61                      | <b>QATAR</b>                                                |                                     |                                  |                           | 5,518 % éch. 13/09/2027              | 5 374                               | 5 390                            | 0,15                      |
| 4,840 % éch. 17/07/2035                            | 12 700                              | 12 712                           | 0,36                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 5,674 % éch. 12/03/2028              | 4 975                               | 5 016                            | 0,14                      |
| Total Jersey, Îles Anglo-Normandes                 |                                     | 46 545                           | 1,32                      | QatarEnergy                                                 |                                     |                                  |                           | HSBC Holdings PLC                    |                                     |                                  |                           |
| <b>KAZAKHSTAN</b>                                  |                                     |                                  |                           | 4,625 % éch. 23/06/2029                                     | \$ 3 900                            | 3 876                            | 0,11                      | 2,013 % éch. 22/09/2028              | 1 000                               | 969                              | 0,03                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | QatarEnergy LNG                                             |                                     |                                  |                           | 4,041 % éch. 13/03/2028              | 7 500                               | 7 473                            | 0,21                      |
| Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.      |                                     |                                  |                           | 6,332 % éch. 30/09/2027                                     | 1 889                               | 1 902                            | 0,05                      | 4,668 % éch. 19/11/2028              | 2 700                               | 2 714                            | 0,08                      |
| 4,000 % éch. 15/08/2026                            | 1 250                               | 1 249                            | 0,03                      | Total Qatar                                                 |                                     | 5 778                            | 0,16                      | 4,755 % éch. 09/06/2028              | 37 000                              | 37 050                           | 1,05                      |
| <b>LIBERIA</b>                                     |                                     |                                  |                           | <b>ROUMANIE</b>                                             |                                     |                                  |                           | 5,597 % éch. 17/05/2028              | 2 000                               | 2 018                            | 0,06                      |
| <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>               |                                     |                                  |                           | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | Imperial Brands Finance PLC          |                                     |                                  |                           |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.                       |                                     |                                  |                           | Obligation internationale du gouvernement roumain           |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 26/07/2026              | 800                                 | 799                              | 0,02                      |
| 5,375 % éch. 15/07/2027                            | 4 912                               | 4 923                            | 0,14                      | 5,250 % éch. 25/11/2027                                     | 1 100                               | 1 104                            | 0,03                      | 4,500 % éch. 30/06/2028              | 13 500                              | 13 470                           | 0,38                      |
| 5,500 % éch. 01/04/2028                            | 3 500                               | 3 534                            | 0,10                      | <b>ARABIE SAOUDITE</b>                                      |                                     |                                  |                           | Lloyds Banking Group PLC             |                                     |                                  |                           |
| 7,500 % éch. 15/10/2027                            | 1 000                               | 1 036                            | 0,03                      | <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                                |                                     |                                  |                           | 3,574 % éch. 07/11/2028              | 7 600                               | 7 501                            | 0,21                      |
| Total Liberia                                      |                                     | 9 493                            | 0,27                      | Obligation internationale du gouvernement saoudien          |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 18/03/2028              | 2 900                               | 2 885                            | 0,08                      |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                  |                                     |                                  |                           | 0,750 % éch. 09/07/2027                                     | € 3 900                             | 4 360                            | 0,13                      | 5,188 % éch. 07/08/2027              | 3 456                               | 3 460                            | 0,10                      |
| <b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS</b>                 |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 13/01/2028                                     | \$ 24 300                           | 24 470                           | 0,69                      | 5,215 % éch. 05/01/2028              | 3 200                               | 3 218                            | 0,09                      |
| First Mobility SARL                                |                                     |                                  |                           | Total Arabie saoudite                                       |                                     | 28 830                           | 0,82                      | 5,462 % éch. 05/01/2028              | 2 800                               | 2 815                            | 0,08                      |
| 2,809 % éch. 14/10/2032                            | € 11 301                            | 12 941                           | 0,37                      | <b>CORÉE DU SUD</b>                                         |                                     |                                  |                           | Nationwide Building Society          |                                     |                                  |                           |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 4,918 % éch. 16/02/2028              | 3 900                               | 3 916                            | 0,11                      |
| Eagle Funding Luxco SARL                           |                                     |                                  |                           | Hanwha Solutions Corp.                                      |                                     |                                  |                           | NatWest Group PLC                    |                                     |                                  |                           |
| 5,500 % éch. 17/08/2030                            | \$ 15 900                           | 15 984                           | 0,45                      | 4,731 % éch. 13/10/2028                                     | 2 000                               | 2 038                            | 0,06                      | 5,583 % éch. 01/03/2028              | 11 697                              | 11 783                           | 0,33                      |
| Total Luxembourg                                   |                                     | 28 925                           | 0,82                      | SK Hynix, Inc.                                              |                                     |                                  |                           | NatWest Markets PLC                  |                                     |                                  |                           |
| <b>MEXIQUE</b>                                     |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 16/01/2027                                     | 3 351                               | 3 369                            | 0,09                      | 4,528 % éch. 17/05/2027              | 300                                 | 301                              | 0,01                      |
| <b>ÉMISSIONS SOUVERAINES</b>                       |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     | 5 407                            | 0,15                      | 4,557 % éch. 17/05/2027              | 4 918                               | 4 938                            | 0,14                      |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain |                                     |                                  |                           | <b>CORÉE DU SUD</b>                                         |                                     |                                  |                           | 4,587 % éch. 21/03/2028              | 3 400                               | 3 423                            | 0,10                      |
| 3,750 % éch. 11/01/2028                            | 16 100                              | 15 931                           | 0,45                      | <b>OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS</b>                        |                                     |                                  |                           | 4,768 % éch. 17/05/2029              | 1 023                               | 1 033                            | 0,03                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 4,789 % éch. 21/03/2028              | 9 400                               | 9 443                            | 0,27                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | Rolls-Royce PLC                      |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 5,750 % éch. 15/10/2027              | 800                                 | 810                              | 0,02                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | Santander UK Group Holdings PLC      |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                                             |                                     |                                  |                           | 2,469 % éch. 11/01/2028              | 6 000                               | 5 931                            | 0,17                      |

| DESCRIPTION                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Smith & Nephew PLC                                                                     | \$ 1 400                            | \$ 1 405                         | 0,04                      | Alaska Airlines Pass-Through Trust      | \$ 1 138                            | \$ 1 138                         | 0,03                      | Equitable America Global Funding             | \$ 2 460                            | \$ 2 457                         | 0,07                      |
| 5,150 % éch. 20/03/2027                                                                |                                     |                                  |                           | 4,800 % éch. 15/02/2029                 |                                     |                                  |                           | 4,348 % éch. 15/09/2027                      |                                     |                                  |                           |
| Standard Chartered PLC                                                                 |                                     |                                  |                           | American Honda Finance Corp.            |                                     |                                  |                           | Eversource Energy                            |                                     |                                  |                           |
| 4,798 % éch. 14/05/2028                                                                | 5 063                               | 5 089                            | 0,14                      | 4,279 % éch. 19/11/2027                 | 3 100                               | 3 096                            | 0,09                      | 2,900 % éch. 01/03/2027                      | 2 900                               | 2 871                            | 0,08                      |
| 5,657 % éch. 08/02/2028                                                                | 3 100                               | 3 127                            | 0,09                      | 4,358 % éch. 13/08/2027                 | 16 200                              | 16 217                           | 0,46                      | FactSet Research Systems, Inc.               |                                     |                                  |                           |
| 5,688 % éch. 14/05/2028                                                                | 900                                 | 909                              | 0,02                      | 4,368 % éch. 08/03/2027                 | 6 700                               | 6 711                            | 0,19                      | 2,900 % éch. 01/03/2027                      | 5 600                               | 5 529                            | 0,16                      |
| 7,767 % éch. 16/11/2028                                                                | 200                                 | 208                              | 0,01                      | 4,408 % éch. 12/03/2027                 | 3 000                               | 3 006                            | 0,08                      | Fidelity National Information Services, Inc. |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,502 % éch. 09/07/2027                 | 5 400                               | 5 417                            | 0,15                      | 4,450 % éch. 10/03/2028                      | 2 700                               | 2 691                            | 0,08                      |
|                                                                                        | 165 095                             | 4,67                             |                           | American Tower Corp.                    |                                     |                                  |                           | 4,848 % éch. 10/03/2029                      | 4 700                               | 4 736                            | 0,13                      |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           | 2,750 % éch. 15/01/2027                 | 800                                 | 793                              | 0,02                      | Fifth Third Bank N.A.                        |                                     |                                  |                           |
| Atlas Funding PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | 3,550 % éch. 15/07/2027                 | 11 375                              | 11 278                           | 0,32                      | 4,440 % éch. 28/01/2028                      | 1 400                               | 1 401                            | 0,04                      |
| 4,563 % éch. 20/01/2068                                                                | £ 4 300                             | 5 718                            | 0,16                      | 3,650 % éch. 15/03/2027                 | 6 324                               | 6 290                            | 0,18                      | FirstEnergy Corp.                            |                                     |                                  |                           |
| Eurohome UK Mortgages PLC                                                              |                                     |                                  |                           | Appalachian Power Co.                   |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 15/07/2027                      | 15 516                              | 15 431                           | 0,44                      |
| 4,016 % éch. 15/06/2044                                                                | 8                                   | 11                               | 0,00                      | 3,300 % éch. 01/06/2027                 | 549                                 | 543                              | 0,01                      | Fiserv, Inc.                                 |                                     |                                  |                           |
| Harvest Funding PLC                                                                    |                                     |                                  |                           | AT&T, Inc.                              |                                     |                                  |                           | 2,250 % éch. 01/06/2027                      | 4 010                               | 3 930                            | 0,11                      |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                                | 10 400                              | 13 806                           | 0,39                      | 2,300 % éch. 01/06/2027                 | 36 102                              | 35 407                           | 1,00                      | Ford Motor Co.                               |                                     |                                  |                           |
| Pierpoint BTL PLC                                                                      |                                     |                                  |                           | Athene Global Funding                   |                                     |                                  |                           | 7,500 % éch. 01/08/2026                      | 1 400                               | 1 403                            | 0,04                      |
| 4,586 % éch. 21/09/2061                                                                | 2 833                               | 3 761                            | 0,11                      | 4,505 % éch. 07/01/2027                 | 7 020                               | 7 029                            | 0,20                      | Ford Motor Credit Co. LLC                    |                                     |                                  |                           |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                                        |                                     |                                  |                           | 4,847 % éch. 25/03/2027                 | 12 800                              | 12 845                           | 0,36                      | 4,125 % éch. 17/08/2027                      | 800                                 | 793                              | 0,02                      |
| 4,672 % éch. 20/07/2053                                                                | 5 834                               | 7 748                            | 0,22                      | 4,950 % éch. 07/01/2027                 | 3 200                               | 3 205                            | 0,09                      | 4,271 % éch. 09/01/2027                      | 14 795                              | 14 754                           | 0,42                      |
| Tower Bridge Funding PLC                                                               |                                     |                                  |                           | Autodesk, Inc.                          |                                     |                                  |                           | 4,950 % éch. 28/05/2027                      | 1 400                               | 1 401                            | 0,04                      |
| 4,497 % éch. 20/01/2073                                                                | 5 053                               | 6 702                            | 0,19                      | 3,500 % éch. 15/06/2027                 | 4 200                               | 4 158                            | 0,12                      | 5,125 % éch. 05/11/2026                      | 7 200                               | 7 209                            | 0,20                      |
|                                                                                        |                                     | 37 746                           | 1,07                      | Aviation Capital Group LLC              |                                     |                                  |                           | 5,800 % éch. 05/03/2027                      | 6 000                               | 6 032                            | 0,17                      |
| Total Royaume-Uni                                                                      |                                     | 210 940                          | 5,97                      | 3,500 % éch. 01/11/2027                 | 3 100                               | 3 050                            | 0,09                      | 5,850 % éch. 17/05/2027                      | 300                                 | 302                              | 0,01                      |
| ÉTATS-UNIS                                                                             |                                     |                                  |                           | Bank of America Corp.                   |                                     |                                  |                           | Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.    |                                     |                                  |                           |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS                                                             |                                     |                                  |                           | 1,734 % éch. 22/07/2027                 | 5 550                               | 5 542                            | 0,16                      | 1,875 % éch. 01/12/2026                      | 3 300                               | 3 259                            | 0,09                      |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                             |                                     |                                  |                           | 3,615 % éch. 16/03/2028 (g)             | CAD 1 500                           | 1 062                            | 0,03                      | GA Global Funding Trust                      |                                     |                                  |                           |
| 4,888 % éch. 25/03/2035                                                                | \$ 12                               | 12                               | 0,00                      | 4,376 % éch. 27/04/2028                 | \$ 11 100                           | 11 090                           | 0,31                      | 2,250 % éch. 06/01/2027                      | 1 250                               | 1 235                            | 0,03                      |
| 5,263 % éch. 25/03/2034                                                                | 20                                  | 24                               | 0,00                      | BAT Capital Corp.                       |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 23/09/2027                      | 20 355                              | 20 273                           | 0,57                      |
| Castlelake Aircraft Structured Trust                                                   |                                     |                                  |                           | 2,259 % éch. 25/03/2028                 | 1 700                               | 1 636                            | 0,05                      | Gartner, Inc.                                |                                     |                                  |                           |
| 5,465 % éch. 15/08/2050                                                                | 795                                 | 791                              | 0,02                      | 3,557 % éch. 15/08/2027                 | 10 814                              | 10 711                           | 0,30                      | 4,500 % éch. 01/07/2028                      | 13 200                              | 12 969                           | 0,37                      |
| 5,783 % éch. 15/02/2050                                                                | 216                                 | 217                              | 0,01                      | Baxter International, Inc.              |                                     |                                  |                           | GATX Corp.                                   |                                     |                                  |                           |
| College Avenue Student Loans LLC                                                       |                                     |                                  |                           | 1,915 % éch. 01/02/2027                 | 2 193                               | 2 157                            | 0,06                      | 5,400 % éch. 15/03/2027                      | 2 500                               | 2 514                            | 0,07                      |
| 5,413 % éch. 26/11/2046                                                                | 456                                 | 461                              | 0,01                      | Bayer U.S. Finance LLC                  |                                     |                                  |                           | General Motors Financial Co., Inc.           |                                     |                                  |                           |
| Commonbond Student Loan Trust                                                          |                                     |                                  |                           | 4,375 % éch. 15/12/2028                 | 400                                 | 396                              | 0,01                      | 3,850 % éch. 05/01/2028                      | 1 300                               | 1 286                            | 0,04                      |
| 2,730 % éch. 25/10/2040                                                                | 61                                  | 60                               | 0,00                      | 6,125 % éch. 21/11/2026                 | 5 400                               | 5 428                            | 0,15                      | 4,675 % éch. 26/02/2027                      | 5 376                               | 5 388                            | 0,15                      |
| EquiFirst Mortgage Loan Trust                                                          |                                     |                                  |                           | BMW U.S. Capital LLC                    |                                     |                                  |                           | 4,684 % éch. 15/07/2027                      | 14 400                              | 14 429                           | 0,41                      |
| 6,763 % éch. 25/10/2034                                                                | 582                                 | 579                              | 0,02                      | 4,337 % éch. 11/08/2027                 | 751                                 | 753                              | 0,02                      | 4,977 % éch. 08/05/2027                      | 4 550                               | 4 574                            | 0,13                      |
| Finance America Mortgage Loan Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 4,557 % éch. 21/03/2028                 | 14 225                              | 14 319                           | 0,40                      | 5,000 % éch. 09/04/2027                      | 4 400                               | 4 417                            | 0,12                      |
| 4,588 % éch. 25/08/2034                                                                | 557                                 | 541                              | 0,01                      | Brighthouse Financial Global Funding    |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 15/07/2027                      | 1 800                               | 1 810                            | 0,05                      |
| First NLC Trust                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,550 % éch. 09/04/2027                 | 8 220                               | 8 271                            | 0,23                      | 5,400 % éch. 08/05/2027                      | 2 000                               | 2 016                            | 0,06                      |
| 3,833 % éch. 25/08/2037                                                                | 200                                 | 99                               | 0,00                      | Campbell's Co.                          |                                     |                                  |                           | Glencore Funding LLC                         |                                     |                                  |                           |
| Home Equity Asset Trust                                                                |                                     |                                  |                           | 5,200 % éch. 19/03/2027                 | 200                                 | 201                              | 0,01                      | 4,000 % éch. 27/03/2027                      | 6 974                               | 6 951                            | 0,20                      |
| 4,708 % éch. 25/06/2034                                                                | 190                                 | 190                              | 0,01                      | Cantor Fitzgerald LP                    |                                     |                                  |                           | Global Net Lease, Inc.                       |                                     |                                  |                           |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                                                    |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 14/04/2027                 | 1 300                               | 1 296                            | 0,04                      | 3,750 % éch. 15/12/2027                      | 38 565                              | 37 770                           | 1,08                      |
| 4,463 % éch. 25/09/2034                                                                | 635                                 | 580                              | 0,02                      | CDW LLC                                 |                                     |                                  |                           | Global Payments, Inc.                        |                                     |                                  |                           |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                                 |                                     |                                  |                           | 2,670 % éch. 01/12/2026                 | 3 900                               | 3 869                            | 0,11                      | 2,150 % éch. 15/01/2027                      | 3 100                               | 3 060                            | 0,09                      |
| 4,813 % éch. 25/09/2033                                                                | 322                                 | 337                              | 0,01                      | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC    |                                     |                                  |                           | 4,550 % éch. 15/03/2028                      | 6 200                               | 6 174                            | 0,17                      |
| Navient Private Education Loan Trust                                                   |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 30/06/2027                 | 21 000                              | 21 055                           | 0,59                      | 4,950 % éch. 15/08/2027                      | 900                                 | 902                              | 0,03                      |
| 5,190 % éch. 16/07/2040                                                                | 569                                 | 570                              | 0,01                      | Citadel LP                              |                                     |                                  |                           | Goldman Sachs Group, Inc.                    |                                     |                                  |                           |
| Nelnet Student Loan Trust                                                              |                                     |                                  |                           | 4,875 % éch. 15/01/2027                 | 510                                 | 510                              | 0,01                      | 1,542 % éch. 10/09/2027                      | 8 238                               | 8 192                            | 0,23                      |
| 4,342 % éch. 27/02/2051                                                                | 250                                 | 249                              | 0,01                      | Citigroup, Inc.                         |                                     |                                  |                           | 1,948 % éch. 21/10/2027                      | 900                                 | 893                              | 0,02                      |
| SLM Private Credit Student Loan Trust                                                  |                                     |                                  |                           | 3,887 % éch. 10/01/2028                 | 2 100                               | 2 093                            | 0,06                      | 3,615 % éch. 15/03/2028                      | 2 900                               | 2 881                            | 0,08                      |
| 4,216 % éch. 15/06/2039                                                                | 3 409                               | 3 337                            | 0,09                      | 4,658 % éch. 24/05/2028                 | 17 800                              | 17 816                           | 0,50                      | 4,341 % éch. 21/01/2029                      | 5 900                               | 5 910                            | 0,17                      |
| 4,256 % éch. 15/06/2039                                                                | 2 690                               | 2 655                            | 0,07                      | 4,915 % éch. 24/02/2028                 | 6 001                               | 6 029                            | 0,17                      | 4,632 % éch. 20/04/2030                      | 8 000                               | 8 035                            | 0,23                      |
| SLM Student Loan Trust                                                                 |                                     |                                  |                           | CMS Energy Corp.                        |                                     |                                  |                           | 4,920 % éch. 23/04/2028                      | 1 627                               | 1 636                            | 0,05                      |
| 4,392 % éch. 27/12/2038                                                                | 633                                 | 628                              | 0,02                      | 3,450 % éch. 15/08/2027                 | 360                                 | 356                              | 0,01                      | 5,488 % éch. 15/03/2028                      | 1 600                               | 1 614                            | 0,05                      |
| 4,830 % éch. 25/07/2023                                                                | 312                                 | 308                              | 0,01                      | Corebridge Financial, Inc.              |                                     |                                  |                           | 5,682 % éch. 28/10/2027                      | 1 300                               | 1 307                            | 0,04                      |
| 5,630 % éch. 25/07/2023                                                                | 45                                  | 45                               | 0,00                      | 3,650 % éch. 05/04/2027                 | 3 925                               | 3 900                            | 0,11                      | Hardwood Funding LLC                         |                                     |                                  |                           |
| SMB Private Education Loan Trust                                                       |                                     |                                  |                           | Cox Communications, Inc.                |                                     |                                  |                           | 4,360 % éch. 08/06/2029 (g)                  | 2 100                               | 2 061                            | 0,06                      |
| 3,600 % éch. 15/01/2037                                                                | 582                                 | 579                              | 0,02                      | 3,500 % éch. 15/08/2027                 | 11 592                              | 11 444                           | 0,32                      | HCA, Inc.                                    |                                     |                                  |                           |
| 3,630 % éch. 15/11/2035                                                                | 1 304                               | 1 298                            | 0,04                      | Crown Castle, Inc.                      |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/02/2027                      | 7 201                               | 7 199                            | 0,20                      |
| 4,000 % éch. 15/09/2042                                                                | 2 120                               | 2 104                            | 0,06                      | 1,050 % éch. 15/07/2026                 | 8 266                               | 8 256                            | 0,23                      | 4,509 % éch. 01/03/2028                      | 1 000                               | 1 004                            | 0,03                      |
| 4,490 % éch. 15/11/2035                                                                | 279                                 | 279                              | 0,01                      | 2,900 % éch. 15/03/2027                 | 9 940                               | 9 833                            | 0,28                      | Hyatt Hotels Corp.                           |                                     |                                  |                           |
| Structured Asset Investment Loan Trust                                                 |                                     |                                  |                           | 3,650 % éch. 01/09/2027                 | 1 836                               | 1 818                            | 0,05                      | 5,750 % éch. 30/01/2027                      | 2 500                               | 2 514                            | 0,07                      |
| 4,313 % éch. 25/09/2034                                                                | 1 383                               | 1 326                            | 0,04                      | 4,000 % éch. 01/03/2027                 | 2 100                               | 2 095                            | 0,06                      | Hyundai Capital America                      |                                     |                                  |                           |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust                                  |                                     |                                  |                           | Daimler Truck Finance North America LLC |                                     |                                  |                           | 4,300 % éch. 24/09/2027                      | 1 150                               | 1 146                            | 0,03                      |
| 5,488 % éch. 25/11/2035                                                                | 349                                 | 349                              | 0,01                      | 4,597 % éch. 25/09/2027                 | 455                                 | 457                              | 0,01                      | 4,627 % éch. 25/03/2027                      | 4 100                               | 4 113                            | 0,12                      |
|                                                                                        |                                     | 17 618                           | 0,50                      | DCP Midstream Operating LP              |                                     |                                  |                           | 4,677 % éch. 19/03/2027                      | 1 000                               | 1 003                            | 0,03                      |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS                                                          |                                     |                                  |                           | 5,625 % éch. 15/07/2027                 | 4 200                               | 4 239                            | 0,12                      | 4,677 % éch. 24/06/2027                      | 5 500                               | 5 527                            | 0,16                      |
| AEGON Funding Co. LLC                                                                  |                                     |                                  |                           | Edison International                    |                                     |                                  |                           | 4,757 % éch. 23/06/2027                      | 3 605                               | 3 623                            | 0,10                      |
| 5,500 % éch. 16/04/2027                                                                | 32 764                              | 32 979                           | 0,93                      | 5,750 % éch. 15/06/2027                 | 4 800                               | 4 831                            | 0,14                      | 4,875 % éch. 01/11/2027                      | 4 570                               | 4 583                            | 0,13                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | Energy Transfer LP                      |                                     |                                  |                           | 5,000 % éch. 07/01/2028                      | 4 810                               | 4 830                            | 0,14                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,200 % éch. 15/04/2027                 | 200                                 | 200                              | 0,01                      | 5,131 % éch. 08/01/2027                      | 6 800                               | 6 832                            | 0,19                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 15/03/2027                 | 600                                 | 600                              | 0,02                      | 5,250 % éch. 08/01/2027                      | 3 000                               | 3 013                            | 0,08                      |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           | 5,500 % éch. 01/06/2027                 | 32 900                              | 33 121                           | 0,94                      | Jackson National Life Global Funding         |                                     |                                  |                           |
|                                                                                        |                                     |                                  |                           |                                         |                                     |                                  |                           | 4,603 % éch. 14/01/2028                      | 2 500                               | 2 497                            | 0,07                      |

# Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

| DESCRIPTION                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,900 % éch. 13/01/2027                            | \$ 700                              | \$ 701                           | 0,02                      | Sempra                                   | \$ 20 700                           | \$ 20 459                        | 0,58                      | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS<br>PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX |                                     |                                  |                           |
| 5,550 % éch. 02/07/2027                            | 6 000                               | 6 056                            | 0,17                      | 3,250 % éch. 15/06/2027                  | 13 600                              | 13 664                           | 0,39                      | American Home Mortgage Investment Trust                                                    |                                     |                                  |                           |
| JPMorgan Chase & Co.                               |                                     |                                  |                           | 4,313 % éch. 07/01/2028                  | 2 500                               | 2 494                            | 0,07                      | 4,363 % éch. 25/09/2045                                                                    | \$ 1 112                            | \$ 1 011                         | 0,03                      |
| 3,540 % éch. 01/05/2028                            | 1 635                               | 1 622                            | 0,05                      | Smithfield Foods, Inc.                   |                                     |                                  |                           | Ashford Hospitality Trust                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,490 % éch. 22/10/2028                            | 1 600                               | 1 607                            | 0,05                      | 4,250 % éch. 01/02/2027                  | 2 965                               | 2 918                            | 0,08                      | 4,698 % éch. 15/04/2035                                                                    | 178                                 | 178                              | 0,01                      |
| 4,560 % éch. 22/07/2028                            | 600                                 | 603                              | 0,02                      | Southern California Edison Co.           | 12 712                              | 12 713                           | 0,36                      | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                                | 1                                   | 0                                | 0,00                      |
| Keurig Dr Pepper, Inc.                             |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 01/06/2027                  | 5 196                               | 5 205                            | 0,15                      | 4,504 % éch. 25/02/2036                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,550 % éch. 15/09/2026                            | 2 600                               | 2 591                            | 0,07                      | 4,875 % éch. 01/02/2027                  | 4 000                               | 4 039                            | 0,11                      | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 4,208 % éch. 15/11/2026                            | 8 500                               | 8 499                            | 0,24                      | 5,300 % éch. 01/03/2028                  | 5 000                               | 5 021                            | 0,14                      | 4,642 % éch. 25/09/2035                                                                    | 10                                  | 5                                | 0,00                      |
| 4,518 % éch. 15/03/2027                            | 2 544                               | 2 549                            | 0,07                      | Southwest Airlines Co.                   |                                     |                                  |                           | Commercial Mortgage Trust                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 5,100 % éch. 15/03/2027                            | 500                                 | 502                              | 0,01                      | 5,125 % éch. 15/06/2027                  | 1 400                               | 1 395                            | 0,04                      | 3,942 % éch. 10/04/2033                                                                    | 1 050                               | 1 027                            | 0,03                      |
| Kraft Heinz Foods Co.                              |                                     |                                  |                           | Southwestern Electric Power Co.          |                                     |                                  |                           | Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates                             |                                     |                                  |                           |
| 3,875 % éch. 15/05/2027                            | 912                                 | 909                              | 0,03                      | 2,750 % éch. 01/10/2026                  | 995                                 | 992                              | 0,03                      | 4,271 % éch. 28/09/2036                                                                    | 27                                  | 27                               | 0,00                      |
| Kyndryl Holdings, Inc.                             |                                     |                                  |                           | Spectra Energy Partners LP               | 12 900                              | 12 675                           | 0,36                      | GSR Mortgage Loan Trust                                                                    |                                     |                                  |                           |
| 2,050 % éch. 15/10/2026                            | 19 600                              | 19 464                           | 0,55                      | 3,375 % éch. 15/10/2026                  | 2 400                               | 2 407                            | 0,07                      | 4,075 % éch. 25/06/2034                                                                    | 29                                  | 28                               | 0,00                      |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP               |                                     |                                  |                           | Stellantis Finance U.S., Inc.            | 2 000                               | 2 017                            | 0,06                      | 4,440 % éch. 25/11/2035                                                                    | 65                                  | 56                               | 0,00                      |
| 4,250 % éch. 01/02/2027                            | 7 085                               | 7 048                            | 0,20                      | 1,711 % éch. 29/01/2027                  | 1 300                               | 1 306                            | 0,04                      | Impac CMB Trust                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Las Vegas Sands Corp.                              |                                     |                                  |                           | 5,350 % éch. 17/03/2028                  |                                     |                                  |                           | 4,403 % éch. 25/03/2035                                                                    | 53                                  | 53                               | 0,00                      |
| 5,900 % éch. 01/06/2027                            | 28 365                              | 28 634                           | 0,81                      | 5,625 % éch. 12/01/2028                  |                                     |                                  |                           | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust                                        |                                     |                                  |                           |
| Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC           |                                     |                                  |                           | Stellantis Financial Services U.S. Corp. |                                     |                                  |                           | 4,128 % éch. 05/07/2031                                                                    | 3 000                               | 2 530                            | 0,07                      |
| 4,100 % éch. 15/05/2028                            | 2 800                               | 2 776                            | 0,08                      | 5,328 % éch. 15/09/2028                  | 18 200                              | 17 969                           | 0,51                      | 4,882 % éch. 15/06/2035                                                                    | 969                                 | 644                              | 0,02                      |
| Morgan Stanley Bank N.A.                           |                                     |                                  |                           | Sumisho Air Lease Corp.                  | 4 985                               | 4 949                            | 0,14                      | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,504 % éch. 26/05/2028                            | 4 600                               | 4 613                            | 0,13                      | 2,200 % éch. 15/01/2027                  | 5 800                               | 5 771                            | 0,16                      | 5,302 % éch. 25/05/2033                                                                    | 90                                  | 88                               | 0,00                      |
| Morgan Stanley Private Bank N.A.                   |                                     |                                  |                           | 3,625 % éch. 01/04/2027                  |                                     |                                  |                           | 5,645 % éch. 25/03/2033                                                                    | 129                                 | 126                              | 0,00                      |
| 4,403 % éch. 06/07/2028                            | 23 250                              | 23 290                           | 0,66                      | 4,400 % éch. 24/03/2028                  | 3 200                               | 3 196                            | 0,09                      | New Residential Mortgage Loan Trust                                                        |                                     |                                  |                           |
| MPLX LP                                            |                                     |                                  |                           | Synchrony Financial                      |                                     |                                  |                           | 3,500 % éch. 25/12/2057                                                                    | 223                                 | 217                              | 0,01                      |
| 4,125 % éch. 01/03/2027                            | 3 800                               | 3 791                            | 0,11                      | 3,700 % éch. 04/08/2026                  |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 25/05/2058                                                                    | 112                                 | 109                              | 0,00                      |
| National Fuel Gas Co.                              |                                     |                                  |                           | Synopsys, Inc.                           | 1 241                               | 1 243                            | 0,03                      | PRPM LLC                                                                                   |                                     |                                  |                           |
| 3,950 % éch. 15/09/2027                            | 900                                 | 893                              | 0,02                      | 4,550 % éch. 01/04/2027                  | 9 137                               | 9 091                            | 0,26                      | 4,942 % éch. 25/12/2055                                                                    | 766                                 | 757                              | 0,02                      |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. |                                     |                                  |                           | T-Mobile USA, Inc.                       | 5 200                               | 5 185                            | 0,15                      | Sequoia Mortgage Trust                                                                     |                                     |                                  |                           |
| 4,189 % éch. 03/12/2027                            | 4 200                               | 4 207                            | 0,12                      | 3,750 % éch. 15/04/2027                  | 8 500                               | 8 442                            | 0,24                      | 4,434 % éch. 20/10/2034                                                                    | 259                                 | 239                              | 0,01                      |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC                    |                                     |                                  |                           | TD SYNnex Corp.                          |                                     |                                  |                           | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                                             |                                     |                                  |                           |
| 1,850 % éch. 16/09/2026                            | 7 100                               | 7 038                            | 0,20                      | 1,750 % éch. 09/08/2026                  |                                     |                                  |                           | 4,750 % éch. 25/03/2034                                                                    | 5                                   | 5                                | 0,00                      |
| 6,950 % éch. 15/09/2026                            | 400                                 | 402                              | 0,01                      | Uber Technologies, Inc.                  |                                     |                                  |                           | Structured Asset Mortgage Investments Trust                                                |                                     |                                  |                           |
| Northwest Pipeline LLC                             |                                     |                                  |                           | 4,500 % éch. 15/08/2029                  |                                     |                                  |                           | 4,414 % éch. 19/10/2034                                                                    | 162                                 | 157                              | 0,00                      |
| 4,000 % éch. 01/04/2027                            | 844                                 | 841                              | 0,02                      | United Airlines Pass-Through Trust       |                                     |                                  |                           | Towd Point Mortgage Trust                                                                  |                                     |                                  |                           |
| Occidental Petroleum Corp.                         |                                     |                                  |                           | 3,750 % éch. 03/03/2028                  | 544                                 | 544                              | 0,01                      | 3,250 % éch. 25/07/2056                                                                    | 58                                  | 58                               | 0,00                      |
| 3,000 % éch. 15/02/2027                            | 6 100                               | 6 057                            | 0,17                      | 5,875 % éch. 15/04/2029                  | 510                                 | 516                              | 0,01                      | 3,750 % éch. 25/05/2058                                                                    | 3 833                               | 3 767                            | 0,11                      |
| ONEOK, Inc.                                        |                                     |                                  |                           | Universal Health Services, Inc.          |                                     |                                  |                           | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                                              |                                     |                                  |                           |
| 4,250 % éch. 24/09/2027                            | 3 200                               | 3 189                            | 0,09                      | 1,650 % éch. 01/09/2026                  | 5 200                               | 5 179                            | 0,15                      | 4,223 % éch. 25/04/2045                                                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 5,550 % éch. 01/11/2026                            | 2 900                               | 2 910                            | 0,08                      | Viatis, Inc.                             |                                     |                                  |                           | 4,303 % éch. 25/12/2045                                                                    | 17                                  | 18                               | 0,00                      |
| Oracle Corp.                                       |                                     |                                  |                           | 2,300 % éch. 22/06/2027                  | 7 800                               | 7 618                            | 0,22                      | 4,408 % éch. 25/10/2035                                                                    | 180                                 | 165                              | 0,01                      |
| 2,650 % éch. 15/07/2026                            | 3 800                               | 3 797                            | 0,11                      | VICI Properties LP                       |                                     |                                  |                           |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| 2,800 % éch. 01/04/2027                            | 12 500                              | 12 336                           | 0,35                      | 3,750 % éch. 15/02/2027                  | 8 149                               | 8 099                            | 0,23                      |                                                                                            |                                     |                                  |                           |
| Pacific Gas & Electric Co.                         |                                     |                                  |                           | 4,250 % éch. 01/12/2026                  | 16 627                              | 16 596                           | 0,47                      | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN                                                          |                                     |                                  |                           |
| 2,100 % éch. 01/08/2027                            | 3 300                               | 3 214                            | 0,09                      | 4,500 % éch. 01/09/2026                  | 5 350                               | 5 347                            | 0,15                      | Fannie Mae                                                                                 |                                     |                                  |                           |
| 3,300 % éch. 15/03/2027                            | 5 800                               | 5 750                            | 0,16                      | 4,750 % éch. 15/02/2028                  | 2 100                               | 2 100                            | 0,06                      | 2,000 % éch. 25/08/2038                                                                    | 2 873                               | 2 689                            | 0,08                      |
| 4,200 % éch. 01/03/2029                            | 3 300                               | 3 254                            | 0,09                      | 5,750 % éch. 01/02/2027                  | 4 845                               | 4 858                            | 0,14                      | 3,992 % éch. 25/01/2037                                                                    | 22                                  | 22                               | 0,00                      |
| 5,000 % éch. 04/06/2028                            | 2 000                               | 2 011                            | 0,06                      | Vistra Operations Co. LLC                |                                     |                                  |                           | 4,052 % éch. 25/04/2037                                                                    | 1                                   | 1                                | 0,00                      |
| 5,450 % éch. 15/06/2027                            | 4 100                               | 4 132                            | 0,12                      | 3,700 % éch. 30/01/2027                  | 7 700                               | 7 659                            | 0,22                      | 4,072 % éch. 25/04/2037                                                                    | 3                                   | 3                                | 0,00                      |
| 5,550 % éch. 15/05/2029                            | 400                                 | 408                              | 0,01                      | 4,550 % éch. 30/10/2028                  | 900                                 | 894                              | 0,02                      | 4,092 % éch. 25/07/2037                                                                    | 24                                  | 24                               | 0,00                      |
| Penske Truck Leasing Co. LP                        |                                     |                                  |                           | 5,050 % éch. 30/12/2026                  | 7 100                               | 7 111                            | 0,20                      | 4,112 % éch. 25/05/2037                                                                    | 17                                  | 17                               | 0,00                      |
| 4,400 % éch. 01/07/2027                            | 807                                 | 806                              | 0,02                      | Volkswagen Group of America Finance LLC  |                                     |                                  |                           | 4,114 % éch. 25/11/2047                                                                    | 1 485                               | 1 471                            | 0,04                      |
| 5,350 % éch. 12/01/2027                            | 898                                 | 901                              | 0,03                      | 3,200 % éch. 26/09/2026                  | 4 000                               | 3 987                            | 0,11                      | 4,132 % éch. 25/04/2037                                                                    | 207                                 | 205                              | 0,01                      |
| PNC Bank N.A.                                      |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 08/06/2027                  | 5 200                               | 5 190                            | 0,15                      | 4,142 % éch. 25/05/2037 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 4,361 % éch. 21/07/2028                            | 3 400                               | 3 407                            | 0,10                      | 4,697 % éch. 25/03/2027                  | 10 400                              | 10 430                           | 0,29                      | 25/10/2040                                                                                 | 21                                  | 21                               | 0,00                      |
| Reliance Standard Life Global Funding              |                                     |                                  |                           | 5,700 % éch. 12/09/2026                  | 8 100                               | 8 119                            | 0,23                      | 4,162 % éch. 25/05/2037                                                                    | 38                                  | 37                               | 0,00                      |
| 1,512 % éch. 28/09/2026                            | 1 620                               | 1 608                            | 0,05                      | WEA Finance LLC                          |                                     |                                  |                           | 4,164 % éch. 25/03/2049                                                                    | 355                                 | 353                              | 0,01                      |
| Repsol E&P Capital Markets U.S. LLC                |                                     |                                  |                           | 2,875 % éch. 15/01/2027                  | 1 205                               | 1 194                            | 0,03                      | 4,192 % éch. 25/10/2030                                                                    | 2                                   | 2                                | 0,00                      |
| 4,805 % éch. 16/09/2028                            | 17 200                              | 17 231                           | 0,49                      | Wells Fargo & Co.                        |                                     |                                  |                           | 4,192 % éch. 25/06/2060 (h)                                                                | 14 232                              | 14 065                           | 0,40                      |
| RGA Global Funding                                 |                                     |                                  |                           | 4,700 % éch. 22/04/2028                  | 6 674                               | 6 703                            | 0,19                      | 4,214 % éch. 25/09/2046 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 2,000 % éch. 30/11/2026                            | 1 700                               | 1 684                            | 0,05                      | 4,900 % éch. 24/01/2028                  | 4 500                               | 4 511                            | 0,13                      | 25/08/2050                                                                                 | 1 885                               | 1 870                            | 0,05                      |
| Rochester Gas & Electric Corp.                     |                                     |                                  |                           | 5,707 % éch. 22/04/2028                  | 22 100                              | 22 302                           | 0,63                      | 4,242 % éch. 25/08/2037                                                                    | 33                                  | 33                               | 0,00                      |
| 3,100 % éch. 01/06/2027                            | 1 400                               | 1 383                            | 0,04                      |                                          |                                     |                                  |                           | 4,244 % éch. 25/07/2056                                                                    | 1 759                               | 1 754                            | 0,05                      |
| Sammons Financial Group Global Funding             |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 4,412 % éch. 25/03/2038                                                                    | 34                                  | 34                               | 0,00                      |
| 4,489 % éch. 02/09/2027                            | 7 500                               | 7 505                            | 0,21                      |                                          |                                     |                                  |                           | 4,422 % éch. 25/12/2037                                                                    | 26                                  | 26                               | 0,00                      |
| Sammons Financial Group, Inc.                      |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 4,429 % éch. 25/12/2047                                                                    | 1 155                               | 1 156                            | 0,03                      |
| 4,450 % éch. 12/05/2027                            | 600                                 | 598                              | 0,02                      | Discovery Global Holdings, Inc.          | 11 377                              | 11 394                           | 0,32                      | 4,442 % éch. 25/01/2041                                                                    | 42                                  | 43                               | 0,00                      |
| Santander Holdings USA, Inc.                       |                                     |                                  |                           | 6,144 % éch. 03/06/2033                  |                                     |                                  |                           | 4,449 % éch. 25/01/2051                                                                    | 5 003                               | 5 025                            | 0,14                      |
| 2,490 % éch. 06/01/2028                            | 3 100                               | 3 066                            | 0,09                      |                                          |                                     |                                  |                           | 4,528 % éch. 25/09/2054                                                                    | 15 617                              | 15 687                           | 0,44                      |
| 3,244 % éch. 05/10/2026                            | 9 400                               | 9 374                            | 0,26                      |                                          |                                     |                                  |                           | 4,538 % éch. 25/03/2055                                                                    | 1 230                               | 1 239                            | 0,04                      |
| 4,400 % éch. 13/07/2027                            | 1 100                               | 1 099                            | 0,03                      |                                          |                                     |                                  |                           | 4,549 % éch. 25/12/2050                                                                    | 2 508                               | 2 506                            | 0,07                      |
| SBA Tower Trust                                    |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 4,578 % éch. 25/01/2055 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
| 1,840 % éch. 15/04/2027                            | 2 000                               | 1 957                            | 0,05                      |                                          |                                     |                                  |                           | 25/03/2055                                                                                 | 1 699                               | 1 714                            | 0,05                      |
| 2,328 % éch. 15/07/2052                            | 400                                 | 385                              | 0,01                      |                                          |                                     |                                  |                           | 4,598 % éch. 25/08/2054                                                                    | 1 301                               | 1 310                            | 0,04                      |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 4,628 % éch. 25/05/2055 -                                                                  |                                     |                                  |                           |
|                                                    |                                     |                                  |                           |                                          |                                     |                                  |                           | 25/11/2055                                                                                 | 3 762                               | 3 787                            | 0,11                      |



| DESCRIPTION                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET | DESCRIPTION                                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 4,678 % éch. 25/05/2055                 | \$ 2 294                            | \$ 2 321                         | 0,07                      | 4,511 % éch. 20/12/2065 -<br>20/08/2067                        | \$ 900                              | \$ 903                           | 0,03                      | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.                |                                     |                                  |                           |
| 4,728 % éch. 25/12/2054 -<br>25/07/2055 | 5 213                               | 5 261                            | 0,15                      | 4,559 % éch. 20/01/2054 -<br>20/10/2073                        | 3 955                               | 3 999                            | 0,11                      | 4,000 % éch. 22/07/2026                              | \$ 44 100                           | \$ 43 993                        | 1,24                      |
| 4,728 % éch. 25/04/2056 (h)             | 18 760                              | 18 762                           | 0,53                      | 4,561 % éch. 20/01/2066                                        | 82                                  | 83                               | 0,00                      | O'Reilly Automotive, Inc.                            | 11 000                              | 10 976                           | 0,31                      |
| 4,742 % éch. 25/05/2037                 | 131                                 | 130                              | 0,00                      | 4,609 % éch. 20/06/2055 -<br>20/05/2073                        | 8 185                               | 8 299                            | 0,24                      | Oglethorpe Power Corp.                               | 2 300                               | 2 293                            | 0,07                      |
| 4,778 % éch. 25/01/2055 -<br>25/03/2055 | 11 128                              | 11 239                           | 0,32                      | 4,611 % éch. 20/11/2066                                        | 204                                 | 205                              | 0,01                      | 4,070 % éch. 27/07/2026                              |                                     |                                  |                           |
| 4,788 % éch. 25/03/2055                 | 5 280                               | 5 341                            | 0,15                      | 4,656 % éch. 20/03/2069                                        | 2 169                               | 2 183                            | 0,06                      | Tampa Electric Co.                                   | 800                                 | 799                              | 0,02                      |
| 4,808 % éch. 25/08/2055                 | 8 082                               | 8 136                            | 0,23                      | 4,709 % éch. 20/05/2073                                        | 928                                 | 949                              | 0,03                      | 4,040 % éch. 14/07/2026                              |                                     |                                  |                           |
| 4,828 % éch. 25/12/2053 -<br>25/11/2055 | 6 442                               | 6 513                            | 0,18                      | 4,759 % éch. 20/07/2055                                        | 824                                 | 835                              | 0,02                      | 4,050 % éch. 21/07/2026                              | 600                                 | 599                              | 0,02                      |
| 4,878 % éch. 25/11/2053 -<br>25/09/2055 | 8 855                               | 8 936                            | 0,25                      | 4,809 % éch. 20/08/2055                                        | 3 740                               | 3 764                            | 0,11                      | Telus Corp.                                          | 33 400                              | 33 028                           | 0,93                      |
| 4,928 % éch. 25/08/2054                 | 4 223                               | 4 258                            | 0,12                      | 4,898 % éch. 20/04/2067                                        | 826                                 | 833                              | 0,02                      | 4,150 % éch. 29/09/2026                              | 8 200                               | 8 130                            | 0,23                      |
| 5,028 % éch. 25/12/2054                 | 474                                 | 479                              | 0,01                      | 5,000 % éch. 20/03/2027 -<br>20/03/2030                        | 9                                   | 9                                | 0,00                      | 4,250 % éch. 08/09/2026                              | 5 900                               | 5 828                            | 0,16                      |
| 6,134 % éch. 01/10/2037                 | 50                                  | 52                               | 0,00                      | 5,109 % éch. 20/06/2071                                        | 6 688                               | 6 884                            | 0,20                      | 4,260 % éch. 07/10/2026                              |                                     |                                  |                           |
| Freddie Mac                             |                                     |                                  |                           | 5,125 % éch. 20/11/2029                                        | 1                                   | 1                                | 0,00                      | Triton Container International Ltd.                  | 19 800                              | 19 733                           | 0,56                      |
| 1,955 % éch. 15/01/2038 (a)             | 314                                 | 14                               | 0,00                      | 5,927 % éch. 20/05/2071                                        | 1 412                               | 1 455                            | 0,04                      | 4,300 % éch. 28/07/2026                              | 11 800                              | 11 715                           | 0,33                      |
| 2,000 % éch. 01/03/2028                 | 1 609                               | 1 581                            | 0,05                      | 5,952 % éch. 20/06/2071                                        | 1 246                               | 1 276                            | 0,04                      | 4,370 % éch. 28/08/2026                              | 21 487                              | 21 323                           | 0,60                      |
| 2,500 % éch. 25/10/2048                 | 537                                 | 490                              | 0,01                      | 6,907 % éch. 20/09/2066                                        | 366                                 | 375                              | 0,01                      | VW CR, Inc.                                          | 20 900                              | 20 675                           | 0,58                      |
| 3,000 % éch. 25/09/2045                 | 1 414                               | 1 234                            | 0,04                      | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA |                                     |                                  |                           | 4,160 % éch. 01/10/2026                              |                                     |                                  |                           |
| 4,007 % éch. 15/05/2037                 | 28                                  | 28                               | 0,00                      | 5,500 % éch. 01/08/2056 -<br>01/09/2056                        | 122 100                             | 122 269                          | 3,46                      | Weyerhaeuser Co.                                     | 7 600                               | 7 595                            | 0,22                      |
| 4,107 % éch. 15/02/2034 -<br>15/08/2056 | 5 265                               | 5 070                            | 0,14                      | 6,000 % éch. 01/08/2056                                        | 10 600                              | 10 802                           | 0,31                      | 4,050 % éch. 06/07/2026                              |                                     |                                  |                           |
| 4,114 % éch. 15/01/2038 -<br>15/10/2040 | 11 737                              | 11 584                           | 0,33                      |                                                                |                                     | 525 472                          | 14,86                     |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,117 % éch. 15/06/2037                 | 408                                 | 406                              | 0,01                      | <b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                         |                                     |                                  |                           | <b>BILLET À COURT TERME</b>                          |                                     |                                  |                           |
| 4,142 % éch. 25/07/2050                 | 6 714                               | 6 596                            | 0,19                      | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)     |                                     |                                  |                           | Daiwa Securities Co. Ltd.                            |                                     |                                  |                           |
| 4,157 % éch. 15/10/2036 -<br>15/06/2042 | 28                                  | 27                               | 0,00                      | 2,125 % éch. 15/04/2029 (i)                                    | 7 588                               | 7 612                            | 0,22                      | 4,090 % éch. 18/02/2027                              | 24 000                              | 23 926                           | 0,67                      |
| 4,187 % éch. 15/10/2040                 | 45                                  | 44                               | 0,00                      | Total États-Unis                                               |                                     | 1 705 739                        | 48,25                     | Devon Energy Corp.                                   | 1 000                               | 993                              | 0,03                      |
| 4,207 % éch. 15/11/2050                 | 61                                  | 61                               | 0,00                      |                                                                |                                     |                                  |                           | 3,900 % éch. 15/05/2027                              |                                     |                                  |                           |
| 4,227 % éch. 15/05/2036 -<br>15/12/2041 | 122                                 | 121                              | 0,00                      | <b>INSTRUMENTS À COURT TERME</b>                               |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,528 % éch. 25/10/2055 -<br>25/12/2055 | 1 360                               | 1 367                            | 0,04                      | <b>BILLET À COURT TERME</b>                                    |                                     |                                  |                           | <b>BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN</b>                      |                                     |                                  |                           |
| 4,549 % éch. 15/04/2049                 | 4 742                               | 4 759                            | 0,13                      | AutoNation, Inc.                                               |                                     |                                  |                           | 3,828 % éch. 01/10/2026 (b)(c)(d)                    | 551 800                             | 546 540                          | 15,46                     |
| 4,568 % éch. 25/11/2054 (h)             | 20 140                              | 20 305                           | 0,57                      | 4,050 % éch. 01/07/2026                                        | 900                                 | 900                              | 0,03                      | 3,970 % éch. 31/12/2026 (b)(c)(d)                    | 275 900                             | 270 541                          | 7,65                      |
| 4,578 % éch. 25/03/2055 -<br>25/09/2055 | 11 818                              | 11 918                           | 0,34                      | Bacardi-Martini BV                                             | 4 400                               | 4 381                            | 0,12                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,598 % éch. 25/08/2054                 | 1 035                               | 1 043                            | 0,03                      | 4,430 % éch. 06/08/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,628 % éch. 25/10/2052 -<br>25/08/2055 | 24 033                              | 24 297                           | 0,69                      | Banco Itau Chile                                               | 3 650                               | 3 541                            | 0,10                      | Total des Instruments à court terme                  |                                     | 1 253 109                        | 35,44                     |
| 4,650 % éch. 25/07/2056                 | 22 700                              | 22 736                           | 0,64                      | 4,370 % éch. 01/03/2027                                        | 3 650                               | 3 534                            | 0,10                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,728 % éch. 25/11/2054 (h)             | 11 679                              | 11 720                           | 0,33                      | 4,370 % éch. 15/03/2027                                        |                                     |                                  |                           | Total des Valeurs mobilières                         | \$ 4 216 595                        | 119,26                           |                           |
| 4,728 % éch. 25/01/2055 -<br>25/07/2055 | 10 432                              | 10 534                           | 0,30                      | Boston Scientific Corp.                                        | 600                                 | 600                              | 0,02                      | <b>ACTIONS</b>                                       |                                     |                                  |                           |
| 4,778 % éch. 25/05/2054 -<br>25/08/2055 | 32 235                              | 32 576                           | 0,92                      | 4,000 % éch. 01/07/2026                                        | 2 300                               | 2 298                            | 0,07                      | <b>FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                        |                                     |                                  |                           |
| 4,828 % éch. 25/12/2054 -<br>25/08/2055 | 13 257                              | 13 408                           | 0,38                      | 4,025 % éch. 07/07/2026                                        |                                     |                                  |                           | <b>ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF</b>             |                                     |                                  |                           |
| 4,928 % éch. 25/03/2055                 | 4 511                               | 4 552                            | 0,13                      | CBRE Services, Inc.                                            | 11 400                              | 11 381                           | 0,32                      | PIMCO Select Funds plc - Fonds                       |                                     |                                  |                           |
| 5,078 % éch. 25/06/2055                 | 6 418                               | 6 505                            | 0,18                      | 4,050 % éch. 15/07/2026                                        | 19 300                              | 19 264                           | 0,55                      | PIMCO US Dollar Short-<br>Term Floating NAV Fund (f) | 10 995                              | 109                              | 0,00                      |
| 5,128 % éch. 25/06/2056                 | 9 547                               | 9 616                            | 0,27                      | 4,050 % éch. 17/07/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 5,144 % éch. 25/07/2044                 | 2                                   | 2                                | 0,00                      | Constellation Energy Corp.                                     | 900                                 | 897                              | 0,03                      | <b>FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>                      |                                     |                                  |                           |
| Ginnie Mae                              |                                     |                                  |                           | 4,050 % éch. 28/07/2026                                        |                                     |                                  |                           | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO                         |                                     |                                  |                           |
| 2,500 % éch. 20/01/2049 -<br>20/10/2049 | 532                                 | 472                              | 0,01                      | CRH America Finance, Inc.                                      | 5 000                               | 4 983                            | 0,14                      | US Dollar Short Maturity                             | 3 508 765                           | 352 561                          | 9,97                      |
| 3,909 % éch. 20/09/2071                 | 788                                 | 785                              | 0,02                      | 4,010 % éch. 30/07/2026                                        | 10 000                              | 9 954                            | 0,28                      | UCITS ETF (f)                                        |                                     |                                  |                           |
| 4,150 % éch. 20/04/2069                 | 494                                 | 494                              | 0,01                      | 4,030 % éch. 10/08/2026                                        |                                     |                                  |                           | Total des Fonds d'investissement                     | \$ 352 670                          | 9,97                             |                           |
| 4,221 % éch. 20/02/2067                 | 119                                 | 118                              | 0,00                      | Entermy Corp.                                                  | 13 300                              | 13 212                           | 0,37                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,241 % éch. 20/02/2065                 | 949                                 | 949                              | 0,03                      | Every Missouri West, Inc.                                      | 21 300                              | 21 298                           | 0,60                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,254 % éch. 20/10/2037                 | 90                                  | 90                               | 0,00                      | 4,230 % éch. 01/07/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,261 % éch. 20/11/2069                 | 63                                  | 63                               | 0,00                      | Fidelity National Information Services, Inc.                   | 3 000                               | 2 997                            | 0,08                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,309 % éch. 20/02/2074                 | 351                                 | 352                              | 0,01                      | 4,000 % éch. 10/07/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,356 % éch. 20/03/2068                 | 2 486                               | 2 492                            | 0,07                      | Global Payments Inc.                                           | 26 500                              | 26 494                           | 0,75                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,361 % éch. 20/11/2065                 | 576                                 | 576                              | 0,02                      | 4,220 % éch. 02/07/2026                                        | 16 200                              | 16 189                           | 0,46                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,379 % éch. 20/09/2075                 | 1 230                               | 1 242                            | 0,04                      | 4,220 % éch. 06/07/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,389 % éch. 20/10/2075                 | 1 225                               | 1 235                            | 0,04                      | HCA, Inc.                                                      | 3 500                               | 3 490                            | 0,10                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,391 % éch. 20/01/2068                 | 3 462                               | 3 471                            | 0,10                      | 4,220 % éch. 23/07/2026                                        | 15 300                              | 15 210                           | 0,43                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,411 % éch. 20/02/2070                 | 31                                  | 31                               | 0,00                      | 4,300 % éch. 17/08/2026                                        | 16 800                              | 16 700                           | 0,47                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,459 % éch. 20/04/2054                 | 755                                 | 758                              | 0,02                      | 4,300 % éch. 18/08/2026                                        | 900                                 | 892                              | 0,03                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,491 % éch. 20/12/2068                 | 800                                 | 806                              | 0,02                      | 4,300 % éch. 10/09/2026                                        | 1 200                               | 1 190                            | 0,03                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,509 % éch. 20/06/2055 (h)             | 11 708                              | 11 794                           | 0,33                      | 4,350 % éch. 09/09/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
| 4,509 % éch. 20/01/2074 -<br>20/07/2074 | 5 422                               | 5 504                            | 0,16                      | Keurig Dr Pepper, Inc.                                         | 7 800                               | 7 782                            | 0,22                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,350 % éch. 20/07/2026                                        | 26 200                              | 26 161                           | 0,74                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,370 % éch. 13/07/2026                                        | 300                                 | 299                              | 0,01                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,400 % éch. 29/07/2026                                        | 3 500                               | 3 477                            | 0,10                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,410 % éch. 24/08/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | McCormick & Co. Inc.                                           | 7 300                               | 7 298                            | 0,21                      |                                                      |                                     |                                  |                           |
|                                         |                                     |                                  |                           | 4,000 % éch. 02/07/2026                                        |                                     |                                  |                           |                                                      |                                     |                                  |                           |

## Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description                                                                                   | Type  | Mois d'expiration | Nombre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur EURIBOR à 3 mois décembre                                   | Long  | 12/2026           | 1 270              | \$ 119                            | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois décembre                        | Long  | 03/2027           | 828                | (301)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours août                              | Long  | 08/2026           | 1 282              | 32                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre         | Long  | 09/2026           | 2 703              | 823                               | 0,02                |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 5 ans septembre       | Court | 09/2026           | 668                | (141)                             | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre                | Court | 09/2026           | 265                | 47                                | 0,00                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre                | Long  | 09/2026           | 4 227              | 422                               | 0,01                |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre               | Court | 09/2026           | 1 709              | (1 143)                           | (0,03)              |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Ultra du Trésor américain à long terme septembre | Court | 09/2026           | 161                | (192)                             | (0,01)              |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre            | Long  | 09/2026           | 300                | 311                               | 0,01                |
|                                                                                               |       |                   |                    | <b>\$ (23)</b>                    | <b>0,00</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé                    |       |                   |                    | <b>\$ (23)</b>                    | <b>0,00</b>         |

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers\*)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir                  | Indice de taux variable           | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer                                            | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour    | 3,500 %   | 18/03/2031      | £                 | 39 900                            | \$ (227) (0,01)     |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,325     | 31/08/2030      | \$                | 47 260                            | 841 0,03            |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,650     | 11/09/2027      |                   | 301 500                           | 782 0,02            |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 3,715     | 15/08/2035      |                   | 19 271                            | 356 0,01            |
| À recevoir                                         | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 30/11/2030      |                   | 51 730                            | (41) 0,00           |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | SOFR USD composé-OIS à 1 jour     | 4,000     | 15/02/2036      |                   | 22 000                            | 75 0,00             |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 2,750     | 17/06/2031      | CAD               | 82 300                            | (241) (0,01)        |
| À recevoir                                         | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,000     | 25/05/2031      |                   | 15 800                            | (70) 0,00           |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,490     | 01/10/2028      | CLP               | 564 000                           | 0 0,00              |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,590     | 01/10/2029      |                   | 1 221 900                         | (1) 0,00            |
| À recevoir <sup>(1)</sup>                          | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,676     | 01/09/2030      |                   | 1 063 700                         | (2) 0,00            |
| À recevoir                                         | CHILIBOR CLP à 6 mois             | 4,710     | 01/09/2030      |                   | 1 243 500                         | (4) 0,00            |
|                                                    |                                   |           |                 |                   | <b>\$ 1 468</b>                   | <b>0,04</b>         |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés |                                   |           |                 |                   | <b>\$ 1 468</b>                   | <b>0,04</b>         |

<sup>(1)</sup> Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers\*, sauf le nombre de contrats)

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

#### OPTIONS ACHETÉES

##### SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description                                               | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel <sup>(1)</sup> | Coût            | Juste valeur    | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------------|-----------------|---------------------|
| BPS          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,250 %         | 09/12/2026        | 5 800                            | \$ 3            | \$ 10           | 0,00                |
| DUB          | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,650           | 09/09/2026        | 450 400                          | 463             | 2 041           | 0,06                |
| FAR          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 03/08/2026        | 185 500                          | 166             | 1               | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 4,250           | 09/12/2026        | 691 000                          | 315             | 1 161           | 0,03                |
| GLM          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 28/07/2026        | 540 100                          | 405             | 2               | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 11/08/2026        | 191 600                          | 215             | 2               | 0,00                |
| MYC          | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 03/08/2026        | 220 300                          | 198             | 2               | 0,00                |
|              | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote  | SOFR USD à 3 mois       | À payer                          | 3,000           | 11/08/2026        | 210 200                          | 235             | 3               | 0,00                |
|              | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | SOFR USD à 3 mois       | À recevoir                       | 3,650           | 09/09/2026        | 132 300                          | 133             | 600             | 0,02                |
|              |                                                           |                         |                                  |                 |                   |                                  | <b>\$ 2 133</b> | <b>\$ 3 822</b> | <b>0,11</b>         |

<sup>(1)</sup> Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 29 189            | \$ 20 872          | \$ 650                | \$ 650                                  | 0,02                |
|              | 07/2026           | \$              | 41                | CAD 59             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
|              | 08/2026           | CAD             | 59                | \$ 41              | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BOA          | 07/2026           | \$              | 8                 | ILS 24             | 0                     | 0                                       | 0,00                |
| BPS          | 07/2026           | AUD             | 10 417            | \$ 7 178           | 0                     | (39)                                    | 0,00                |



| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer |           | Devise à recevoir |         | Plus-value latente |       | (Moins-value) latente |         | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-----------|-------------------|---------|--------------------|-------|-----------------------|---------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| CBK          | 07/2026           | CAD             | 3 135     | \$                | 2 249   | \$                 | 39    | \$                    | 0       | \$                                      | 39                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 12 470    |                   | 14 221  |                    | 0     |                       | (36)    |                                         | (36)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | £               | 1 573     |                   | 2 111   |                    | 23    |                       | 0       |                                         | 23                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 351     | AUD               | 1 918   |                    | 0     |                       | (22)    |                                         | (22)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 33        | CZK               | 697     |                    | 0     |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 1 267     | £                 | 962     |                    | 10    |                       | 0       |                                         | 10                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 3 410     | \$                | 2 414   |                    | 52    |                       | 0       |                                         | 52                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 278     |                   | 924     |                    | 23    |                       | 0       |                                         | 23                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | HUF             | 23 275    |                   | 76      |                    | 1     |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 3 429     | AUD               | 4 862   |                    | 0     |                       | (61)    |                                         | (61)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 72        | CAD               | 100     |                    | 0     |                       | (2)     |                                         | (2)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 12        | ILS               | 36      |                    | 0     |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           |                 | 36        | CZK               | 753     |                    | 0     |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
| FAR          | 07/2026           | £               | 47 123    | \$                | 63 368  |                    | 824   |                       | 0       |                                         | 824                 | 0,02   |
| GLM          | 08/2026           | \$              | 5         | ILS               | 13      |                    | 0     |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 3 972     | CAD               | 5 652   |                    | 12    |                       | 0       |                                         | 12                  | 0,00   |
| JPM          | 08/2026           | CAD             | 5 644     | \$                | 3 972   |                    | 0     |                       | (12)    |                                         | (12)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 126 341   |                   | 90 068  |                    | 2 539 |                       | 0       |                                         | 2 539               | 0,07   |
|              | 07/2026           | \$              | 1 481     | €                 | 1 276   |                    | 0     |                       | (22)    |                                         | (22)                | 0,00   |
| MBC          | 07/2026           |                 | 1 033     | £                 | 770     |                    | 0     |                       | (11)    |                                         | (11)                | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 76        | HUF               | 23 307  |                    | 0     |                       | (1)     |                                         | (1)                 | 0,00   |
|              | 08/2026           |                 | 4         | ILS               | 12      |                    | 0     |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | AUD             | 4 864     | \$                | 3 366   |                    | 12    |                       | (16)    |                                         | (4)                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 2 959     |                   | 3 432   |                    | 49    |                       | 0       |                                         | 49                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 64 598    | AUD               | 93 558  |                    | 255   |                       | (35)    |                                         | 220                 | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 6 270     | €                 | 5 468   |                    | 0     |                       | (18)    |                                         | (18)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | AUD             | 91 062    | \$                | 62 794  |                    | 0     |                       | (257)   |                                         | (257)               | (0,01) |
| MYI          | 07/2026           | €               | 50        |                   | 57      |                    | 0     |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
| SOG          | 07/2026           | \$              | 229       | €                 | 201     |                    | 1     |                       | 0       |                                         | 1                   | 0,00   |
|              | 07/2026           | €               | 133 564   | \$                | 155 808 |                    | 3 105 |                       | 0       |                                         | 3 105               | 0,09   |
|              | 07/2026           | \$              | 50 979    | AUD               | 73 883  |                    | 207   |                       | 0       |                                         | 207                 | 0,01   |
|              | 07/2026           |                 | 147 523   | €                 | 129 691 |                    | 752   |                       | 0       |                                         | 752                 | 0,02   |
| SSB          | 08/2026           | AUD             | 73 883    | \$                | 50 946  |                    | 0     |                       | (210)   |                                         | (210)               | (0,01) |
|              | 08/2026           | €               | 129 691   |                   | 147 724 |                    | 0     |                       | (751)   |                                         | (751)               | (0,02) |
|              | 07/2026           | CAD             | 1 497     |                   | 1 085   |                    | 30    |                       | 0       |                                         | 30                  | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 36        | CAD               | 52      |                    | 0     |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 07/2026           |                 | 62 080    | £                 | 46 964  |                    | 253   |                       | 0       |                                         | 253                 | 0,01   |
|              | 08/2026           | CAD             | 52        | \$                | 36      |                    | 0     |                       | 0       |                                         | 0                   | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 12 470    |                   | 14 236  |                    | 0     |                       | (40)    |                                         | (40)                | 0,00   |
|              | 08/2026           | £               | 46 964    |                   | 62 079  |                    | 0     |                       | (253)   |                                         | (253)               | (0,01) |
| UAG          | 09/2026           | CLP             | 3 899 112 |                   | 4 381   |                    | 150   |                       | 0       |                                         | 150                 | 0,01   |
|              |                   |                 |           |                   |         | \$                 | 8 987 | \$                    | (1 788) | \$                                      | 7 199               | 0,21   |

## CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|--------|
| AZD          | 07/2026           | AUD             | 137 580           | \$ 94 862          | \$ 0                  | \$ (454)                                | (0,01)              |        |
|              | 07/2026           | \$              | 72 552            | AUD 101 877        | 0                     | (1 973)                                 | (0,06)              |        |
|              | 08/2026           |                 | 94 801            | 137 580            | 459                   | 0                                       | 459                 | 0,01   |
| BPS          | 07/2026           |                 | 202 236           | 293 164            | 869                   | 0                                       | 869                 | 0,02   |
| BRC          | 07/2026           |                 | 56 274            | 79 953             | 0                     | (883)                                   | (0,02)              |        |
| BSH          | 07/2026           | AUD             | 72 614            | \$ 50 437          | 131                   | 0                                       | 131                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 56 256            | AUD 78 937         | 0                     | (1 568)                                 | (1 568)             | (0,04) |
|              | 08/2026           |                 | 50 405            | 72 614             | 0                     | (128)                                   | (128)               | 0,00   |
| CBK          | 07/2026           | AUD             | 1 041             | \$ 744             | 23                    | 0                                       | 23                  | 0,00   |
| DUB          | 07/2026           | \$              | 7 891             | AUD 11 049         | 0                     | (237)                                   | (237)               | (0,01) |
| FAR          | 07/2026           | AUD             | 70 767            | \$ 49 141          | 114                   | 0                                       | 114                 | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 74 960            | AUD 105 080        | 0                     | (2 162)                                 | (2 162)             | (0,07) |
|              | 08/2026           |                 | 49 110            | 70 767             | 0                     | (112)                                   | (112)               | 0,00   |
| MBC          | 07/2026           | AUD             | 97 762            | \$ 67 353          | 0                     | (377)                                   | (377)               | (0,01) |
|              | 07/2026           | \$              | 203 688           | AUD 295 189        | 868                   | (49)                                    | 819                 | 0,02   |
|              | 08/2026           |                 | 67 310            | 97 762             | 380                   | 0                                       | 380                 | 0,01   |
| SOG          | 07/2026           | AUD             | 23 383            | \$ 16 135          | 0                     | (65)                                    | (65)                | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 17 239            | AUD 24 228         | 0                     | (454)                                   | (454)               | (0,01) |
|              | 08/2026           |                 | 16 124            | 23 383             | 66                    | 0                                       | 66                  | 0,00   |
|              |                   |                 |                   | \$ 2 910           | \$ (8 462)            | \$ (5 552)                              | (0,17)              |        |

## Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |         |         |        |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------|---------|--------|
| BOA          | 07/2026           | €               | 1 157             | \$                 | 1 347                 | \$                                      | 24                  | \$      | 24      | 0,00   |
| BPS          | 07/2026           |                 | 709               |                    | 809                   |                                         | 0                   |         | (2)     | 0,00   |
|              | 07/2026           | \$              | 62 093            | €                  | 53 304                |                                         | 2                   | (1 153) | (1 151) | (0,03) |
| BSH          | 07/2026           |                 | 60 700            |                    | 52 068                |                                         | 0                   | (1 171) | (1 171) | (0,03) |
| CBK          | 07/2026           |                 | 1 022             |                    | 876                   |                                         | 0                   | (20)    | (20)    | 0,00   |
| FAR          | 07/2026           | €               | 50 147            | \$                 | 57 192                |                                         | 0                   | (141)   | (141)   | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 57 270            | €                  | 50 147                |                                         | 140                 | 0       | 140     | 0,00   |
| MBC          | 07/2026           | €               | 54 730            | \$                 | 62 188                |                                         | 16                  | (401)   | (385)   | (0,01) |
|              | 07/2026           | \$              | 831               | €                  | 714                   |                                         | 0                   | (15)    | (15)    | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 201               | \$                 | 229                   |                                         | 0                   | (1)     | (1)     | 0,00   |
|              | 08/2026           | \$              | 60 813            | €                  | 53 470                |                                         | 401                 | 0       | 401     | 0,01   |
| SOG          | 07/2026           | €               | 53 470            | \$                 | 60 822                |                                         | 0                   | (310)   | (310)   | (0,01) |
|              | 07/2026           | \$              | 61 940            | €                  | 53 097                |                                         | 0                   | (1 234) | (1 234) | (0,04) |
|              | 08/2026           |                 | 60 904            |                    | 53 470                |                                         | 310                 | 0       | 310     | 0,01   |
| SSB          | 07/2026           |                 | 175               |                    | 154                   |                                         | 0                   | 0       | 0       | 0,00   |
|              | 08/2026           | €               | 154               | \$                 | 176                   |                                         | 0                   | 0       | 0       | 0,00   |
|              |                   |                 |                   | \$                 | 893                   | \$                                      | (4 448)             | \$      | (3 555) | (0,10) |

Au 30 juin 2026, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie                                       | Mois de règlement | Devise à livrer |     | Devise à recevoir |     | Plus-value latente |   | (Moins-value) latente |     | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|----------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-----|-------------------|-----|--------------------|---|-----------------------|-----|-----------------------------------------|---------------------|
| AZD                                                | 07/2026           | \$              | 98  | £                 | 73  | \$                 | 0 | \$                    | (1) | \$ (1)                                  | 0,00                |
| BPS                                                | 07/2026           | £               | 68  | \$                | 89  |                    | 0 |                       | (1) | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 07/2026           | \$              | 111 | £                 | 83  |                    | 0 |                       | (1) | (1)                                     | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           |                 | 89  |                   | 68  |                    | 1 |                       | 0   | 1                                       | 0,00                |
| FAR                                                | 07/2026           |                 | 5   |                   | 4   |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
| JPM                                                | 07/2026           |                 | 108 |                   | 81  |                    | 0 |                       | (1) | (1)                                     | 0,00                |
| NSL                                                | 07/2026           | £               | 16  | \$                | 21  |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 21  | £                 | 16  |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
| SCX                                                | 07/2026           | £               | 78  | \$                | 104 |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 104 | £                 | 78  |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
| SOG                                                | 07/2026           | £               | 78  | \$                | 103 |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 103 | £                 | 78  |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
| SSB                                                | 07/2026           | £               | 1   | \$                | 1   |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    | 08/2026           | \$              | 1   | £                 | 1   |                    | 0 |                       | 0   | 0                                       | 0,00                |
|                                                    |                   |                 |     |                   |     | \$                 | 1 | \$                    | (4) | \$ (3)                                  | 0,00                |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote |                   |                 |     |                   |     |                    |   |                       |     | \$ 1 911                                | 0,05                |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

| DESCRIPTION                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | JUSTE<br>VALEUR<br>(en milliers) | EN % DE<br>L'ACTIF<br>NET |
|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT                   |                                     |                                  |                           |
| Banco Itau Chile                       |                                     |                                  |                           |
| 4,290 % éch. 01/12/2026                | \$ 10 200                           | \$ 10 197                        | 0,29                      |
| Total des Certificats de dépôt         |                                     | \$ 10 197                        | 0,29                      |
| Total des Investissements              |                                     | \$ 4 582 818                     | 129,61                    |
| Autres actifs et passifs à court terme |                                     | \$ (1 046 978)                   | (29,61)                   |
| Actif net                              |                                     | \$ 3 535 840                     | 100,00                    |

### NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers\*) :

\* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2025 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon  | Date d'échéance | Date d'achat | Coût            | Juste valeur    | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------------|-----------------|---------------------|
| Bank of America Corp,     | 3,615 % | 16/03/2028      | 13/04/2026   | \$ 1 089        | \$ 1 062        | 0,03                |
| Hardwood Funding LLC      | 4,360   | 08/06/2029      | 16/01/2026   | 2 100           | 2 061           | 0,06                |
|                           |         |                 |              | <b>\$ 3 189</b> | <b>\$ 3 123</b> | <b>0,09</b>         |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 76 646 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) et un montant en numéraire de 284 \$ (31 décembre 2025 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 30 juin 2026.

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 7 558 \$ (31 décembre 2025 : 108 282 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 16 014 \$ (31 décembre 2025 : 16 104 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2026.

Un montant en numéraire de 7 750 \$ (31 décembre 2025 : 4 500 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 30 juin 2026.

Évaluations de la juste valeur<sup>(1)</sup>

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 30 juin 2026 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 4 176 579                                         | \$ 40 016                                         | \$ 4 216 595        |
| Fonds d'investissement                        | 352 670                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 352 670             |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | 811                                                                               | 2 545                                                | 0                                                 | 3 356               |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit      | 0                                                                                 | 10 197                                               | 0                                                 | 10 197              |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 353 481</b>                                                                 | <b>\$ 4 189 321</b>                                  | <b>\$ 40 016</b>                                  | <b>\$ 4 582 818</b> |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2025 :

| Catégorie <sup>(2)</sup>                      | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur        |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------|
| Valeurs mobilières                            | \$ 0                                                                              | \$ 2 896 376                                         | \$ 13 137                                         | \$ 2 909 513        |
| Fonds d'investissement                        | 271 070                                                                           | 0                                                    | 0                                                 | 271 070             |
| Contrats de mise en pension                   | 0                                                                                 | 2 600                                                | 0                                                 | 2 600               |
| Instruments financiers dérivés <sup>(3)</sup> | (275)                                                                             | 7 100                                                | 0                                                 | 6 825               |
| <b>Totaux</b>                                 | <b>\$ 270 795</b>                                                                 | <b>\$ 2 906 076</b>                                  | <b>\$ 13 137</b>                                  | <b>\$ 3 190 008</b> |

<sup>(1)</sup> Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.<sup>(2)</sup> Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.<sup>(3)</sup> Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                  | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|-----------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------------------------------|---------------------|
| BOS                                           | 3,870 %        | 25/06/2026        | 09/07/2026      | \$ (37 090)      | \$ (37 114)                              | (1,05)              |
|                                               | 3,870          | 26/06/2026        | 10/07/2026      | (22 811)         | (22 823)                                 | (0,65)              |
| BPS                                           | 3,830          | 24/06/2026        | 08/07/2026      | (13 182)         | (13 192)                                 | (0,37)              |
| <b>Total des Contrats de prise en pension</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (73 129)</b>                       | <b>(2,07)</b>       |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 2026 :

| Contrepartie                                                             | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | En % de l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------|---------------------|
| BCY                                                                      | 3,740 %        | 24/06/2026        | 01/07/2026      | \$ (7 563)       | \$ (7 568)                                                          | (0,21)              |
| <b>Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos</b> |                |                   |                 |                  | <b>\$ (7 568)</b>                                                   | <b>(0,21)</b>       |

## Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Contrepartie | Au 30 juin 2026                                            |                         |                                   | Au 31 décembre 2025                                        |                         |                                   |
|--------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|              | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes <sup>(1)</sup> |
| AZD          | \$ (1 319)                                                 | \$ 1 450                | \$ 131                            | \$ 325                                                     | \$ (150)                | \$ 175                            |
| BOA          | 24                                                         | (30)                    | (6)                               | 2 641                                                      | (2 730)                 | (89)                              |
| BPS          | (301)                                                      | 1 340                   | 1 039                             | (506)                                                      | 630                     | 124                               |
| BRC          | (883)                                                      | 1 160                   | 277                               | 721                                                        | (900)                   | (179)                             |
| BSH          | (2 736)                                                    | 3 160                   | 424                               | 493                                                        | (550)                   | (57)                              |
| CBK          | 16                                                         | 0                       | 16                                | (32)                                                       | 0                       | (32)                              |
| DUB          | 1 803                                                      | (1 790)                 | 13                                | 659                                                        | (570)                   | 89                                |
| FAR          | (175)                                                      | 640                     | 465                               | (2 778)                                                    | 3 250                   | 472                               |
| GLM          | 4                                                          | (40)                    | (36)                              | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| JPM          | 2 504                                                      | (2 980)                 | (476)                             | 3 531                                                      | (3 500)                 | 31                                |
| MBC          | 812                                                        | 0                       | 812                               | 776                                                        | (820)                   | (44)                              |
| MYC          | 605                                                        | (660)                   | (55)                              | 89                                                         | 0                       | 89                                |
| MYI          | 1                                                          | (10)                    | (9)                               | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               |
| SCX          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 155                                                        | (110)                   | 45                                |
| SOG          | 1 416                                                      | (1 380)                 | 36                                | (576)                                                      | 620                     | 44                                |
| SSB          | (10)                                                       | 0                       | (10)                              | 1                                                          | 0                       | 1                                 |
| UAG          | 150                                                        | 0                       | 150                               | (1)                                                        | 0                       | (1)                               |
| WST          | S/O                                                        | S/O                     | S/O                               | 354                                                        | (280)                   | 74                                |

<sup>(1)</sup> L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

### Informations comparatives

Voici une analyse des actifs du Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 en proportion de l'actif total du Fonds :

| Analyse de l'actif total                                         | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle     | 47,99            | 36,08                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé*     | 37,08            | 35,49                |
| Autres valeurs mobilières                                        | 1,49             | 0,37                 |
| Fonds d'investissement                                           | 7,24             | 6,70                 |
| Contrats de mise en pension                                      | S/O              | 0,06                 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,04             | 0,02                 |
| Instruments financiers dérivés compensés                         | 0,04             | 0,03                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         | 0,34             | 0,28                 |
| Certificats de dépôt                                             | 0,21             | S/O                  |
| Autres actifs                                                    | 5,57             | 20,97                |
| Total des actifs                                                 | 100,00           | 100,00               |

\* Conformément à la liste des marchés figurant à l'Annexe 1 du Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés de la Directive OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 :

| Investissements à la juste valeur | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|
| Australie                         | 4,58             | 5,28                 |
| Bermudes                          | 0,24             | 1,12                 |
| Canada                            | 2,55             | 4,17                 |
| Îles Caïmans                      | 4,83             | 4,57                 |
| Chili                             | 0,41             | S/O                  |
| Finlande                          | S/O              | 0,14                 |
| France                            | 1,25             | 3,29                 |
| Allemagne                         | 0,92             | 0,90                 |
| Irlande                           | 4,68             | 3,80                 |
| Israël                            | 0,70             | 0,02                 |
| Italie                            | 0,04             | S/O                  |
| Japon                             | 1,66             | 2,62                 |
| Jersey, Îles Anglo-Normandes      | 1,32             | 1,72                 |
| Kazakhstan                        | 0,03             | S/O                  |
| Liberia                           | 0,27             | 1,03                 |
| Luxembourg                        | 0,82             | 1,46                 |
| Mexique                           | 0,45             | S/O                  |
| Multinationales                   | 0,21             | 0,04                 |
| Pays-Bas                          | 1,81             | 2,53                 |
| Norvège                           | 0,08             | 0,85                 |
| Panama                            | 0,35             | S/O                  |
| Portugal                          | 0,06             | 0,10                 |
| Qatar                             | 0,16             | 0,02                 |
| Roumanie                          | 0,03             | S/O                  |
| Arabie saoudite                   | 0,82             | S/O                  |
| Singapour                         | S/O              | 0,14                 |
| Corée du Sud                      | 0,23             | 0,23                 |
| Espagne                           | 0,70             | 0,50                 |
| Suède                             | 0,05             | 0,47                 |
| Suisse                            | 0,14             | 0,34                 |
| Émirats arabes unis               | 0,21             | S/O                  |
| Royaume-Uni                       | 5,97             | 3,91                 |
| États-Unis                        | 48,25            | 54,11                |
| Instruments à court terme         | 35,44            | 14,35                |
| Fonds d'investissement            | 9,97             | 10,03                |
| Contrats de mise en pension       | S/O              | 0,10                 |

| Investissements à la juste valeur                                | 30 juin 2026 (%) | 31 décembre 2025 (%) |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé |                  |                      |
| Contrats à terme standardisés                                    | 0,00             | (0,01)               |
| Instruments financiers dérivés compensés                         |                  |                      |
| Swaps de taux d'intérêt                                          | 0,04             | 0,04                 |
| Instruments financiers dérivés hors cote                         |                  |                      |
| Options achetées                                                 |                  |                      |
| Swaptions de taux d'intérêt                                      | 0,11             | 0,04                 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O              | 0,24                 |
| Contrats de change à terme                                       | 0,21             | (0,20)               |
| Contrats de change à terme couverts                              | (0,27)           | 0,14                 |
| Certificats de dépôt                                             | 0,29             | S/O                  |
| Autres actifs et passifs à court terme                           | (29,61)          | (18,09)              |
| Actif net                                                        | 100,00           | 100,00               |

### 1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Chaque Fonds (appelé individuellement un « Fonds » et collectivement les « Fonds ») présenté dans ce rapport est un compartiment de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société »), société à capital variable à compartiments multiples et responsabilité séparée entre les Fonds, immatriculée sous le numéro 276928 en vertu de la loi irlandaise de 2014 sur les sociétés (Companies Act) et agréée par la Banque centrale d'Irlande (la « Banque centrale »), conformément au Règlement de la Communauté européenne (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 (S.I. N° 352 de 2011), tel que modifié (le « Règlement OPCVM »). La Société est à compartiments multiples et constituée de différents Fonds, comprenant chacun une ou plusieurs catégories d'actions (les « Catégories »). Le Conseil d'administration de la Société (le « Conseil » ou les « Administrateurs ») peut, à son entière discrétion, émettre plusieurs catégories d'actions (« Catégorie ») pour un même Fonds. Un portefeuille d'actifs distinct est maintenu pour chaque Fonds et investi conformément aux objectifs et politiques d'investissement applicables pour ce Fonds. Le Conseil peut créer périodiquement des Fonds supplémentaires après accord préalable écrit de la Banque centrale. La Société a été constituée le 10 décembre 1997.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire ») est le gestionnaire de la Société.

Comme prévu dans le Prospectus de la Société, Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd et PIMCO Europe GmbH (chacun un « Conseiller en investissement ») ont été nommés en tant que conseiller en investissement pour divers Fonds de la Société. PIMCO Asia Limited et PIMCO Asia Pte Ltd. (chacun, un conseiller en investissement) ont été validés par la Banque centrale pour agir en tant que conseiller en investissement pour les fonds irlandais.

Conformément au Prospectus de la Société, chaque Conseiller en investissement peut déléguer la gestion discrétionnaire des investissements des Fonds à un ou plusieurs conseillers en investissement par délégation, sous réserve de toutes les exigences légales et réglementaires applicables. Lorsqu'un Conseiller en investissement est nommé pour un ou des Fonds spécifique(s), le Conseiller en investissement nomme chacun des autres Conseillers en investissement, PIMCO Asia Limited et PIMCO Asia Pte Ltd., comme conseillers en investissement par délégation pour ce ou ces Fonds spécifique(s).

Les commissions de chaque conseiller en investissement par délégation ainsi nommé seront payées par le Gestionnaire ou par les Conseillers en investissement au nom du Gestionnaire et prélevées sur les Frais de gestion.

Le siège social de la Société est sis au 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irlande.

### 2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Les principales conventions comptables et techniques de valorisation adoptées par la Société et appliquées lors de la préparation des présents états financiers sont conformes à celles qui ont été appliquées aux états financiers annuels audités de la Société pour l'exercice clos le 31 décembre 2025 (les « États financiers annuels audités »). Les états financiers sont établis selon le principe de la continuité d'exploitation pour l'ensemble des Fonds.

#### Base de préparation

Les états financiers présentés sont des états financiers condensés non audités établis pour la période de six mois close le 30 juin 2026. Ils sont préparés conformément à la norme FRS 104 (Financial Reporting Standard 104 : « Interim Financial Reporting » publiée par le Financial Reporting Council (« FRC ») et la Réglementation OPCVM.

Les états financiers condensés non audités doivent être lus conjointement aux États financiers annuels audités, sur lesquels le commissaire aux comptes a émis une opinion sans réserve et qui ont été préparés conformément à la norme FRS 102 (« FRS 102 »), la « Norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » émise par le FRC, à la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et à la Réglementation sur les OPCVM. Les normes comptables généralement admises en Irlande pour l'élaboration des états financiers sont celles émises par le FRC.

Des états financiers de clôture audités ont été préparés pour le Fonds Dynamic Multi-Asset Fund pour l'exercice clos le 31 décembre 2024. En conséquence, il n'est plus établi d'états financiers pour ce Fonds. Au 31 décembre 2024, le fonds multi-actifs dynamique détenait des réclamations déposées auprès du Tribunal administratif fédéral suisse concernant certains instruments de capital de catégorie 1

supplémentaire émis par Credit Suisse Group AG, dont 3 400 000 actions dans le cadre d'une réclamation AT1 de Credit Suisse AG, évaluées à une valeur équitable de 410 430 euros. Ce Titre de créance AT1 concerne une participation dans une position en obligations d'entreprises dans le secteur bancaire et financier et était classé au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur au 30 juin 2026. Le Titre de créance AT1 reste détenu par le Fonds au 30 juin 2026, avec une juste valeur de 1 048 281 €. Au 30 juin 2026, ce montant est inclus dans la valeur des Autres actifs financiers dans le Bilan établi au niveau de la Société. Le solde résiduel de trésorerie et de revenus à recevoir de 1 175 869 € lié au Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est également inclus dans le Bilan établi au niveau de la Société.

Les Administrateurs estiment que les informations qui doivent figurer dans l'État global des bénéfices et pertes comptabilisés et dans le Rapprochement des mouvements des fonds propres sont présentées dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution des actifs nets.

La Société a fait usage de l'exemption offerte aux fonds d'investissement de type ouvert qui détiennent une proportion considérable d'investissements hautement liquides et évalués à la juste valeur en vertu de la Section 7 de la norme FRS 102 et ne présente pas d'état des flux de trésorerie.

Les états financiers sont dressés selon la méthode du coût historique, telle que modifiée par la réévaluation des éléments d'actif et de passif financiers détenus à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

La Société a adopté le dollar américain comme devise de présentation. Les états financiers de chaque Fonds sont préparés dans la devise de fonctionnement du Fonds respectif. Le Bilan de la Société est converti à l'aide des taux de change à la clôture de la période, le Compte de résultat et l'État de l'évolution de l'actif net de la Société sont convertis à un taux de change moyen (une approximation des taux actuels) de la période pour inclusion dans les états financiers de la Société.

Tous les montants ont été arrondis au millier le plus proche, sauf indication contraire. Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Le Tableau des investissements de certains Fonds peut détenir des valeurs mobilières ayant une valeur nominale nulle et une juste valeur nulle lorsque les montants réels de valeur nominale et de juste valeur sont arrondis au millier le plus proche.

La méthodologie de swing pricing appliquée par la Société au cours de la période financière est cohérente avec celle appliquée dans les États financiers annuels audités.

Au 30 juin 2026, le mécanisme de tarification dynamique s'appliquait au fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund ainsi qu'au fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund. Aucun swing pricing n'a été appliqué à l'un des Fonds au 31 décembre 2025.

La VNI par action est indiquée à la Note 16 et peut inclure un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire. Les ajustements de la Valeur Nette d'Inventaire ne sont pas comptabilisés dans le Bilan, dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution des actifs nets.

### 3. INVESTISSEMENTS À LA JUSTE VALEUR ET HIÉRARCHIE DE LA JUSTE VALEUR

La Société doit divulguer la hiérarchie de la juste valeur dans laquelle les évaluations de la juste valeur sont catégorisées en ce qui concerne les actifs et les passifs. Les informations reposent sur une hiérarchie de la juste valeur selon trois niveaux pour les données utilisées dans les techniques d'évaluation permettant de calculer la juste valeur.

La juste valeur est définie comme le montant auquel un actif peut être échangé, un passif réglé ou un instrument de fonds propres octroyé peut être échangé entre parties informées et disposées à contracter dans des conditions de pleine concurrence. La divulgation d'une hiérarchie de la juste valeur doit être faite distinctement pour chaque grande catégorie d'actifs et de passifs et classe les évaluations de la juste valeur selon trois niveaux (Niveaux 1, 2 et 3). Les données ou la méthode utilisées pour l'évaluation des titres ne représentent pas nécessairement une indication du risque associé à l'investissement dans ces titres. Les niveaux 1, 2 et 3 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivants :

- Niveau 1 — Cotations de marchés actifs ou de bourses de valeurs concernant des éléments d'actif et de passif identiques.



- Niveau 2 — Autres données significatives observables y compris, sans s'y limiter, des cotations concernant des éléments d'actif ou de passif similaires de marchés actifs, des cotations concernant des éléments d'actif ou de passif identiques ou similaires de marchés non actifs, des données autres que des cotations observables pour les éléments d'actif ou de passif (comme les taux d'intérêt, les courbes de taux, les volatilités, les remboursements anticipés, les sévérités des pertes, les risques de crédit et les taux de défaillance) ou toute autre donnée corroborée par le marché.
- Niveau 3 — Données significatives non observables basées sur les meilleures informations disponibles compte tenu de la situation, si les données observables ne sont pas disponibles, y compris les hypothèses du Conseil, ou de personnes agissant selon ses instructions, qui servent à déterminer la juste valeur des investissements.

Le lecteur est renvoyé au Tableau des investissements pour l'analyse des actifs et passifs financiers de chaque Fonds, mesurés à la juste valeur au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025. La méthodologie appliquée par les Fonds à la classification des actifs et passifs financiers mesurés à la juste valeur en utilisant la hiérarchie de la juste valeur est conforme à celle appliquée aux États financiers annuels audités.

#### 4. GESTION DE PORTEFEUILLE EFFICACE

Dans les limites autorisées par les objectifs et politiques d'investissement des Fonds et sous réserve des limites définies périodiquement par la Banque centrale et les dispositions du Prospectus, le recours, à des fins de gestion de portefeuille efficace, aux instruments financiers dérivés et aux techniques d'investissement est possible pour tous les Fonds. Les Fonds peuvent utiliser ces instruments financiers dérivés et ces techniques d'investissement pour assurer une couverture contre les fluctuations des taux d'intérêt, des taux de change des devises non fonctionnelles ou des cours des titres ou dans le cadre de leur stratégie globale d'investissement.

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de mise en pension au cours de la période close le 30 juin 2026 était de 230 007 776 \$(/1 057 356 \$) (30 juin 2025 : 138 713 329 \$(/0 \$)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de prise en pension au cours de la période close le 30 juin 2026 était de 1 844 050 \$(/145 388 719 \$) (30 juin 2025 : 339 914 \$(/102 041 044 \$)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Opérations par vente et rachat dos-à-dos au cours de la période close le 30 juin 2026 était de 0 \$(/2 843 936 \$) (30 juin 2025 : 0 \$(/8 542 867 \$)).

#### 5. POLITIQUE DE DISTRIBUTION DE DIVIDENDES

Comme stipulé dans le Supplément du Fonds correspondant, la distribution des dividendes peut être déclarée sur :

- le produit net des investissements consistant en intérêts et dividendes ;
- les gains réalisés sur la liquidation d'investissements moins les pertes réalisées et latentes (incluant frais et dépenses). Si les bénéfices réalisés lors de la cession d'investissements minorés des pertes réalisées et latentes sont négatifs, les Fonds peuvent toutefois verser des dividendes à partir du revenu net des investissements et/ou du capital.
- d'autres fonds (capital compris) susceptibles d'être légalement distribués à partir du Fonds ou de la Catégorie d'actions du Fonds concerné.

Les Frais de gestion et autres, ou une partie de ceux-ci, peuvent être imputés au capital et, de ce fait, celui-ci peut s'éroder et les distributions seront réalisées en renonçant à la croissance potentielle future du capital. Ce cycle peut se poursuivre jusqu'à épuisement total du capital. Le raisonnement qui préside à l'imputation au capital consiste à maximiser le montant distribuable aux actionnaires.

Dans le cas des Catégories d'actions de distribution II, les Administrateurs peuvent, à leur gré, payer les commissions à partir du capital et prendre en considération l'écart de rendement entre la Catégorie d'actions couverte pertinente et la Catégorie d'actions de base (qui constitue une distribution à partir du capital). L'écart de rendement peut être positif ou négatif et est calculé en prenant en compte la contribution de la couverture de la Catégorie d'actions découlant des Catégories couvertes.

Pour toutes les Catégories des Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Income Fund, Income Fund II, Low Duration Income Fund, Mortgage Opportunities Fund, PIMCO ESG Income Fund et US Short-Term Fund, à l'exception des Catégories G Institutions, G Détail, E de distribution Q, E de distribution II Q et Investisseurs de distribution A (le cas échéant) des Fonds susmentionnés, les distributions de dividendes sont déclarées tous les mois et ces dividendes sont, au gré de l'Actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque mois.

Dans le cas des Catégories Administrations des Fonds Diversified Income Fund et PIMCO Balanced Income and Growth Fund, des Catégories Institutions et Investisseurs du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, et des Catégories d'Actions M Détail, BE Détail, BM Détail, UM Détail et N Détail de tous les autres Fonds, les distributions de dividendes sont déclarées chaque mois et ces dividendes sont, au gré de l'Actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque mois.

Dans le cas des Catégories G Institutions, G Détail et Investisseurs de Distribution A, les distributions de dividendes sont déclarées tous les ans et ces dividendes sont, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres Actions chaque année.

Pour tous les autres Fonds ayant des Catégories d'Actions de distribution, les dividendes seront déclarés trimestriellement et, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis en actions supplémentaires après déclaration.

Dans le cas des Catégories de décumulation BM Détail et de décumulation M Détail, les Administrateurs peuvent, à leur discrétion, verser des distributions et des commissions à partir du capital. Les Frais de gestion et les autres frais éventuels, ou une partie de ceux-ci, peuvent être prélevés sur le capital des Catégories de décumulation BM Détail et de décumulation M Détail. Par conséquent, le capital est susceptible de s'éroder et le revenu peut être généré en renonçant au potentiel de croissance future du capital.

La distribution de dividendes aux porteurs de parts rachetables figure au poste Frais financiers du Compte de résultat. Le revenu ou les plus-values affecté(es) aux Actions de capitalisation ne sont ni déclaré(es), ni distribué(es), mais la Valeur Nette d'Inventaire par action des Actions de capitalisation est augmentée en fonction de ce revenu ou de ces plus-values. Les distributions de dividendes non réinvestis dans des actions sont versées aux actionnaires par virement bancaire. Toute distribution de dividende non réclamée à l'issue d'un délai de six ans à compter de la date de déclaration de ladite distribution est perdue par défaut et reversée sur le compte du Fonds concerné. Les Actionnaires peuvent choisir de réinvestir leurs distributions de dividendes dans d'autres Actions ou de percevoir leurs distributions de dividendes en espèces.

Une partie des distributions de dividendes figurant dans le Compte de résultat a été payée sur le capital des Fonds ci-dessous (montants en milliers) :

| Fonds                                                  | Période close<br>le 30 juin 2024 | Période close<br>le 30 juin 2024 |
|--------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 0                             | \$ 114                           |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund                | 0                                | 3                                |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 270 048                          | 20 324                           |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                          | 0                                | 83                               |
| Fonds Commodity Real Return Fund                       | 186                              | 0                                |
| Fonds Diversified Income Fund                          | 36 593                           | 34 003                           |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | 0                                | 1 142                            |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | 887                              | 632                              |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 1                                | 0                                |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                            | 0                                | 43                               |
| Fonds Global Bond Fund                                 | 12                               | 236                              |
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 117                              | 97                               |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 9                                | 618                              |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 2 842                            | 3 024                            |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 0                                | 342                              |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 183                              | 0                                |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 997                              | 98                               |
| Fonds Income Fund                                      | 85 607                           | 21 821                           |
| Fonds Income Fund II                                   | 339                              | 0                                |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 0                                | 56                               |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0                                | 13                               |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 5 207                            | 0                                |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | 416                              | 5 249                            |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 22                               | 0                                |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | 20                               | 0                                |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | 59                               | 0                                |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | 0                                | 9                                |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 0                                | 212                              |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                           | £ 96                             | £ 1 121                          |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 3                                | 0                                |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | \$ 2                             | \$ 5                             |

## 6. RÉTROCESSION DE COMMISSIONS

La Société ou son Conseiller en investissement peut effectuer des opérations pour le compte des Fonds avec ou par le biais de l'agence de courtiers exécutifs, qui peut, outre l'exécution d'ordres ordinaires, de temps à autre, fournir ou veiller à ce que soient fournis à la Société ou ses représentants des biens, services ou autres bénéfices tels que des services de recherche et conseils. La Société ou son Conseiller en investissement peuvent payer à ces courtiers des commissions de courtage dont une partie peut être affectée à la fourniture de biens ou services autorisés. Ces Conseillers en investissement qui sont des sociétés d'investissement dans le cadre de la Directive concernant les marchés d'instruments financiers (« MiFID »), ou qui sont soumis à des directives similaires, paieront sur leurs propres ressources pour toute recherche effectuée par des tiers qu'ils ont commanditée en relation avec la gestion des actifs de chaque Fonds.

## 7. RESPONSABILITÉ SÉPARÉE

La Société est une société d'investissement à capital variable à compartiments multiples et responsabilité séparée entre les compartiments. En conséquence, tout passif au nom d'un Fonds de la Société ou qui lui est attribuable doit être acquitté uniquement sur les actifs de ce Fonds, et ni la Société ni ses Administrateurs, ses administrateurs judiciaires, auditeurs, liquidateurs, liquidateurs provisoires ni toute autre personne ne doivent appliquer, ou être obligés d'appliquer, les actifs dudit Fonds afin de s'acquitter d'un passif encouru au nom d'un autre Fonds de la Société ou qui lui est attribuable, indépendamment de la date à laquelle ledit passif a été encouru.

## 8. MODIFICATIONS DU PROSPECTUS, DU SUPPLÉMENT, DE L'ACTE CONSTITUTIF ET DES STATUTS

Le 24 mars 2026, le Supplément du Fonds UK Corporate Bond Fund a été mis à jour pour prendre en compte le changement d'indice de référence, l'indice ICE BofA Sterling non-Gilt Index ayant été remplacé par l'indice ICE BofA Sterling Corporate Index.

Le 14 avril 2026, le Supplément du Fonds Strategic Income Fund a été mis à jour afin de modifier la fréquence de distribution des Catégories d'actions de distribution et de distribution II, passant d'une distribution trimestrielle à une distribution mensuelle.

Le 15 avril 2026, le Prospectus de la Société a été actualisé pour satisfaire aux exigences relatives au recours aux outils de gestion de la liquidité introduites par la Directive (UE) 2024/927 (la « Directive de portée générale »). Les Suppléments de Fonds du Diversified Income Duration Hedged Fund, de l'Emerging Local Bond ESG Fund et de l'Emerging Markets Bond ESG Fund ont aussi été mis à jour afin d'adapter les noms des indices à la nouvelle identité des indices JPM ESG.

Le 21 avril 2026, le Supplément du Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund a été mis à jour afin de modifier la fréquence de distribution des Catégories d'actions de distribution et de distribution II, passant d'une distribution trimestrielle à une distribution mensuelle, et de réduire à 10 % le pourcentage maximum autorisé de détention dans des organismes de placement collectif.

Le 18 décembre 2025, le Fonds MAARS Multi-Strategy Fund a été approuvé par la Banque centrale et le Supplément de ce Fonds a été inclus dans le Prospectus.

Le 11 mai 2026, le supplément relatif au fonds StocksPLUS a été mis à jour afin de modifier les noms des catégories d'actions des ETF UCITS, de créer des catégories d'actions d'ETF UCITS libellées en GBP, CHF et MXN, et de préciser que les avoirs du portefeuille du fonds à la fin de chaque trimestre civil seront rendus publics dans les 30 jours ouvrables suivant la fin du trimestre concerné.

À la même date, le Supplément du Fonds UK Corporate Bond Fund a été mis à jour afin d'introduire une renonciation aux Frais de gestion de 30 pb pour la Catégorie d'Actions H Institutions jusqu'au 13 mai 2027 et de réduire le seuil de souscription initiale minimum pour la Catégorie d'Actions H Institutions à 75 000 000 GBP.

Le 30 juin 2026, le Supplément du Fonds Euro Credit Fund a été mis à jour afin de prolonger d'un an l'abandon de Frais de gestion de 25 points de base de la Catégorie H Institutions, jusqu'au 30 juin 2027.

L'Acte constitutif et les Statuts de la Société n'ont pas été modifiés au cours de la période.

## 9. COMMISSIONS ET FRAIS

### (a) Commissions payables au Gestionnaire

À l'exception des Actions BM Détail et BE Détail tel qu'indiqué dans le Supplément du Fonds concerné, la Commission unifiée ne dépassera pas 2,50 % par an de la VNI de chaque Fonds. La Commission unifiée correspond aux Frais de gestion, plus tous Frais de service, Frais de commercialisation et Frais de distribution applicables, tels que détaillés dans le Supplément du Fonds pour la Catégorie d'action concernée.

### (b) Frais de gestion

Le Gestionnaire, pour chaque Fonds et comme décrit dans le Prospectus, fournit des services de conseil en investissement, d'administration, de dépositaire et autres, en contrepartie desquels chaque Fonds lui verse des Frais de gestion uniques. Les Frais de gestion de chaque Fonds (telle que définie dans le Prospectus) sont cumulés lors de chaque Jour de négociation (tel que défini dans le Supplément du Fonds pertinent) et payables mensuellement à terme échu. Le Gestionnaire peut verser les Frais de gestion en totalité ou en partie aux Conseillers en investissement afin de rémunérer les services de conseil en investissement et autres fournis par les Conseillers en

investissement et afin que ces derniers rémunèrent les services d'administration, de dépositaire et autres des Fonds fournis par le Gestionnaire.

Les Frais de gestion de chaque Catégorie de chaque Fonds (exprimés en pourcentage annuel de sa VNI) sont les suivants :

|                                                                          | Catégories<br>Institutions,<br>Investisseurs<br>Administrations<br>(%) | Catégorie H<br>Institutions<br>(%) | BE Détail<br>BM Détail<br>Catégories E,<br>G Détail,<br>M Détail,<br>N Détail,<br>T (%) | Classe R, UA<br>Pourcentage<br>de la classe<br>(%) | Catégories<br>UM Détail,<br>W (%) |
|--------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield<br>Bond Fund                                 | 0,65                                                                   | 0,82                               | 1,55                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond<br>Fund                               | 0,65                                                                   | O/S                                | 1,50                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds PIMCO Balanced Income<br>and Growth Fund <sup>(1)</sup>            | 0,95                                                                   | 1,12                               | 2,15                                                                                    | 1,45                                               | 1,60                              |
| Fonds PIMCO Capital Securities<br>Fund                                   | 0,79                                                                   | O/S                                | 0,79                                                                                    | 0,93                                               | O/S                               |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                                            | 0,52                                                                   | O/S                                | 1,42                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Commodity Real Return<br>Fund                                      | 0,74                                                                   | 0,91                               | 1,64                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds PIMCO Credit<br>Opportunities Bond Fund                            | 0,65                                                                   | 0,82                               | 1,55                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Diversified Income Fund                                            | 0,69                                                                   | 0,86                               | 1,59                                                                                    | O/S                                                | 0,55                              |
| Fonds Diversified Income Duration<br>Hedged Fund                         | 0,69                                                                   | O/S                                | 1,59                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Diversified Income<br>ESG Fund                                     | 0,72                                                                   | O/S                                | 1,62                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                                  | 0,90                                                                   | 1,07                               | 1,80                                                                                    | 0,99                                               | O/S                               |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                                           | 0,89                                                                   | 1,06                               | 1,89                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Emerging Local Bond<br>ESG Fund                                    | 0,92                                                                   | O/S                                | 1,92                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Emerging Markets<br>Bond Fund                                      | 0,79                                                                   | 0,96                               | 1,69                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Emerging Markets Bond<br>ESG Fund <sup>(2)</sup>                   | 0,82                                                                   | O/S                                | 1,72                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Emerging Markets<br>Corporate Bond Fund                            | 0,86                                                                   | O/S                                | 1,76                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds PIMCO Emerging Markets<br>Opportunities Fund                       | 0,79                                                                   | O/S                                | 1,69                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Emerging Markets Short-<br>Term Local Currency Fund                | 0,85                                                                   | O/S                                | 1,75                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                                              | 0,59                                                                   | O/S                                | 1,49                                                                                    | 0,82                                               | O/S                               |
| Fonds Euro Bond Fund                                                     | 0,46                                                                   | O/S                                | 1,36                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Euro Credit Fund <sup>(3)</sup>                                    | 0,46                                                                   | 0,38                               | 1,36                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Euro Income Bond Fund                                              | 0,49                                                                   | O/S                                | 1,39                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Euro Long Average<br>Duration Fund                                 | 0,46                                                                   | O/S                                | 1,36                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Euro Short-Term Fund                                               | 0,29                                                                   | O/S                                | 1,04                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds PIMCO European High<br>Yield Bond Fund                             | 0,55                                                                   | O/S                                | 1,45                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds PIMCO European Short-<br>Term<br>Opportunities Fund <sup>(4)</sup> | 0,32                                                                   | 0,49                               | 0,97                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Global Advantage Fund                                              | 0,70                                                                   | O/S                                | 1,70                                                                                    | O/S                                                | O/S                               |
| Fonds Global Bond Fund                                                   | 0,49                                                                   | 0,66                               | 1,39                                                                                    | 0,76                                               | 0,39                              |

|                                                        | Catégories<br>Institutions,<br>Investisseurs<br>Administrations | Catégorie<br>H<br>(%) | BE Détail<br>BM Détail<br>Catégories E,<br>G Détail,<br>M Détail,<br>N Détail,<br>T (%) | Catégorie R<br>(%) | Catégories<br>UM Détail,<br>W (%) |
|--------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|-----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------|
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 0,52                                                            | O/S                   | 1,42                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | 0,49                                                            | 0,66                  | 1,39                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Global Bond Opportunities Fund                   | 0,55                                                            | O/S                   | 1,45                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 0,55                                                            | 0,72                  | 1,45                                                                                    | 0,80               | O/S                               |
| Fonds Global High Yield Bond ESG Fund                  | 0,58                                                            | O/S                   | 1,48                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 0,49                                                            | 0,66                  | 1,39                                                                                    | 0,76               | 0,39                              |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 0,52                                                            | O/S                   | 1,42                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 0,49                                                            | O/S                   | 1,39                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 0,49                                                            | 0,66                  | 1,39                                                                                    | 0,76               | O/S                               |
| Fonds Income Fund                                      | 0,55                                                            | 0,72                  | 1,45                                                                                    | 0,80               | O/S                               |
| Fonds Income Fund II                                   | 0,55                                                            | O/S                   | 1,45                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 0,46                                                            | 0,63                  | 1,36                                                                                    | 0,75               | O/S                               |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,49                                                            | O/S                   | 1,39                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 0,55                                                            | 0,72                  | 1,45                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | 0,49                                                            | O/S                   | 1,20                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund              | 0,52                                                            | O/S                   | O/S                                                                                     | O/S                | O/S                               |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                        | 1,75                                                            | O/S                   | O/S                                                                                     | O/S                | O/S                               |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 0,99                                                            | O/S                   | 1,89                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | 0,69                                                            | 0,86                  | 1,59                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund                     | 0,79                                                            | O/S                   | 1,69                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | 0,55                                                            | 0,72                  | 1,45                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 0,69                                                            | O/S                   | O/S                                                                                     | O/S                | O/S                               |
| Fonds Strategic Income Fund                            | 0,79                                                            | O/S                   | 1,69                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | 0,50                                                            | 0,67                  | 1,40                                                                                    | 0,77               | O/S                               |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 1,40                                                            | 1,57                  | 2,50                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds UK Corporate Bond Fund <sup>(5)</sup>            | 0,46                                                            | 0,29                  | O/S                                                                                     | O/S                | O/S                               |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 0,46                                                            | O/S                   | O/S                                                                                     | O/S                | O/S                               |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | 0,55                                                            | 0,72                  | 1,45                                                                                    | 0,80               | O/S                               |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 0,49                                                            | 0,66                  | 1,39                                                                                    | O/S                | O/S                               |
| Fonds US Short-Term Fund <sup>(6)</sup>                | 0,45                                                            | 0,62                  | 0,85                                                                                    | O/S                | O/S                               |

(1) Le taux des Catégories BM Détail et M Détail ne prend pas en compte une renonciation aux frais par le Gestionnaire à hauteur de 0,55 % par an. La renonciation aux frais prendra fin le 29 novembre 2028.

(2) Le taux de la Catégorie Institutions H prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à hauteur de 0,30 % par an. L'abandon de commission prendra fin le 1<sup>er</sup> juillet 2021.

(3) Le taux de la Catégorie Institutions H prend en compte une renonciation aux frais par le Gestionnaire à hauteur de 0,25 % par an. La renonciation aux frais prendra fin le 1<sup>er</sup> juillet 2025.

(4) Le taux de la Catégorie Institutions H prend en compte une renonciation aux frais par le Gestionnaire à hauteur de 0,10 % par an. La renonciation aux frais prendra fin le 13 novembre 2028.

(5) Le taux de la Catégorie Institutions H prend en compte une renonciation aux frais par le Gestionnaire à hauteur de 0,34 % par an. La renonciation aux frais prendra fin le 31 août 2026.

(6) Le taux de la Catégorie E prend en compte une renonciation aux frais par le Gestionnaire à hauteur de 0,30 % par an. Les renoncations aux frais resteront en vigueur jusqu'à ce que le Gestionnaire, sur préavis écrit aux actionnaires du Fonds, décide de mettre fin ou de cesser d'appliquer cette renonciation aux frais ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

Les Frais de gestion de tous les Fonds (hormis les Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund et Emerging Markets Bond ESG Fund) sont restés inchangés au cours de l'exercice clos le 30 juin 2026, à l'exception des modifications apportées aux renoncations de frais susmentionnées.

Les Frais de gestion imputables aux Catégories H Institutions, BE Détail, BM Détail, E, G Détail, M Détail, N Détail, T et UM Détail sont généralement supérieurs à ceux imputables aux autres Catégories d'actions. À partir de cette commission majorée, le Gestionnaire peut payer les dépenses occasionnées par la distribution, les intermédiaires et autres services rendus aux actionnaires pour ces Catégories d'actions des Fonds, directement ou indirectement, par des distributeurs, courtiers-négociants, banques, intermédiaires financiers ou autres. Compte tenu du caractère fixe des Frais de gestion, le Gestionnaire, et non les Actionnaires, assume le risque de hausse du coût des services couverts par les Frais de gestion et assume le risque que les charges

de ces services dépassent les Frais de gestion en conséquence d'une diminution des actifs nets. À l'inverse, le Gestionnaire, et non les actionnaires, profitera de la baisse du prix des services couverts par lesdits Frais de gestion. Il profitera également de la baisse des niveaux de frais afférents à ces services, en pourcentages des actifs nets, du fait de la hausse des actifs nets.

(1) Les Catégories Z sont principalement offertes aux autres Fonds de la Société ou à fin d'investissement direct par des investisseurs institutionnels qui ont conclu un accord de gestion ou tout autre accord avec le conseiller en investissement ou tout autre affilié de PIMCO autorisant les investissements dans les Catégories Z. Du fait de la nature de la Catégorie Z et dans le but d'éviter le doublement des frais, la Commission de gestion des Catégories Z est fixée à 0,00 % par an.

La Commission de gestion afférente à chaque Catégorie d'Actions de chaque Fonds (exprimée en pourcentage annuel de la Valeur nette d'inventaire) est présentée dans le Supplément afférent à chaque Fonds. L'attention des Actionnaires est également attirée sur le fait que la Commission de gestion peut être prélevée sur le capital au niveau d'un Fonds ou d'une Catégorie d'Actions, pour autant que le Supplément relatif au Fonds concerné le prévoit expressément.

### (c) Services de conseil en investissement

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la prestation de services de conseil en investissement pour le compte de la Société. Ces services couvrent l'investissement et le réinvestissement des actifs de chacun des Fonds. Les commissions des Conseillers en investissement (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payées par le Gestionnaire sur les Frais de gestion.

### (d) Services d'administration, de dépositaire et autres services

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture de services d'administration, de dépositaire et autres pour le compte de la Société. Lesdits services incluent des services d'administration, d'agent de transfert, de comptabilité des fonds, de dépositaire et de sous-dépositaire de chaque Fonds. Les commissions et frais de l'Agent administratif et du Dépositaire (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payés par le Gestionnaire sur les Frais de gestion ou par les Conseillers en investissement.

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture d'autres services pour le compte de la Société. Parmi ces services figurent les services de cotation par un courtier, d'agent payeur et d'autres services de représentant local, de comptabilité, d'audit, des services juridiques et d'autres services de conseil professionnel, des services de secrétariat de la Société, d'impression, de publication et de traduction, et la fourniture et la coordination de certains services de supervision, d'administration et services aux actionnaires nécessaires au fonctionnement des Fonds. Les commissions et frais ordinaires afférents à ces services (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payés par le Gestionnaire, ou les Conseillers en investissement pour le compte du Gestionnaire, sur les Frais de gestion.

Les Fonds supporteront d'autres frais liés à leur fonctionnement qui ne sont pas couverts par les Frais de gestion et qui peuvent varier et influer sur le niveau total de frais des Fonds dont, sans y être limité, les impôts et taxes gouvernementales, les frais de courtage, les commissions et autres frais de transaction (y compris, mais sans s'y limiter, les frais et dépenses liés à la vérification préalable des investissements et des investissements potentiels et/ou aux négociations de ces transactions), les coûts d'emprunt d'argent, dont les frais d'intérêts, les frais d'établissement, les dépenses exceptionnelles (comme les frais de litiges et les indemnités) et les jetons de présence et frais des Administrateurs indépendants de la Société et de leur conseiller.

La Société a acquitté des honoraires aux Administrateurs indépendants à hauteur de 90 000 € pour la période comptable close le 30 juin 2026 (30 juin 2025 : 90 000 €). De plus, chaque Administrateur indépendant est remboursé de ses débours raisonnables. Les Administrateurs non indépendants ne sont pas habilités à séparer les rémunérations pour leur mandat d'administrateur de la Société. Les honoraires des Administrateurs sont comptabilisés en « Autres charges » dans le Compte de résultat.

**Frais de service** Les Frais de service, qui s'appliquent aux Catégories Investisseurs, sont payés uniquement au Gestionnaire et peuvent servir à rembourser les courtiers-négociants, les intermédiaires financiers ou autres intermédiaires fournissant des services afférents à la distribution et à la commercialisation d'Actions et/ou à la prestation de certains services aux actionnaires ou à l'administration de plans ou de programmes pour lesquels les Actions des Fonds sont des sources de financement, et à rembourser d'autres frais liés (tels que définis dans le Supplément du Fonds concerné). Ces services sont fournis directement par le Gestionnaire ou indirectement par des sociétés de courtage, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les Actionnaires des Catégories Investisseurs. Les mêmes services s'appliquent à tous les actionnaires des Catégories Investisseurs qui supportent les frais. Ces services peuvent inclure : répondre aux questions des actionnaires concernant les Fonds et leur performance, aider les actionnaires pour l'achat, le rachat et l'échange d'Actions ; maintenir des informations sur les comptes personnels et fournir des relevés de comptes aux actionnaires ; et conserver d'autres archives importantes pour l'investissement d'un actionnaire dans les Fonds.



Les plans ou programmes qui utilisent des Actions de Fonds comme source de financement peuvent inclure des produits d'assurance à capital variable et des régimes de pension, de retraite ou d'épargne gérés par les employeurs. Tous les actionnaires des Catégories Investisseurs bénéficient de ces services en vertu de contrats conclus avec les intermédiaires financiers qui entretiennent avec ces actionnaires des relations de prestataires de services. Les Frais de service sont calculés sur la base de 0,35 % par an de la VNI de chaque Fonds imputable aux Catégories Investisseurs. Le taux des Frais de service n'a pas changé au cours des périodes closes le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025. Ils sont payés sur la VNI imputable aux Catégories Investisseurs de la VNI de ces Fonds. Les Frais de service pour chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Gestionnaire peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de service qui ne sont pas dus aux courtiers-négociants, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

**Frais de commercialisation** Les Frais de commercialisation, qui s'appliquent aux Catégories Administrations, sont payés au Distributeur au titre des services personnels qu'il rend aux actionnaires des Fonds et de la tenue des comptes des actionnaires. Cela comprend les rémunérations et les frais afférents (frais téléphoniques et frais généraux compris) dus aux consultants financiers ou autres salariés de courtiers partenaires ou remisiers, à certaines banques et à d'autres intermédiaires financiers qui participent au traitement des demandes d'achat ou de rachat ou au traitement des versements de dividendes, qui fournissent des informations régulières aux actionnaires montrant leurs positions dans les Actions d'un Fonds, qui communiquent les informations de la Société aux actionnaires, qui donnent des conseils réguliers sur la pertinence d'investissements spécifiques proposés par les Fonds en fonction des besoins des actionnaires, qui répondent aux demandes de renseignement des actionnaires sur ces services ou qui forment du personnel pour la prestation de ces services.

Ces services sont fournis directement par le Distributeur ou indirectement par des courtiers-négociants, des banques, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires des Catégories Administrations. Les Frais de commercialisation sont calculés sur une base de 0,50 % par an de la VNI de chaque Fonds, à l'exception du Fonds StocksPLUS™ Fund pour lequel ils sont calculés sur une base de 0,75 % par an, attribuable aux Catégories Administrations. Les Frais de commercialisation de chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont payables chaque mois à terme échu. Le Distributeur peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de commercialisation qui ne sont pas à verser aux courtiers-négociants, aux banques, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

Le taux des Frais de commercialisation n'a pas changé au cours des périodes closes le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025.

#### (e) Frais de distribution

Les Frais de distribution qui s'appliquent aux Actions de Catégories T, BM Détail, BM Détail et BE Détail sont versés au Distributeur au titre de services rendus aux actionnaires des Fonds.

Ces services sont fournis directement par le Distributeur ou indirectement par des courtiers-négociants, des banques, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires de la Catégorie T. Les Frais de distribution sont calculés sur la base de 0,40 % par an de la VNI de chaque Fonds attribuable à la Catégorie d'Actions T, à l'exception des Fonds Global Bond Fund et Total Return Bond Fund, qui supportent des Frais de distribution de 0,30 % par an de la VNI de ces Fonds attribuables à la Catégorie d'Actions T.

Concernant les Catégories d'Actions BE Détail, BM Détail et BM Détail uniquement, lorsque c'est indiqué dans le Supplément concerné, les Frais de distribution peuvent atteindre 1 % de la VNI et par conséquent la Commission unifiée peut dépasser 2,50 % de la VNI.

Les Frais de distribution pour chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Distributeur peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de distribution qui ne sont pas à verser aux courtiers-négociants, aux banques, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

Le taux des Frais de distribution n'a pas changé au cours des périodes closes le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025.

#### (f) Limitation des dépenses (incluant la Renonciation aux Frais de gestion et leur Récupération)

Le Gestionnaire a convenu avec la Société, conformément au Contrat de gestion conclu entre la Société et le Gestionnaire le 28 janvier 1998, tel que modifié, de gérer le total annuel des charges d'exploitation de toute Catégorie d'un Fonds, en renonçant à, réduisant ou remboursant tout ou partie de ses Frais de gestion, dans la mesure où (et pour une durée où) ces charges d'exploitation seraient supérieures, en raison du paiement de frais de constitution et de la part proportionnelle des jetons de présence des Administrateurs, à la somme des Frais de gestion de cette Catégorie de ce Fonds (avant application de la renonciation aux Frais de gestion applicable), des Frais de service ou de commercialisation, le cas échéant, et autres frais supportés par cette Catégorie d'actions du Fonds non couverts par les Frais de gestion tel que décrit ci-dessus (autres que les frais de constitution et la part proportionnelle des jetons de présence des Administrateurs) plus 0,0049 % par an (calculés quotidiennement sur la VNI du Fonds).

Au cours d'un mois où le Contrat de gestion est en vigueur, le Gestionnaire peut récupérer sur un Fonds toute partie des Frais de gestion abandonnés, réduits ou remboursés conformément au Contrat de gestion (le « Montant de remboursement ») au cours des 36 mois précédents, sous réserve que ce montant payé au Gestionnaire 1) n'excédra pas 0,0049 % par an des actifs nets moyens de la Catégorie du Fonds (calculés quotidiennement) ; 2) n'excédra pas le Montant de remboursement total ; 3) ne comportera aucun montant déjà remboursé au Gestionnaire ; ou 4) n'aura pas pour effet de maintenir une Catégorie d'un Fonds à un rendement négatif net.

Les Frais de gestion qui figurent dans le Compte de résultat sont enregistrés bruts de l'abandon des Frais de gestion concernés le cas échéant. Les renonciations aux Frais de gestion sont enregistrées à la rubrique Remboursement effectué par les Conseillers en investissement du Compte de résultat. Les Frais de gestion sont versés au Gestionnaire nets de la renonciation.

#### 10. TRANSACTIONS AVEC DES PARTIES LIÉES

Le Gestionnaire, les Conseillers en investissement, les Distributeurs et les Administrateurs sont des parties liées de la Société. Les honoraires dus à ces parties sont détaillés dans la Note 9, le cas échéant.

Au 30 juin 2026, le Gestionnaire détenait 1 351 813 (31 décembre 2025 : 1 322 896) actions du Fonds US Short-Term Fund.

Chacun des Fonds peut investir dans les autres Fonds de la Société et/ou d'autres organismes de placement collectif gérés par le Gestionnaire ou des entités affiliées au Gestionnaire (les « Fonds affiliés »). Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés pendant l'exercice clos le 30 juin 2026. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total des Fonds de la Société.

| Fonds                                         | 30 juin 2026                                    |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------------------|
|                                               | Investissements croisés                         |
| Fonds Diversified Income Fund                 | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Diversified Income ESG Fund             | Fonds PIMCO ESG Income Fund                     |
| Fonds Dynamic Bond Fund                       | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |
| Fonds Dynamic Bond Fund                       | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Dynamic Bond Fund                       | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund              |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Euro Income Bond Fund                   | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Advantage Fund                   | Fonds Global Bond Opportunities Fund            |
| Fonds Global Bond Fund                        | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Global Bond Fund                        | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Bond Fund                        | Fonds Global Bond Ex-US Fund                    |
| Fonds Global Bond Fund                        | Fonds Global Bond Opportunities Fund            |
| Fonds Global Bond Fund                        | Fonds UK Corporate Bond Fund                    |
| Fonds Global Bond Fund                        | Fonds US Short-Term Fund                        |

|                                                        | 30 juin 2026                                    |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| Fonds                                                  | Investissements croisés                         |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | Fonds Global Bond Opportunities Fund            |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund           |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund           |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | Fonds PIMCO Climate Bond Fund                   |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund           |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés au 31 décembre 2025. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total de la Société dans le Bilan comparatif des Fonds.

|                                                        | 31 décembre 2025                                |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| Fonds                                                  | Investissement croisé                           |
| Fonds Diversified Income Fund                          | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | Fonds PIMCO ESG Income Fund                     |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund              |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds Global Bond Ex-US Fund                    |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds UK Corporate Bond Fund                    |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund           |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund           |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | Fonds PIMCO Climate Bond Fund                   |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |

|                                               | 31 décembre 2025                                |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| Fonds                                         | Investissement croisé                           |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund         | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Total Return Bond Fund                  | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Total Return Bond Fund                  | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds US High Yield Bond Fund                 | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds US High Yield Bond Fund                 | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund           |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés pendant l'exercice clos le 30 juin 2025. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total de la Société dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution de l'actif net des Fonds.

|                                                        | 30 juin 2025                                    |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| Fonds                                                  | Investissement croisé                           |
| Fonds Diversified Income Fund                          | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | Fonds PIMCO ESG Income Fund                     |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund              |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds Global Bond Ex-US Fund                    |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds UK Corporate Bond Fund                    |
| Fonds Global Bond Fund                                 | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | Fonds PIMCO Climate Bond Fund                   |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | Fonds US Short-Term Fund                        |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund       |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      |

Certains Fonds investissent dans la Catégorie Z du Fonds PIMCO China Bond Fund, un Fonds de PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. et du Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, un Fonds de PIMCO Select Funds plc, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Du fait de la nature de la Catégorie Z et dans le but d'éviter le doublement des frais, les Frais de gestion de la Catégorie Z des deux fonds sont fixés à 0,00 % par an.

Certains Fonds investissent dans les Fonds PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF et PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, des Fonds de PIMCO ETFs plc, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Comme ces Fonds ne comportent pas de Catégorie d'actions sans frais, les Frais de gestion sont supportés par le Fonds investissant et par le Fonds affilié sous-jacent. En conséquence, un Abandon de frais de conseil en investissement est déduit avant paiement par le Fonds investissant au Gestionnaire et comptabilisé à la rubrique Remboursement effectué par les Conseillers en investissement du Compte de résultat.

## Notes relatives aux États financiers (suite)

Au cours des exercices clos le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025, les Fonds ci-dessous ont exercé des activités d'achat et de vente de titres dans des Fonds affiliés, d'achats et de ventes liés à des investissements croisés et d'achats et de ventes d'investissements dans des Fonds affiliés (montants en milliers) :

| Fonds                                                  | 30 juin 2026 |            |
|--------------------------------------------------------|--------------|------------|
|                                                        | Achats       | Ventes     |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 468 361   | \$ 490 060 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund                | 61 112       | 73 500     |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 5 556 701    | 4 748 328  |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                    | 8 482        | 0          |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                          | 18 168       | 4 101      |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 3 850        | 2 765      |
| Fonds Diversified Income Fund                          | 1 469 236    | 1 649 081  |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | 93 336       | 104 416    |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | 322          | 561        |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | 498 853      | 494 000    |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | 2 186 986    | 2 502 216  |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                     | 549          | 8          |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | 1 696 713    | 2 121 380  |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 0            | 902        |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 74 406       | 79 099     |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 613 861      | 468 812    |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 805          | 702        |
| Fonds Euro Bond Fund                                   | 281 474      | 295 195    |
| Fonds Euro Credit Fund                                 | 39 378       | 38 256     |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | 52 946       | 26 181     |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund                  | 81 448       | 73 769     |
| Fonds Euro Short-Term Fund                             | 82 173       | 71 963     |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund              | 83 776       | 64 154     |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 261 977      | 355 159    |
| Fonds Global Advantage Fund                            | 108 276      | 104 900    |
| Fonds Global Bond Fund                                 | 9 377 765    | 9 422 901  |
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 22 163       | 5 735      |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | 207 422      | 238 300    |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 12 829       | 43 010     |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 862 159      | 977 759    |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 1 192        | 47 983     |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 432 702      | 433 500    |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 444 403      | 433 231    |
| Fonds Income Fund                                      | 7 838 943    | 6 920 346  |
| Fonds Income Fund II                                   | 254 656      | 302 100    |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 9 941        | 9 400      |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 24 018       | 11 778     |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 555 957      | 215 034    |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | 60 570       | 42 900     |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                        | 7 197        | 3 500      |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 10 647       | 4 100      |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund                     | 72 021       | 72 200     |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | 3 503 474    | 4 248 730  |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 212          | 100        |
| Fonds Strategic Income Fund                            | 200 541      | 167 722    |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | 649 897      | 829 068    |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 30 817       | 30 500     |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 128          | 1 313      |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | 817          | 10 886     |
| Fonds US Short-Term Fund                               | 520 508      | 715 762    |

| Fonds                                       | 30 juin 2025 |            |
|---------------------------------------------|--------------|------------|
|                                             | Achats       | Ventes     |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund       | \$ 327 806   | \$ 409 212 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund     | 28 683       | 28 107     |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 752 066      | 692 030    |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund         | 3 800        | 903        |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund               | 0            | 6 858      |

| Fonds                                                  | 30 juin 2025 |            |
|--------------------------------------------------------|--------------|------------|
|                                                        | Achats       | Ventes     |
| Fonds Commodity Real Return Fund                       | 1            | 0          |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 1 087        | 14 809     |
| Fonds Diversified Income Fund                          | 1 069 982    | 882 587    |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | 45 478       | 65 220     |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | 522          | 2 616      |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | \$ 502 045   | \$ 440 905 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | 1 186 569    | 1 102 939  |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                     | 364          | 1 986      |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | 1 939 982    | 1 647 163  |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 14 358       | 30 469     |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 68 445       | 64 400     |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 153 193      | 141 894    |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 1 202        | 1 517      |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                            | 0            | 173        |
| Fonds Euro Bond Fund                                   | 211 505      | 299 757    |
| Fonds Euro Credit Fund                                 | 3 170        | 3 128      |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | 34 268       | 135 417    |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund              | 14 372       | 2 968      |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 85 773       | 72 379     |
| Fonds Global Advantage Fund                            | 128 323      | 131 099    |
| Fonds Global Bond Fund                                 | 4 717 134    | 4 558 552  |
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 43 581       | 5 608      |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | 496 423      | 583 850    |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 648 703      | 688 279    |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 1 560 769    | 1 511 819  |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 49 208       | 32 421     |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 311 067      | 327 200    |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 703 561      | 675 500    |
| Fonds Income Fund                                      | 6 968 397    | 6 669 053  |
| Fonds Income Fund II                                   | 104 076      | 83 800     |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 49 303       | 39 425     |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 108 275      | 96 419     |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 680 572      | 653 745    |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | 37 031       | 44 087     |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 11 314       | 9 800      |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund                     | 48 617       | 48 500     |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | 1 350 143    | 1 298 000  |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 210          | 200        |
| Fonds Strategic Income Fund                            | 928 967      | 858 434    |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | 1 839 958    | 1 886 480  |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 21 029       | 31 241     |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                           | 12 485       | 38 228     |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 1 421        | 32 475     |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | 209 796      | 214 561    |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 16 747       | 6 275      |
| Fonds US Short-Term Fund                               | 595 639      | 506 656    |

Le tableau ci-après présente la valeur des actions en circulation détenues par le groupe Allianz, les Fonds de la Société, les Fonds affiliés et les employés des Conseillers en investissement, parties liées de la Société, au-delà de 20 % de l'actif net du Fonds, au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025.

| Fonds                                                 | 30 juin 2026<br>% détenu | 31 décembre 2025<br>% détenu |
|-------------------------------------------------------|--------------------------|------------------------------|
|                                                       |                          |                              |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund               | 32,22                    | 33,72                        |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund            | 37,81                    | 36,55                        |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                     | 99,89                    | 99,90                        |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                    | 35,60                    | 27,40                        |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund       | 44,06                    | 53,53                        |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 47,68                    | 38,05                        |
| Fonds Euro Income Bond Fund                           | 34,65                    | 33,51                        |
| Fonds Euro Short-Term Fund                            | 50,88                    | 47,01                        |



| Fonds                                              | 30 juin 2026<br>% détenu | 31 décembre 2025<br>% détenu |
|----------------------------------------------------|--------------------------|------------------------------|
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund          | 55,27                    | 54,59                        |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 90,41                    | 87,73                        |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                       | O/S                      | 20,08                        |
| Fonds Global Bond Opportunities Fund               | 100,00                   | O/S                          |
| Fonds Global High Yield Bond ESG Fund              | 100,00                   | 99,94                        |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund              | 33,62                    | 41,24                        |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund          | 100,00                   | 100,00                       |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                    | 57,92                    | O/S                          |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund       | 53,12                    | 52,12                        |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                  | 22,61                    | 25,92                        |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                    | 55,75                    | 55,23                        |
| Fonds Strategic Income Fund                        | 39,49                    | 44,23                        |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund   | 27,85                    | 41,28                        |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                       | 22,74                    | 22,89                        |
| Fonds US Short-Term Fund                           | 25,50                    | 31,05                        |

Certaines Catégories d'Actions des Fonds peuvent être soumises à des commissions d'acquisition différée conditionnelles (« CADC »), comme indiqué dans le Supplément du Fonds concerné. Les montants des CADC applicables sont inclus dans les montants des Paiements au titre des actions rachetées comptabilisés dans l'État de l'évolution des actifs nets du Fonds concerné. Au 30 juin 2026, les montants versés au gestionnaire au titre des CADC s'élevaient à 21 428 901 dollars américains (30 juin 2025 : 4 616 971 DOLLARS É.-U.).

Au cours de la période close le 30 juin 2026, le Fonds Income Fund a vendu des titres pour une valeur de 29 690 USD (30 juin 2025 : 119 273 USD) à Repack Bond Collateral Ltd. (l'« Entité »), une société exonérée constituée sous la forme d'une société à responsabilité limitée en vertu des lois des Îles Caïmans, qui est une partie liée au Conseiller en investissement. Aucune commission ne sera versée aux Conseillers en investissement par l'Entité. Au 30 juin 2026, le Fonds Income Fund détenait 9 694 Billets (31 décembre 2025 : 9 694 Billets) de BNP Paribas Issuance BV., qui est garanti par des billets émis par l'Entité. Au cours de la période, l'Entité a versé au Fonds Income Fund des distributions totales pour un montant de 36 159 USD (30 juin 2025 : 36 159 DOLLARS É.-U.).

Au cours des exercices clos le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025, le Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund a investi dans deux billets structurés, Aries Capital DAC et Greenleaves Capital DAC, dont le produit a été utilisé pour émettre des actions de participation rachetables de PIMCO Commodities Diversified SP, un portefeuille séparé de PIMCO Diversified Strategies SPC. Au cours des exercices clos le 31 décembre 2024 et le 30 juin 2026, le Fonds PIMCO MAARS Managed Futures Strategy Fund a investi dans deux billets structurés, Aries Capital DAC et Greenleaves Capital DAC, dont le produit a été utilisé pour émettre des actions de participation rachetables de PIMCO Commodities Diversified SP, un portefeuille séparé de PIMCO Diversified Strategies SPC. PIMCO Diversified Strategies SPC, une société exonérée constituée sous la forme d'une société à responsabilité limitée en vertu des lois des Îles Caïmans, est une partie liée aux Conseillers en investissement. Aucune commission ne sera versée aux Conseillers en investissement par PIMCO Diversified Strategies SPC. Au 30 juin 2026, la valeur des billets structurés détenus par le Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund était de 26 771 USD (31 décembre 2025 : Le montant s'élevait à 13 976 dollars américains, tandis que la valeur des titres structurés détenus par le fonds multi-stratégies MAARS était de 1 704 dollars américains.

Au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025, le Fonds PIMCO Obbligazionario Prudente Fund, un Fonds de PIMCO Select Funds plc et considéré comme un Fonds affilié, détenait un Titre de créance AT1 de Credit Suisse AG (le « Titre de créance AT1 »). Ce Titre de créance AT1 concerne une participation dans une position en obligations d'entreprises dans le secteur bancaire et financier.

Dans le cadre d'un rachat en nature depuis le Fonds PIMCO Obbligazionario Prudente Fund et d'une souscription en nature correspondante dans le Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, qui a eu lieu le 15 mai 2024, il a été déterminé que le Titre de créance AT1 ne peut pas être transféré au Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund.

Au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025, le montant à recevoir du Fonds PIMCO Obbligazionario Prudente Fund, attribuable à la fraction calculée au prorata du Titre de créance AT1, est comptabilisé sous le poste « À recevoir du Fonds affilié » dans le Bilan du Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund. Le Fonds PIMCO Obbligazionario Prudente Fund versera au Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund un montant égal à 99,26 % de tout rendement net (le cas échéant) qu'il pourrait percevoir à l'avenir en lien avec le Titre de créance AT1.

Le Fonds Dynamic Multi-Asset Fund a fusionné avec le Fonds Strategic Income Fund au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2024. Au 30 juin 2026, un Titre de créance AT1 résiduel reste détenu au titre du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, tout produit net futur étant payable contractuellement au Fonds Strategic Income Fund. De plus amples informations et les valeurs comptables correspondantes au 31 décembre 2025 et au 30 juin 2026 sont divulguées dans la Note 2 relative aux états financiers.

#### Intérêts des Administrateurs et du Secrétaire en actions, obligations non garanties et contrats

Au 30 juin 2026, V. Mangala Ananthanarayanan détenait 2 669,15 (31 décembre 2025 : 5 319,15) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 3 619,69 (31 décembre 2025 : 3 619,69) actions du Fonds Global Bond Fund et 27 543,65 (31 décembre 2025 : 27 543,65) actions du Fonds Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 30 juin 2026, Ryan P. Blute détenait 28 827,68 (31 décembre 2025 : 28 827,68) actions du Fonds Low Average Duration Fund et 50 751,14 (31 décembre 2025 : 50 751,14) actions du Fonds Low Duration Income Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 30 juin 2026, Craig A. Dawson détenait 18 118,23 (31 décembre 2025 : 18 118,23) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 8 164,92 (31 décembre 2025 : 8 164,92) actions du Fonds Low Duration Income Fund et 1 775,83 (31 décembre 2025 : 1 775,83) actions du Fonds Low Duration Opportunities Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 30 juin 2026, David M. Kennedy détenait 16 786,79 (31 décembre 2025 : 16 786,79) actions du Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund, 3 595,17 (31 décembre 2025 : 3 706,36) actions du Fonds Emerging Markets Bond Fund et 21 030,49 (31 décembre 2025 : 21 030,49) actions du Fonds Global Investment Grade Credit Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 30 juin 2026, Myles Lee détenait 9 271,85 (31 décembre 2025 : 9 271,85) action du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 598,86 (31 décembre 2025 : 598,86) actions du Fonds Euro Bond Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Aucun autre Administrateur ne détenait d'actions de la Société au 30 juin 2026 ou au 31 décembre 2025.

Le Secrétaire ne détenait pas d'actions, ni d'obligations non garanties de la Société au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025.

La Société n'avait aucun employé au 30 juin 2026 ni au 31 décembre 2025.

## 11. OPÉRATIONS AVEC DES PERSONNES LIÉES

Les opérations avec le Gestionnaire ou le dépositaire d'un OPCVM et les délégués et sous-délégués de ce Gestionnaire ou dépositaire (à l'exclusion de tout sous-dépositaire désigné par un dépositaire qui n'est pas une société du groupe) et toute société associée ou société du groupe de ce Gestionnaire, dépositaire, délégué ou sous-délégué (« personnes liées ») doivent être effectuées dans des conditions commerciales normales et de pleine concurrence et seulement si ces opérations sont dans l'intérêt des actionnaires. Les Administrateurs sont convaincus que des arrangements (comme en font foi les procédures écrites) sont en place pour garantir que les opérations avec des parties liées sont effectuées comme décrit plus haut et que les conditions y afférentes ont été respectées au cours de la période financière.

## 12. TAUX DE CHANGE

Aux fins de la consolidation des états financiers des Fonds pour la comptabilité de la Société (requis en vertu de la loi irlandaise sur les sociétés), les sommes figurant dans le Bilan ont été converties, au taux de change en vigueur au 30 juin 2026, de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,87466) (31 décembre 2025 : USD/EUR : 0,85146) et de la livre sterling au dollar américain (USD/GBP : 0,75344) (31 décembre 2025 : USD/GBP : 0,74347). Les montants du Compte de résultat et de l'État de l'évolution des actifs nets ont été convertis au taux de change moyen pour l'exercice clos le 30 juin 2026, de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,85738) (30 juin 2025 : USD/EUR : 0,91582) et de la livre sterling au dollar américain (USD/GBP : 0,74368) (30 juin 2025 : USD/GBP : 0,77142).

Le tableau suivant reflète les taux de change utilisés pour convertir la livre sterling, l'euro et le dollar américain, les devises de fonctionnement des Fonds de la Société, les investissements et autres actifs et passifs libellés dans des devises autres que la devise de fonctionnement de chaque Fonds.

| Devise étrangère | 30 juin 2026           |              |              |
|------------------|------------------------|--------------|--------------|
|                  | Devise de présentation |              |              |
|                  | EUR                    | GBP          | USD          |
| AED              | O/S                    | O/S          | 3,67275      |
| ARS              | 1 694,04912            | O/S          | 1 481,71870  |
| AUD              | 1,65026                | 1,91578      | 1,44342      |
| AZN              | O/S                    | O/S          | 1,70000      |
| BRL              | 5,91766                | 6,86978      | 5,17595      |
| CAD              | 1,62206                | 1,88303      | 1,41875      |
| CHF              | 0,92224                | 1,07063      | 0,80665      |
| CLP              | O/S                    | O/S          | 922,09500    |
| CNH              | 7,76072                | 9,00937      | 6,78800      |
| CNY              | 7,75775                | 9,00592      | 6,78540      |
| COP              | 3 942,11014            | 4 576,36859  | 3 448,01000  |
| CRC              | O/S                    | O/S          | 452,50000    |
| CZK              | 24,26752               | 28,17199     | 21,22585     |
| DKK              | 7,47490                | 8,67756      | 6,53800      |
| DOP              | O/S                    | O/S          | 59,61000     |
| EGP              | 56,23893               | O/S          | 49,19000     |
| EUR (ou €)       | 1,00000                | 1,16089      | 0,87466      |
| GBP (ou £)       | 0,86141                | 1,00000      | 0,75344      |
| GHS              | O/S                    | O/S          | 11,32500     |
| HKD              | 8,96582                | O/S          | 7,84205      |
| HUF              | 355,92504              | 413,19093    | 311,31375    |
| IDR              | 20 442,20561           | 23 731,21611 | 17 880,00000 |
| ILS              | 3,40641                | 3,95447      | 2,97945      |
| INR              | 108,22336              | 125,63575    | 94,65875     |
| JPY (ou ¥)       | 185,81485              | 215,71118    | 162,52500    |
| KES              | O/S                    | O/S          | 129,45000    |
| KRW              | 1 771,31483            | 2 056,30722  | 1 549,30000  |
| KWD              | 0,35419                | O/S          | 0,30980      |
| KZT              | O/S                    | O/S          | 477,72500    |
| LKR              | O/S                    | O/S          | 335,87500    |
| MNT              | O/S                    | O/S          | 3 585,00000  |
| MXN              | 19,97774               | 23,19202     | 17,47375     |
| MYR              | O/S                    | O/S          | 4,07750      |
| NGN              | 1 576,71944            | O/S          | 1 379,09500  |
| NOK              | 11,31353               | 13,13379     | 9,89550      |
| NZD              | 2,00984                | 2,33322      | 1,75793      |
| PEN              | 3,89820                | 4,52539      | 3,40960      |
| PHP              | O/S                    | O/S          | 61,37000     |
| PKR              | O/S                    | O/S          | 278,07500    |
| PLN              | 4,29749                | 4,98893      | 3,75885      |
| PYG              | O/S                    | O/S          | 6 081,15000  |
| RON              | O/S                    | O/S          | 4,58210      |
| RSD              | O/S                    | O/S          | 102,65000    |
| RUB              | 89,86339               | O/S          | 78,60000     |
| SEK              | 11,06503               | 12,84532     | 9,67815      |
| SGD              | 1,47880                | 1,71673      | 1,29345      |
| THB              | 37,98100               | 44,09188     | 33,22050     |
| TRY              | 53,34124               | 61,92348     | 46,65550     |
| TWD              | 36,42154               | 42,28151     | 31,85650     |
| UGX              | O/S                    | O/S          | 3 663,00000  |
| USD (ou \$)      | 1,14330                | 1,32725      | 1,00000      |
| UYU              | O/S                    | O/S          | 40,19500     |
| UZS              | O/S                    | O/S          | 12 009,27000 |
| VND              | O/S                    | O/S          | 26 311,50000 |
| ZAR              | 18,73869               | 21,75361     | 16,39000     |
| ZMW              | O/S                    | O/S          | 18,08360     |

| Devise étrangère | 31 décembre 2025       |              |              |
|------------------|------------------------|--------------|--------------|
|                  | Devise de présentation |              |              |
|                  | EUR                    | GBP          | USD          |
| AED              | O/S                    | O/S          | 3,67290      |
| ARS              | 1 704,77673            | O/S          | 1 451,55260  |
| AUD              | 1,76119                | 2,01702      | 1,49959      |
| AZN              | O/S                    | O/S          | 1,69925      |
| BRL              | 6,43570                | 7,37054      | 5,47975      |
| CAD              | 1,60988                | 1,84373      | 1,37075      |
| CHF              | 0,93046                | 1,06562      | 0,79225      |
| CLP              | O/S                    | O/S          | 901,57500    |
| CNH              | 8,19761                | 9,38838      | 6,97995      |
| CNY              | 8,20724                | 9,39941      | 6,98815      |
| COP              | 4 436,62782            | 5 081,08632  | 3 777,62000  |
| CZK              | 24,17201               | 27,68321     | 20,58155     |
| DKK              | 7,46904                | 8,55398      | 6,35960      |
| DOP              | O/S                    | O/S          | 63,06000     |
| EGP              | O/S                    | O/S          | 47,70000     |
| EUR (ou €)       | 1,00000                | 1,14526      | 0,85146      |
| GBP (ou £)       | 0,87317                | 1,00000      | 0,74347      |
| GHS              | O/S                    | O/S          | 10,50000     |
| HKD              | 9,14134                | O/S          | 7,78350      |
| HUF              | 383,94021              | 439,71084    | 326,91050    |
| IDR              | 19 583,96264           | 22 428,70228 | 16 675,00000 |
| ILS              | 3,74309                | 4,28681      | 3,18710      |
| INR              | 105,55891              | 120,89225    | 89,87940     |
| JPY (ou ¥)       | 184,08925              | 210,82980    | 156,74500    |
| KES              | O/S                    | O/S          | 129,00000    |
| KRW              | 1 691,85472            | 1 937,61122  | 1 440,55000  |
| KWD              | 0,36114                | O/S          | 0,30750      |
| KZT              | O/S                    | O/S          | 507,40000    |
| MXN              | 21,11603               | 24,18332     | 17,97950     |
| MYR              | O/S                    | O/S          | 4,05800      |
| NGN              | 1 699,13631            | O/S          | 1 446,75000  |
| NOK              | 11,84651               | 13,56731     | 10,08685     |
| NZD              | 2,04234                | 2,33901      | 1,73898      |
| PEN              | 3,94921                | 4,52286      | 3,36260      |
| PHP              | O/S                    | O/S          | 58,83250     |
| PKR              | O/S                    | O/S          | 280,02500    |
| PLN              | 4,22238                | 4,83572      | 3,59520      |
| PYG              | O/S                    | O/S          | 6 579,00500  |
| QAR              | O/S                    | O/S          | 3,64100      |
| RON              | O/S                    | O/S          | 4,33750      |
| RSD              | O/S                    | O/S          | 99,88000     |
| RUB              | 92,89904               | O/S          | 79,10000     |
| SEK              | 10,82702               | 12,39974     | 9,21880      |
| SGD              | 1,51034                | 1,72973      | 1,28600      |
| THB              | 37,00106               | 42,37579     | 31,50500     |
| TRY              | 50,45909               | 57,78871     | 42,96400     |
| TWD              | 36,90182               | 42,26213     | 31,42050     |
| UGX              | O/S                    | O/S          | 3 620,00000  |
| USD (ou \$)      | 1,17445                | 1,34505      | 1,00000      |
| UYU              | O/S                    | O/S          | 39,05500     |
| UZS              | O/S                    | O/S          | 12 025,33000 |
| VND              | O/S                    | O/S          | 26 300,00000 |
| ZAR              | 19,46065               | 22,28747     | 16,57000     |
| ZMW              | O/S                    | O/S          | 22,12500     |

### 13. RISQUES FINANCIERS

Les activités des Fonds les exposent à divers risques financiers tels que le risque de marché (en ce compris le risque de cours, le risque de taux d'intérêt et le risque de change), le risque de crédit et le risque de liquidité.

Le processus global de gestion des risques des Fonds se concentre sur le caractère imprévisible des marchés financiers et vise à minimiser les effets défavorables potentiels sur la performance financière des Fonds. Veuillez consulter le Prospectus pour obtenir plus de détails sur les différents risques auxquels le Fonds peut être exposé.

Les objectifs et politiques de gestion des risques financiers de la Société restent en cohérence avec ceux présentés dans les États financiers annuels audités de la Société portant sur l'exercice clos le 31 décembre 2025.

#### 14. TRANSACTIONS AVEC DES PERSONNES LIÉES POUR LES FONDS DISTRIBUÉS À HONG KONG

Les personnes liées du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation, du Dépositaire et des Administrateurs de la Société sont celles définies dans le Code relatif aux SICAV et aux Fonds communs de placement de la Commission des opérations sur titres et contrats à terme standardisés de Hong Kong (le « Code de la SFC »). Toutes les transactions conclues au cours de l'exercice entre les Fonds agréés par la SFC (« Fonds agréés par la SFC »), comme indiqué dans la section des caractéristiques générales du rapport annuel, et le Gestionnaire, les Conseillers en investissement et/ou les Conseillers en investissement par délégation, le Dépositaire et les Administrateurs de la Société et leurs Personnes liées respectives ont été exécutées dans le cours habituel des activités et dans des conditions commerciales normales.

Les transactions exécutées par l'intermédiaire d'un courtier qui est une Personne liée du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation, du Dépositaire et des Administrateurs de la Société étaient les suivantes pour les exercices clos le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025 :

| Fonds                                                 | 30 juin 2026                                 |                                     | 30 juin 2025                                 |                                     |
|-------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------|
|                                                       | Total des achats et des ventes (en milliers) | % du total des achats et des ventes | Total des achats et des ventes (en milliers) | % du total des achats et des ventes |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund                 | \$ 112 683                                   | 1,95                                | \$ 39 593                                    | 0,48                                |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund               | 36 731                                       | 2,72                                | 5 110                                        | 0,37                                |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund           | 1 902 065                                    | 1,49                                | 423 679                                      | 1,50                                |
| Fonds Commodity Real Return Fund                      | 6 373 348                                    | 19,01                               | 15 625 058                                   | 34,75                               |
| Fonds Diversified Income Fund                         | 1 388 617                                    | 1,54                                | 2 281 469                                    | 1,77                                |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                        | 2 169 944                                    | 1,47                                | 455 772                                      | 0,51                                |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                      | 329 570                                      | 0,91                                | 259 930                                      | 0,96                                |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 12 806                                       | 1,82                                | 2 248                                        | 0,32                                |
| Fonds Global Bond Fund                                | 39 136 562                                   | 8,45                                | 11 190 808                                   | 2,98                                |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                     | 211 058                                      | 0,38                                | 377 310                                      | 1,86                                |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund             | 4 869 060                                    | 4,58                                | 1 702 016                                    | 1,74                                |
| Fonds Global Real Return Fund                         | 13 823 393                                   | 16,40                               | 57 649 634                                   | 36,94                               |
| Fonds Income Fund                                     | 48 862 306                                   | 1,81                                | 38 924 867                                   | 1,90                                |
| Fonds Income Fund II                                  | 136 032                                      | 1,61                                | 166 529                                      | 4,22                                |
| Fonds Low Average Duration Fund                       | 40 759                                       | 0,33                                | 5 723 585                                    | 23,26                               |
| Fonds Total Return Bond Fund                          | 1 121 179                                    | 1,87                                | 8 386 509                                    | 9,96                                |
| Fonds US High Yield Bond Fund                         | 94 630                                       | 0,27                                | 124 656                                      | 0,77                                |

Aucune commission n'a été prélevée sur les transactions du tableau ci-dessus pour les périodes closes le 30 juin 2026 et 30 juin 2025.

Les actions détenues dans des Fonds agréés par la SFC par les Administrateurs de la Société pour les périodes closes le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025 sont détaillées dans la Note 10. Les commissions versées aux Administrateurs de la Société pour les périodes closes le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025 sont détaillées dans la Note 9.

La valeur des actions en circulation détenues par des Personnes liées du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation au-delà de 20 % de l'Actif net des Fonds agréés par la SFC au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 est détaillée dans la Note 10. Les commissions versées au Gestionnaire, aux Conseillers en investissement et/ou aux Conseillers en investissement par délégation sont détaillées dans la Note 9 et dans le Compte de résultat.

Les Administrateurs et Dirigeants du Dépositaire ne détenaient d'actions dans aucun des Fonds agréés par la SFC pour les périodes closes le 30 juin 2026 et le 31 décembre 2025. Comme indiqué à la Note 9, les commissions et frais du Dépositaire sont payés par le Gestionnaire à partir des Frais de gestion ou par les Conseillers en investissement. Tous les avoirs en banque des Fonds agréés par la SFC sont détenus soit par State Street Bank and Trust Co., en tant qu'agent du Dépositaire, soit directement auprès d'un sous-dépositaire. Le Dépositaire peut recevoir des intérêts de la part des Fonds agréés par la SFC ou les prélever sur ces soldes de trésorerie.

#### 15. CAPITAL SOCIAL

##### (a) Actions autorisées

Le capital social autorisé de la Société est de 38 092 € divisé en 30 000 actions de souscripteur à 1,27 € chacune et 500 000 000 000 d'actions de participation sans valeur nominale initialement désignées comme actions non classées.

##### (b) Actions de souscripteur

Les 30 000 actions de souscripteur d'origine, à l'exception de sept d'entre elles, ont été rachetées. Les actions de souscripteur ne font pas partie de la Valeur Nette d'Inventaire de la Société et, de ce fait, sont déclarées dans les états financiers, au titre exclusif de cette note. De l'avis du Conseil, cette déclaration reflète la nature des activités de fonds d'investissement de la Société.

##### (c) Actions de participation rachetables

Le capital social participatif émis est toujours égal à la Valeur Nette d'Inventaire des Fonds. Les actions de participation rachetables sont rachetables au gré des actionnaires et classées en tant que passifs financiers.

#### 16. VALEURS NETTES D'INVENTAIRE

L'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables, les actions émises en circulation, ainsi que la Valeur Nette d'Inventaire par action de chacun des Fonds pour les trois derniers exercices clôturés se présentent comme suit (montants en milliers, excepté les montants par action). La VNI par action publiée dans ces états financiers peut comporter des ajustements requis en vertu de la norme FRS 102, qui peuvent donner lieu à des écarts entre les VNI ou le total des rendements des actionnaires et ceux indiqués dans ces états financiers. L'actif net divisé par le nombre d'Actions émises et en circulation peut ne pas être égal à la VNI par action en raison des arrondis :

|                                  | Au<br>30 juin 2026                    |         | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|----------------------------------|---------------------------------------|---------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
|                                  | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |         |                        |           |                        |           |
| Actif net                        | \$                                    | 935 148 | \$                     | 1 070 680 | \$                     | 1 833 693 |
| Institutions :                   |                                       |         |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                   | \$                                    | 310 460 | \$                     | 362 542   | \$                     | 1 161 904 |
| Actions émises en circulation    |                                       | 26 708  |                        | 32 330    |                        | 114 470   |
| VNI par action                   | \$                                    | 11,62   | \$                     | 11,21     | \$                     | 10,15     |
| Distribution                     | \$                                    | 168 076 | \$                     | 148 131   | \$                     | 122 069   |
| Actions émises en circulation    |                                       | 23 961  |                        | 21 163    |                        | 17 736    |
| VNI par action                   | \$                                    | 7,01    | \$                     | 7,00      | \$                     | 6,88      |
| Institutions en AUD (couverte) : |                                       |         |                        |           |                        |           |
| Distribution                     |                                       | O/S     |                        | O/S       | AUD                    | 133       |
| Actions émises en circulation    |                                       | O/S     |                        | O/S       |                        | 20        |
| VNI par action                   |                                       | O/S     |                        | O/S       | AUD                    | 6,76      |
| Institutions en CHF (couverte) : |                                       |         |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                   | CHF                                   | 2 245   | CHF                    | 2 380     | CHF                    | 2 362     |
| Actions émises en circulation    |                                       | 256     |                        | 276       |                        | 290       |
| VNI par action                   | CHF                                   | 8,77    | CHF                    | 8,64      | CHF                    | 8,15      |
| Distribution                     | CHF                                   | 1 238   | CHF                    | 1 065     | CHF                    | 1 362     |
| Actions émises en circulation    |                                       | 213     |                        | 180       |                        | 224       |
| VNI par action                   | CHF                                   | 5,82    | CHF                    | 5,93      | CHF                    | 6,08      |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                       |         |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                   | €                                     | 54 865  | €                      | 149 136   | €                      | 196 355   |
| Actions émises en circulation    |                                       | 5 733   |                        | 16 011    |                        | 22 834    |
| VNI par action                   | €                                     | 9,57    | €                      | 9,31      | €                      | 8,60      |
| Distribution                     | €                                     | 16 818  | €                      | 17 210    | €                      | 18 695    |
| Actions émises en circulation    |                                       | 2 658   |                        | 2 701     |                        | 2 927     |
| VNI par action                   | €                                     | 6,33    | €                      | 6,37      | €                      | 6,39      |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                       |         |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                   | £                                     | 51 211  | £                      | 24 920    | £                      | 2 311     |
| Actions émises en circulation    |                                       | 5 056   |                        | 2 549     |                        | 261       |
| VNI par action                   | £                                     | 10,13   | £                      | 9,78      | £                      | 8,85      |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                     |     | Au<br>30 juin 2026                               |     | Au<br>31 décembre 2025 |     | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|-----|--------------------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|
|                                     |     | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond<br>Fund (suite) |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | £   | 1 609                                            | £   | 10 685                 | £   | 11 481                 |
| Actions émises en circulation       |     | 244                                              |     | 1 624                  |     | 1 762                  |
| VNI par action                      | £   | 6,59                                             | £   | 6,58                   | £   | 6,52                   |
| Institutions en SGD (couverte) :    |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | SGD | 58 347                                           | SGD | 48 934                 | SGD | 24 422                 |
| Actions émises en circulation       |     | 8 733                                            |     | 7 242                  |     | 3 597                  |
| VNI par action                      | SGD | 6,68                                             | SGD | 6,76                   | SGD | 6,79                   |
| Investisseurs :                     |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                      | \$  | 3 017                                            | \$  | 1 357                  | \$  | 9 322                  |
| Actions émises en circulation       |     | 312                                              |     | 145                    |     | 1 097                  |
| VNI par action                      | \$  | 9,68                                             | \$  | 9,36                   | \$  | 8,50                   |
| Distribution                        | \$  | 12 122                                           | \$  | 14 344                 | \$  | 32 498                 |
| Actions émises en circulation       |     | 1 762                                            |     | 2 089                  |     | 4 814                  |
| VNI par action                      | \$  | 6,88                                             | \$  | 6,87                   | \$  | 6,75                   |
| Investisseurs en AUD (couverte) :   |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | AUD | 2 899                                            | AUD | 2 584                  | AUD | 3 217                  |
| Actions émises en circulation       |     | 435                                              |     | 388                    |     | 489                    |
| VNI par action                      | AUD | 6,67                                             | AUD | 6,67                   | AUD | 6,58                   |
| Investisseurs en EUR (couverte) :   |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | €   | 1 061                                            | €   | 1 026                  | €   | 877                    |
| Actions émises en circulation       |     | 171                                              |     | 164                    |     | 140                    |
| VNI par action                      | €   | 6,19                                             | €   | 6,24                   | €   | 6,25                   |
| Investisseurs en RMB (couverte) :   |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        |     | O/S                                              |     | O/S                    | CNH | 1 831                  |
| Actions émises en circulation       |     | O/S                                              |     | O/S                    |     | 27                     |
| VNI par action                      |     | O/S                                              |     | O/S                    | CNH | 66,77                  |
| Investisseurs en SGD (couverte) :   |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | SGD | 2 228                                            | SGD | 2 252                  | SGD | 2 926                  |
| Actions émises en circulation       |     | 346                                              |     | 346                    |     | 448                    |
| VNI par action                      | SGD | 6,43                                             | SGD | 6,50                   | SGD | 6,54                   |
| Administrations :                   |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | \$  | 33 363                                           | \$  | 38 980                 | \$  | 28 441                 |
| Actions émises en circulation       |     | 4 752                                            |     | 5 564                  |     | 4 130                  |
| VNI par action                      | \$  | 7,02                                             | \$  | 7,01                   | \$  | 6,89                   |
| Catégorie E :                       |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                      | \$  | 35 434                                           | \$  | 44 387                 | \$  | 50 101                 |
| Actions émises en circulation       |     | 3 426                                            |     | 4 430                  |     | 5 474                  |
| VNI par action                      | \$  | 10,34                                            | \$  | 10,02                  | \$  | 9,15                   |
| Distribution                        | \$  | 37 886                                           | \$  | 39 916                 | \$  | 41 786                 |
| Actions émises en circulation       |     | 5 399                                            |     | 5 700                  |     | 6 070                  |
| VNI par action                      | \$  | 7,02                                             | \$  | 7,00                   | \$  | 6,88                   |
| Catégorie E en CHF (couverte) :     |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                      | CHF | 586                                              | CHF | 594                    | CHF | 654                    |
| Actions émises en circulation       |     | 70                                               |     | 72                     |     | 83                     |
| VNI par action                      | CHF | 8,34                                             | CHF | 8,25                   | CHF | 7,86                   |
| Distribution                        | CHF | 456                                              | CHF | 649                    | CHF | 217                    |
| Actions émises en circulation       |     | 78                                               |     | 109                    |     | 36                     |
| VNI par action                      | CHF | 5,82                                             | CHF | 5,93                   | CHF | 6,08                   |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                      | €   | 37 819                                           | €   | 40 841                 | €   | 44 868                 |
| Actions émises en circulation       |     | 4 158                                            |     | 4 592                  |     | 5 416                  |
| VNI par action                      | €   | 9,10                                             | €   | 8,89                   | €   | 8,28                   |
| Distribution                        | €   | 9 539                                            | €   | 9 561                  | €   | 8 771                  |
| Actions émises en circulation       |     | 1 509                                            |     | 1 502                  |     | 1 374                  |
| VNI par action                      | €   | 6,32                                             | €   | 6,37                   | €   | 6,38                   |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | HKD | 3 450                                            | HKD | 4 028                  | HKD | 2 331                  |
| Actions émises en circulation       |     | 492                                              |     | 580                    |     | 342                    |
| VNI par action                      | HKD | 7,02                                             | HKD | 6,95                   | HKD | 6,82                   |
| Catégorie E en SGD (couverte) :     |     |                                                  |     |                        |     |                        |
| Distribution                        | SGD | 30 266                                           | SGD | 29 896                 | SGD | 24 161                 |
| Actions émises en circulation       |     | 4 658                                            |     | 4 551                  |     | 3 660                  |
| VNI par action                      | SGD | 6,50                                             | SGD | 6,57                   | SGD | 6,60                   |

|                                  | Au<br>30 juin 2026                               |         | Au<br>31 décembre 2025 |         | Au<br>31 décembre 2024 |         |
|----------------------------------|--------------------------------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
|                                  | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond<br>Fund (suite) |         |                        |         |                        |         |
| H Institutions :                 |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                   |                                                  | O/S     |                        | O/S     | \$                     | 178     |
| Actions émises en circulation    |                                                  | O/S     |                        | O/S     |                        | 20      |
| VNI par action                   |                                                  | O/S     |                        | O/S     | \$                     | 8,74    |
| Distribution                     | \$                                               | 1 874   | \$                     | 1 864   | \$                     | 323     |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 275     |                        | 274     |                        | 48      |
| VNI par action                   | \$                                               | 6,83    | \$                     | 6,81    | \$                     | 6,70    |
| M Détail :                       |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Distribution II                  | \$                                               | 13 907  | \$                     | 15 013  | \$                     | 15 324  |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 2 222   |                        | 2 385   |                        | 2 439   |
| VNI par action                   | \$                                               | 6,26    | \$                     | 6,29    | \$                     | 6,28    |
| M Détail en HKD (non couverte) : |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Distribution II                  | HKD                                              | 92 063  | HKD                    | 64 126  | HKD                    | 4 479   |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 14 721  |                        | 10 272  |                        | 720     |
| VNI par action                   | HKD                                              | 6,25    | HKD                    | 6,24    | HKD                    | 6,22    |
| M Détail en SGD (couverte) :     |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Distribution II                  | SGD                                              | 9 638   | SGD                    | 9 621   | SGD                    | 7 456   |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 1 663   |                        | 1 630   |                        | 1 238   |
| VNI par action                   | SGD                                              | 5,79    | SGD                    | 5,90    | SGD                    | 6,02    |
| Catégorie Z :                    |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                   | \$                                               | 14 107  | \$                     | 13 564  | \$                     | 23 845  |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 1 156   |                        | 1 156   |                        | 2 260   |
| VNI par action                   | \$                                               | 12,20   | \$                     | 11,73   | \$                     | 10,55   |
|                                  |                                                  |         |                        |         |                        |         |
|                                  |                                                  |         |                        |         |                        |         |
|                                  |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Actif net                        | \$                                               | 287 073 | \$                     | 284 675 | \$                     | 228 519 |
| Institutions :                   |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                   | \$                                               | 26 396  | \$                     | 43 399  | \$                     | 14 193  |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 2 149   |                        | 3 595   |                        | 1 283   |
| VNI par action                   | \$                                               | 12,28   | \$                     | 12,07   | \$                     | 11,06   |
| Distribution                     | \$                                               | 5 138   | \$                     | 11 344  | \$                     | 63 132  |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 619     |                        | 1 354   |                        | 7 793   |
| VNI par action                   | \$                                               | 8,30    | \$                     | 8,38    | \$                     | 8,10    |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                   | €                                                | 11      | €                      | 11      | €                      | 10      |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 1       |                        | 1       |                        | 1       |
| VNI par action                   | €                                                | 11,58   | €                      | 11,49   | €                      | 10,74   |
| Distribution                     | €                                                | 96      | €                      | 115     | €                      | 144     |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 13      |                        | 15      |                        | 19      |
| VNI par action                   | €                                                | 7,53    | €                      | 7,68    | €                      | 7,59    |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Distribution                     | £                                                | 371     | £                      | 372     | £                      | 449     |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 46      |                        | 45      |                        | 56      |
| VNI par action                   | £                                                | 8,13    | £                      | 8,21    | £                      | 7,99    |
| Institutions en SGD (couverte) : |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Distribution                     | SGD                                              | 107 637 | SGD                    | 93 406  | SGD                    | 43 264  |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 13 797  |                        | 11 693  |                        | 5 463   |
| VNI par action                   | SGD                                              | 7,80    | SGD                    | 7,99    | SGD                    | 7,92    |
| Investisseurs :                  |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                   |                                                  | O/S     |                        | O/S     | \$                     | 11      |
| Actions émises en circulation    |                                                  | O/S     |                        | O/S     |                        | 1       |
| VNI par action                   |                                                  | O/S     |                        | O/S     | \$                     | 11,00   |
| Distribution                     |                                                  | O/S     |                        | O/S     | \$                     | 11      |
| Actions émises en circulation    |                                                  | O/S     |                        | O/S     |                        | 1       |
| VNI par action                   |                                                  | O/S     |                        | O/S     | \$                     | 10,24   |
| Catégorie E :                    |                                                  |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                   | \$                                               | 5 349   | \$                     | 4 743   | \$                     | 2 507   |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 511     |                        | 460     |                        | 263     |
| VNI par action                   | \$                                               | 10,46   | \$                     | 10,32   | \$                     | 9,54    |
| Distribution                     | \$                                               | 30 763  | \$                     | 29 700  | \$                     | 19 104  |
| Actions émises en circulation    |                                                  | 4 332   |                        | 4 124   |                        | 2 717   |
| VNI par action                   | \$                                               | 7,10    | \$                     | 7,20    | \$                     | 7,03    |

|                                     | Au<br>30 juin 2026                                 |            | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|-------------------------------------|----------------------------------------------------|------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
|                                     | Fonds Asia Strategic Interest<br>Bond Fund (suite) |            |                        |           |                        |           |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | €                                                  | 5 781      | €                      | 5 747     | €                      | 6 041     |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 614        |                        | 613       |                        | 684       |
| VNI par action                      | €                                                  | 9,41       | €                      | 9,37      | €                      | 8,84      |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | €                                                  | 10 224     | €                      | 10 510    | €                      | 14 795    |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 637        |                        | 682       |                        | 916       |
| VNI par action                      | €                                                  | 16,05      | €                      | 15,42     | €                      | 16,16     |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | HKD                                                | 15 754     | HKD                    | 2 711     | HKD                    | 1 685     |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 1 935      |                        | 331       |                        | 211       |
| VNI par action                      | HKD                                                | 8,14       | HKD                    | 8,20      | HKD                    | 7,99      |
| Catégorie E en SGD (couverte) :     |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | SGD                                                | 15 452     | SGD                    | 13 270    | SGD                    | 3 945     |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 2 040      |                        | 1 703     |                        | 506       |
| VNI par action                      | SGD                                                | 7,57       | SGD                    | 7,79      | SGD                    | 7,80      |
| M Détail en HKD (non couverte) :    |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | HKD                                                | 216 362    | HKD                    | 142 073   | HKD                    | 38 012    |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 34 855     |                        | 22 740    |                        | 6 242     |
| VNI par action                      | HKD                                                | 6,21       | HKD                    | 6,25      | HKD                    | 6,09      |
| Catégorie Z :                       |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | \$                                                 | 75 752     | \$                     | 74 195    | \$                     | 67 547    |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 6 732      |                        | 6 732     |                        | 6 732     |
| VNI par action                      | \$                                                 | 11,25      | \$                     | 11,02     | \$                     | 10,03     |
|                                     | Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund        |            |                        |           |                        |           |
| Actif net                           | \$                                                 | 16 306 289 | \$                     | 5 759 330 | \$                     | 1 380 013 |
| Institutions :                      |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | \$                                                 | 277 760    | \$                     | 88 940    | \$                     | 36 841    |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 8 330      |                        | 2 947     |                        | 1 485     |
| VNI par action                      | \$                                                 | 33,34      | \$                     | 30,18     | \$                     | 24,80     |
| Distribution                        | \$                                                 | 20 636     | \$                     | 8 206     |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 1 709      |                        | 738       |                        | O/S       |
| VNI par action                      | \$                                                 | 12,07      | \$                     | 11,12     |                        | O/S       |
| Distribution II                     | \$                                                 | 90 261     | \$                     | 30 133    | \$                     | 10        |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 7 696      |                        | 2 741     |                        | 1         |
| VNI par action                      | \$                                                 | 11,73      | \$                     | 10,99     | \$                     | 9,69      |
| Institutions en AUD (couverte) :    |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | AUD                                                | 13 768     | AUD                    | 6 155     |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 1 117      |                        | 553       |                        | O/S       |
| VNI par action                      | AUD                                                | 12,33      | AUD                    | 11,13     |                        | O/S       |
| Distribution II                     | AUD                                                | 5 123      | AUD                    | 2 558     |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 446        |                        | 238       |                        | O/S       |
| VNI par action                      | AUD                                                | 11,50      | AUD                    | 10,75     |                        | O/S       |
| Institutions en CHF (couverte) :    |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | CHF                                                | 1 100      | CHF                    | 8         |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 97         |                        | 1         |                        | O/S       |
| VNI par action                      | CHF                                                | 11,36      | CHF                    | 10,45     |                        | O/S       |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                                                    |            |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | €                                                  | 434 828    | €                      | 347 637   | €                      | 308 894   |
| Actions émises en circulation       |                                                    | 15 431     |                        | 13 581    |                        | 14 237    |
| VNI par action                      | €                                                  | 28,18      | €                      | 25,60     | €                      | 21,70     |

|                                      | Au<br>30 juin 2026                                     |           | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |        |
|--------------------------------------|--------------------------------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|--------|
|                                      | Fonds PIMCO Balanced Income and<br>Growth Fund (suite) |           |                        |           |                        |        |
| Distribution II                      | €                                                      | 10 397    | €                      | 1 147     |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 918       |                        | 108       |                        | O/S    |
| VNI par action                       | €                                                      | 11,33     | €                      | 10,67     |                        | O/S    |
| Institutions en GBP (couverte) :     |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Distribution                         | £                                                      | 5 351     | £                      | 3 203     | £                      | 452    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 362       |                        | 237       |                        | 39     |
| VNI par action                       | £                                                      | 14,77     | £                      | 13,54     | £                      | 11,65  |
| Institutions en HKD (non couverte) : |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Distribution                         | HKD                                                    | 68 886    | HKD                    | 17 896    |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 5 706     |                        | 1 621     |                        | O/S    |
| VNI par action                       | HKD                                                    | 12,07     | HKD                    | 11,04     |                        | O/S    |
| Institutions en JPY (couverte) :     |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Distribution II                      | ¥                                                      | 265 882   | ¥                      | 77 347    |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 238       |                        | 73        |                        | O/S    |
| VNI par action                       | ¥                                                      | 1 118,00  | ¥                      | 1 059,00  |                        | O/S    |
| Institutions en RMB (couverte) :     |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Capitalisation                       | CNH                                                    | 12 797    | CNH                    | 10 075    | CNH                    | 8 493  |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 85        |                        | 74        |                        | 73     |
| VNI par action                       | CNH                                                    | 149,90    | CNH                    | 136,53    | CNH                    | 116,02 |
| Distribution                         | CNH                                                    | 568 921   | CNH                    | 223 612   | CNH                    | 85     |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 4 226     |                        | 1 792     |                        | 1      |
| VNI par action                       | CNH                                                    | 134,63    | CNH                    | 124,76    | CNH                    | 110,16 |
| Institutions en RMB (non couverte) : |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Capitalisation                       | CNH                                                    | 143 649   | CNH                    | 75 113    | CNH                    | 46 651 |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 957       |                        | 538       |                        | 386    |
| VNI par action                       | CNH                                                    | 150,09    | CNH                    | 139,67    | CNH                    | 120,71 |
| Distribution                         | CNH                                                    | 3 263 579 | CNH                    | 2 586 810 | CNH                    | 79 753 |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 24 162    |                        | 20 228    |                        | 695    |
| VNI par action                       | CNH                                                    | 135,07    | CNH                    | 127,89    | CNH                    | 114,72 |
| Institutions en SGD (couverte) :     |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Capitalisation                       | SGD                                                    | 15 005    | SGD                    | 11 627    |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 1 242     |                        | 1 055     |                        | O/S    |
| VNI par action                       | SGD                                                    | 12,08     | SGD                    | 11,02     |                        | O/S    |
| Distribution                         | SGD                                                    | 23 239    | SGD                    | 2 813     |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 1 965     |                        | 256       |                        | O/S    |
| VNI par action                       | SGD                                                    | 11,83     | SGD                    | 10,98     |                        | O/S    |
| Distribution II                      | SGD                                                    | 10 957    | SGD                    | 4 624     |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 972       |                        | 434       |                        | O/S    |
| VNI par action                       | SGD                                                    | 11,27     | SGD                    | 10,64     |                        | O/S    |
| Investisseurs :                      |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Capitalisation                       | \$                                                     | 119 694   | \$                     | 34 029    | \$                     | 12 729 |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 4 903     |                        | 1 537     |                        | 697    |
| VNI par action                       | \$                                                     | 24,41     | \$                     | 22,14     | \$                     | 18,25  |
| Administrations :                    |                                                        |           |                        |           |                        |        |
| Capitalisation                       | \$                                                     | 317 725   | \$                     | 53 311    |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 23 567    |                        | 4 358     |                        | O/S    |
| VNI par action                       | \$                                                     | 13,48     | \$                     | 12,23     |                        | O/S    |
| Distribution                         | \$                                                     | 30 724    | \$                     | 38 678    |                        | O/S    |
| Actions émises en circulation        |                                                        | 2 508     |                        | 3 414     |                        | O/S    |
| VNI par action                       | \$                                                     | 12,25     | \$                     | 11,33     |                        | O/S    |



## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                         | Au<br>30 juin 2026                                     |           | Au<br>31 décembre 2025 |         | Au<br>31 décembre 2024 |         |
|-----------------------------------------|--------------------------------------------------------|-----------|------------------------|---------|------------------------|---------|
|                                         | Fonds PIMCO Balanced Income and<br>Growth Fund (suite) |           |                        |         |                        |         |
| Distribution II                         | \$                                                     | 496 779   | \$                     | 164 799 | \$                     | 10 431  |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 42 398    |                        | 14 975  |                        | 1 069   |
| VNI par action                          | \$                                                     | 11,72     | \$                     | 11,00   | \$                     | 9,75    |
| Administrations en EUR (couverte) :     |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Distribution II                         | €                                                      | 8 344     | €                      | 1 893   |                        | O/S     |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 716       |                        | 172     |                        | O/S     |
| VNI par action                          | €                                                      | 11,65     | €                      | 10,99   |                        | O/S     |
| Administrations en HKD (non couverte) : |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Distribution II                         | HKD                                                    | 468 309   | HKD                    | 159 181 | HKD                    | 14 834  |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 39 560    |                        | 14 428  |                        | 1 520   |
| VNI par action                          | HKD                                                    | 11,84     | HKD                    | 11,03   | HKD                    | 9,76    |
| Administrations en SGD (couverte) :     |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                          | SGD                                                    | 128 342   | SGD                    | 23 292  |                        | O/S     |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 9 577     |                        | 1 901   |                        | O/S     |
| VNI par action                          | SGD                                                    | 13,40     | SGD                    | 12,25   |                        | O/S     |
| Distribution                            | SGD                                                    | 49 128    | SGD                    | 13      |                        | O/S     |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 4 499     |                        | 1       |                        | O/S     |
| VNI par action                          | SGD                                                    | 10,92     | SGD                    | 10,15   |                        | O/S     |
| Distribution II                         | SGD                                                    | 356 132   | SGD                    | 43 762  | SGD                    | 2 156   |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 31 476    |                        | 4 086   |                        | 220     |
| VNI par action                          | SGD                                                    | 11,31     | SGD                    | 10,71   | SGD                    | 9,82    |
| BM Détail :                             |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Décumulation                            | \$                                                     | 4 522 552 | \$                     | 936 762 | \$                     | 11      |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 396 324   |                        | 85 882  |                        | 1       |
| VNI par action                          | \$                                                     | 11,41     | \$                     | 10,91   | \$                     | 9,93    |
| Catégorie E :                           |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                          | \$                                                     | 545 845   | \$                     | 197 282 | \$                     | 51 945  |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 20 065    |                        | 7 966   |                        | 2 522   |
| VNI par action                          | \$                                                     | 27,20     | \$                     | 24,77   | \$                     | 20,60   |
| Distribution                            | \$                                                     | 52 556    | \$                     | 30 779  | \$                     | 18 846  |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 4 174     |                        | 2 638   |                        | 1 864   |
| VNI par action                          | \$                                                     | 12,59     | \$                     | 11,67   | \$                     | 10,11   |
| Catégorie E en EUR (couverte) :         |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                          | €                                                      | 232 956   | €                      | 180 904 | €                      | 169 528 |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 10 135    |                        | 8 612   |                        | 9 409   |
| VNI par action                          | €                                                      | 22,99     | €                      | 21,01   | €                      | 18,02   |
| Distribution                            | €                                                      | 69 251    | €                      | 48 443  | €                      | 40 594  |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 6 520     |                        | 4 893   |                        | 4 558   |
| VNI par action                          | €                                                      | 10,62     | €                      | 9,90    | €                      | 8,91    |
| H Institutions :                        |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                          | \$                                                     | 88 685    | \$                     | 11 832  | \$                     | 75      |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 5 602     |                        | 825     |                        | 6       |
| VNI par action                          | \$                                                     | 15,83     | \$                     | 14,34   | \$                     | 11,81   |
| Distribution                            | \$                                                     | 4 489     | \$                     | 2 888   | \$                     | 12      |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 335       |                        | 234     |                        | 1       |
| VNI par action                          | \$                                                     | 13,40     | \$                     | 12,35   | \$                     | 10,57   |
| M Détail :                              |                                                        |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                          | \$                                                     | 591 417   | \$                     | 155 437 | \$                     | 15 716  |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 38 106    |                        | 11 030  |                        | 1 348   |
| VNI par action                          | \$                                                     | 15,52     | \$                     | 14,09   | \$                     | 11,66   |
| Décumulation                            | \$                                                     | 273 854   | \$                     | 59 159  | \$                     | 11      |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 23 436    |                        | 5 329   |                        | 1       |
| VNI par action                          | \$                                                     | 11,69     | \$                     | 11,10   | \$                     | 10,01   |
| Distribution                            | \$                                                     | 275 433   | \$                     | 96 698  | \$                     | 5 337   |
| Actions émises en circulation           |                                                        | 19 582    |                        | 7 448   |                        | 479     |
| VNI par action                          | \$                                                     | 14,07     | \$                     | 12,98   | \$                     | 11,15   |

|                                  | Au<br>30 juin 2026                                     |            | Au<br>31 décembre 2025 |            | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|----------------------------------|--------------------------------------------------------|------------|------------------------|------------|------------------------|-----------|
|                                  | Fonds PIMCO Balanced Income and<br>Growth Fund (suite) |            |                        |            |                        |           |
| Distribution II                  | \$                                                     | 2 643 986  | \$                     | 984 783    | \$                     | 166 554   |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 203 558    |                        | 80 659     |                        | 15 376    |
| VNI par action                   | \$                                                     | 12,99      | \$                     | 12,21      | \$                     | 10,83     |
| M Détail en AUD (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Distribution II                  | AUD                                                    | 372 423    | AUD                    | 140 730    | AUD                    | 12 529    |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 31 364     |                        | 12 639     |                        | 1 248     |
| VNI par action                   | AUD                                                    | 11,87      | AUD                    | 11,13      | AUD                    | 10,04     |
| M Détail en CHF (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Distribution II                  | CHF                                                    | 86 677     | CHF                    | 29 811     | CHF                    | 2 863     |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 7 794      |                        | 2 805      |                        | 288       |
| VNI par action                   | CHF                                                    | 11,12      | CHF                    | 10,63      | CHF                    | 9,94      |
| M Détail en EUR (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                   | €                                                      | 9 416      | €                      | 1 263      |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 817        |                        | 120        |                        | O/S       |
| VNI par action                   | €                                                      | 11,52      | €                      | 10,50      |                        | O/S       |
| Distribution II                  | €                                                      | 16 059     | €                      | 5 111      |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 1 416      |                        | 477        |                        | O/S       |
| VNI par action                   | €                                                      | 11,34      | €                      | 10,70      |                        | O/S       |
| M Détail en GBP (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Distribution II                  | £                                                      | 109 349    | £                      | 42 583     | £                      | 1 606     |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 9 130      |                        | 3 796      |                        | 160       |
| VNI par action                   | £                                                      | 11,98      | £                      | 11,22      | £                      | 10,06     |
| M Détail en HKD (non couverte) : |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                   | HKD                                                    | 399 815    | HKD                    | 21 174     | HKD                    | 1 422     |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 25 652     |                        | 1 507      |                        | 123       |
| VNI par action                   | HKD                                                    | 15,59      | HKD                    | 14,05      | HKD                    | 11,59     |
| Distribution                     | HKD                                                    | 160 929    | HKD                    | 26 494     | HKD                    | 5 484     |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 11 394     |                        | 2 047      |                        | 495       |
| VNI par action                   | HKD                                                    | 14,12      | HKD                    | 12,94      | HKD                    | 11,09     |
| Distribution II                  | HKD                                                    | 8 283 458  | HKD                    | 3 048 437  | HKD                    | 346 297   |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 635 205    |                        | 250 610    |                        | 32 152    |
| VNI par action                   | HKD                                                    | 13,04      | HKD                    | 12,16      | HKD                    | 10,77     |
| M Détail en JPY (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Distribution II                  | ¥                                                      | 48 147 157 | ¥                      | 23 579 969 | ¥                      | 6 577 715 |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 43 727     |                        | 22 572     |                        | 6 744     |
| VNI par action                   | ¥                                                      | 1 101,00   | ¥                      | 1 045,00   | ¥                      | 975,00    |
| M Détail en RMB (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Distribution II                  | CNH                                                    | 720 140    | CNH                    | 322 010    | CNH                    | 16 757    |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 6 259      |                        | 2 958      |                        | 168       |
| VNI par action                   | CNH                                                    | 115,05     | CNH                    | 108,86     | CNH                    | 99,91     |
| M Détail en SGD (couverte) :     |                                                        |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                   | SGD                                                    | 111 463    | SGD                    | 36 366     | SGD                    | 7 005     |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 7 506      |                        | 2 677      |                        | 603       |
| VNI par action                   | SGD                                                    | 14,85      | SGD                    | 13,59      | SGD                    | 11,61     |
| Distribution                     | SGD                                                    | 205 375    | SGD                    | 97 947     | SGD                    | 2 497     |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 15 292     |                        | 7 835      |                        | 225       |
| VNI par action                   | SGD                                                    | 13,43      | SGD                    | 12,50      | SGD                    | 11,11     |
| Distribution II                  | SGD                                                    | 1 350 435  | SGD                    | 584 859    | SGD                    | 90 688    |
| Actions émises en circulation    |                                                        | 108 856    |                        | 49 764     |                        | 8 411     |
| VNI par action                   | SGD                                                    | 12,41      | SGD                    | 11,75      | SGD                    | 10,78     |



|                                    | Au<br>30 juin 2026                                  | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|------------------------------------|-----------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                    | Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie UA                       |                                                     |                        |                        |
| Capitalisation                     | \$ 8 862                                            | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation      | 822                                                 | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                     | \$ 10,77                                            | O/S                    | O/S                    |
| Distribution II                    | \$ 84 976                                           | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation      | 8 122                                               | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                     | \$ 10,46                                            | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie UA en HKD (non couverte) |                                                     |                        |                        |
| Distribution II                    | HKD 262 586                                         | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation      | 24 945                                              | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                     | HKD 10,53                                           | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie UA en SGD (couverte)     |                                                     |                        |                        |
| Capitalisation                     | SGD 24 749                                          | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation      | 2 315                                               | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                     | SGD 10,69                                           | O/S                    | O/S                    |
| Distribution II                    | SGD 157 825                                         | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation      | 15 204                                              | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                     | SGD 10,38                                           | O/S                    | O/S                    |
| UM Détail :                        |                                                     |                        |                        |
| Distribution II                    | \$ 23 231                                           | \$ 25 780              | \$ 28 525              |
| Actions émises en circulation      | 1 887                                               | 2 228                  | 2 782                  |
| VNI par action                     | \$ 12,31                                            | \$ 11,57               | \$ 10,25               |
| UM Détail en SGD (couverte) :      |                                                     |                        |                        |
| Distribution II                    | SGD 190 659                                         | SGD 208 847            | SGD 223 694            |
| Actions émises en circulation      | 16 241                                              | 18 779                 | 21 916                 |
| VNI par action                     | SGD 11,74                                           | SGD 11,12              | SGD 10,21              |
| Catégorie Z :                      |                                                     |                        |                        |
| Capitalisation                     | \$ 161 920                                          | \$ 131 212             | \$ 133 139             |
| Actions émises en circulation      | 6 301                                               | 5 669                  | 7 066                  |
| VNI par action                     | \$ 25,70                                            | \$ 23,15               | \$ 18,84               |
|                                    | Fonds PIMCO Capital Securities Fund                 |                        |                        |
| Actif net                          | \$ 5 717 282                                        | \$ 5 939 296           | \$ 4 753 034           |
| Institutions :                     |                                                     |                        |                        |
| Capitalisation                     | \$ 1 238 114                                        | \$ 1 292 940           | \$ 1 108 196           |
| Actions émises en circulation      | 46 527                                              | 49 618                 | 47 016                 |
| VNI par action                     | \$ 26,61                                            | \$ 26,06               | \$ 23,57               |
| Distribution                       | \$ 462 215                                          | \$ 445 414             | \$ 331 795             |
| Actions émises en circulation      | 41 222                                              | 39 557                 | 30 952                 |
| VNI par action                     | \$ 11,21                                            | \$ 11,26               | \$ 10,72               |
| Institutions en AUD (couverte) :   |                                                     |                        |                        |
| Capitalisation                     | AUD 10 319                                          | AUD 19 759             | AUD 8 773              |
| Actions émises en circulation      | 854                                                 | 1 668                  | 816                    |
| VNI par action                     | AUD 12,09                                           | AUD 11,85              | AUD 10,75              |
| Distribution                       | AUD 18                                              | AUD 6 518              | AUD 16                 |
| Actions émises en circulation      | 2                                                   | 607                    | 2                      |
| VNI par action                     | AUD 10,70                                           | AUD 10,74              | AUD 10,25              |
| Institutions en BRL (couverte) :   |                                                     |                        |                        |
| Capitalisation                     | \$ 37 230                                           | \$ 26 090              | \$ 20 683              |
| Actions émises en circulation      | 2 601                                               | 2 054                  | 2 203                  |
| VNI par action                     | \$ 14,31                                            | \$ 12,70               | \$ 9,39                |

|                                     | Au<br>30 juin 2026                          | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|---------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite) |                        |                        |
| Institutions en CHF (couverte) :    |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | CHF 120 668                                 | CHF 128 678            | CHF 31 483             |
| Actions émises en circulation       | 6 815                                       | 7 270                  | 1 885                  |
| VNI par action                      | CHF 17,71                                   | CHF 17,70              | CHF 16,71              |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 681 915                                   | € 682 134              | € 654 175              |
| Actions émises en circulation       | 39 403                                      | 39 887                 | 41 448                 |
| VNI par action                      | € 17,31                                     | € 17,10                | € 15,78                |
| Distribution                        | € 493 498                                   | € 488 031              | € 469 491              |
| Actions émises en circulation       | 44 684                                      | 43 597                 | 43 203                 |
| VNI par action                      | € 11,04                                     | € 11,19                | € 10,87                |
| Distribution II                     | € 1 195                                     | € 3 408                | € 4 379                |
| Actions émises en circulation       | 146                                         | 410                    | 539                    |
| VNI par action                      | € 8,16                                      | € 8,30                 | € 8,12                 |
| Institutions en GBP (couverte) :    |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | £ 44 622                                    | £ 52 073               | £ 48 863               |
| Actions émises en circulation       | 2 348                                       | 2 797                  | 2 901                  |
| VNI par action                      | £ 19,00                                     | £ 18,62                | £ 16,85                |
| Distribution                        | £ 144 337                                   | £ 142 789              | £ 52 227               |
| Actions émises en circulation       | 11 722                                      | 11 538                 | 4 434                  |
| VNI par action                      | £ 12,31                                     | £ 12,38                | £ 11,78                |
| Institutions en SGD (couverte) :    |                                             |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 48 676                                  | SGD 103 852            | SGD 126 649            |
| Actions émises en circulation       | 5 478                                       | 11 484                 | 14 385                 |
| VNI par action                      | SGD 8,89                                    | SGD 9,04               | SGD 8,80               |
| Investisseurs :                     |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 157 931                                  | \$ 160 451             | \$ 180 837             |
| Actions émises en circulation       | 8 836                                       | 9 152                  | 11 364                 |
| VNI par action                      | \$ 17,87                                    | \$ 17,53               | \$ 15,91               |
| Distribution                        | \$ 48 821                                   | \$ 52 296              | \$ 45 695              |
| Actions émises en circulation       | 4 373                                       | 4 665                  | 4 282                  |
| VNI par action                      | \$ 11,16                                    | \$ 11,21               | \$ 10,67               |
| Investisseurs en AUD (couverte) :   |                                             |                        |                        |
| Distribution                        | AUD 521                                     | AUD 2 693              | AUD 5 170              |
| Actions émises en circulation       | 52                                          | 270                    | 542                    |
| VNI par action                      | AUD 9,94                                    | AUD 9,99               | AUD 9,54               |
| Investisseurs en CAD (couverte) :   |                                             |                        |                        |
| Distribution                        | CAD 3 545                                   | CAD 3 581              | CAD 2 935              |
| Actions émises en circulation       | 348                                         | 347                    | 294                    |
| VNI par action                      | CAD 10,19                                   | CAD 10,32              | CAD 9,99               |
| Investisseurs en EUR (couverte) :   |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 10 230                                    | € 14 136               | € 17 269               |
| Actions émises en circulation       | 688                                         | 961                    | 1 267                  |
| VNI par action                      | € 14,86                                     | € 14,71                | € 13,63                |
| Investisseurs en GBP (couverte) :   |                                             |                        |                        |
| Distribution                        | £ 471                                       | £ 473                  | £ 918                  |
| Actions émises en circulation       | 50                                          | 50                     | 101                    |
| VNI par action                      | £ 9,51                                      | £ 9,56                 | £ 9,10                 |
| Investisseurs en SGD (couverte) :   |                                             |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 8 736                                   | SGD 7 883              | SGD 3 794              |
| Actions émises en circulation       | 887                                         | 787                    | 389                    |
| VNI par action                      | SGD 9,85                                    | SGD 10,02              | SGD 9,76               |
| Administrations :                   |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 166 598                                  | \$ 180 140             | \$ 151 169             |
| Actions émises en circulation       | 6 698                                       | 7 378                  | 6 811                  |
| VNI par action                      | \$ 24,87                                    | \$ 24,41               | \$ 22,19               |
| Distribution                        | \$ 77 668                                   | \$ 79 129              | \$ 73 524              |
| Actions émises en circulation       | 5 152                                       | 5 226                  | 5 101                  |
| VNI par action                      | \$ 15,08                                    | \$ 15,14               | \$ 14,41               |
| Administrations en EUR (couverte) : |                                             |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 7 335                                     | € 12 283               | € 10 342               |
| Actions émises en circulation       | 368                                         | 621                    | 564                    |
| VNI par action                      | € 19,96                                     | € 19,77                | € 18,34                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                  | Au<br>30 juin 2026                             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds PIMCO Capital Securities<br>Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie E :                    |                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 339 792                                     | \$ 337 305             | \$ 307 284             |
| Actions émises en circulation    | 18 860                                         | 19 035                 | 18 999                 |
| VNI par action                   | \$ 18,02                                       | \$ 17,72               | \$ 16,17               |
| Distribution                     | \$ 61 544                                      | \$ 74 190              | \$ 67 570              |
| Actions émises en circulation    | 5 509                                          | 6 612                  | 6 326                  |
| VNI par action                   | \$ 11,17                                       | \$ 11,22               | \$ 10,68               |
| Catégorie E en CHF (couverte) :  |                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | CHF 5 397                                      | CHF 5 905              | CHF 5 729              |
| Actions émises en circulation    | 456                                            | 497                    | 506                    |
| VNI par action                   | CHF 11,83                                      | CHF 11,88              | CHF 11,31              |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 467 185                                      | € 468 478              | € 430 252              |
| Actions émises en circulation    | 32 131                                         | 32 459                 | 32 012                 |
| VNI par action                   | € 14,54                                        | € 14,43                | € 13,44                |
| Distribution                     | € 59 775                                       | € 60 525               | € 63 832               |
| Actions émises en circulation    | 6 573                                          | 6 562                  | 7 132                  |
| VNI par action                   | € 9,09                                         | € 9,22                 | € 8,95                 |
| M Détail :                       |                                                |                        |                        |
| Distribution II                  | \$ 222 531                                     | \$ 231 621             | \$ 214 506             |
| Actions émises en circulation    | 23 699                                         | 24 358                 | 23 302                 |
| VNI par action                   | \$ 9,39                                        | \$ 9,51                | \$ 9,21                |
| M Détail en GBP (couverte) :     |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | £ 10                                           | £ 9                    | £ 9                    |
| Actions émises en circulation    | 1                                              | 1                      | 1                      |
| VNI par action                   | £ 10,75                                        | £ 10,81                | £ 10,29                |
| M Détail en HKD (non couverte) : |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | HKD 6 929                                      | HKD 5 253              | HKD 4 549              |
| Actions émises en circulation    | 647                                            | 492                    | 448                    |
| VNI par action                   | HKD 10,71                                      | HKD 10,68              | HKD 10,15              |
| M Détail en SGD (couverte) :     |                                                |                        |                        |
| Distribution II                  | SGD 433 192                                    | SGD 440 161            | SGD 180 067            |
| Actions émises en circulation    | 50 152                                         | 49 655                 | 20 516                 |
| VNI par action                   | SGD 8,64                                       | SGD 8,86               | SGD 8,78               |
| Catégorie R :                    |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | \$ 2 606                                       | \$ 3 920               | \$ 4 004               |
| Actions émises en circulation    | 231                                            | 346                    | 372                    |
| VNI par action                   | \$ 11,27                                       | \$ 11,32               | \$ 10,78               |
| Catégorie R en EUR (couverte) :  |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | € 1 814                                        | € 1 788                | € 2 211                |
| Actions émises en circulation    | 205                                            | 199                    | 254                    |
| VNI par action                   | € 8,85                                         | € 8,98                 | € 8,71                 |
| Catégorie R en GBP (couverte) :  |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | £ 1 411                                        | £ 1 422                | £ 1 547                |
| Actions émises en circulation    | 142                                            | 142                    | 162                    |
| VNI par action                   | £ 9,97                                         | £ 10,02                | £ 9,53                 |
| Catégorie T :                    |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | \$ 8 799                                       | \$ 9 406               | \$ 9 754               |
| Actions émises en circulation    | 764                                            | 813                    | 886                    |
| VNI par action                   | \$ 11,51                                       | \$ 11,56               | \$ 11,01               |
| Catégorie T en EUR (couverte) :  |                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 60 408                                       | € 62 946               | € 60 975               |
| Actions émises en circulation    | 4 656                                          | 4 879                  | 5 055                  |
| VNI par action                   | € 12,97                                        | € 12,90                | € 12,06                |
| Catégorie Z :                    |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | \$ 30 272                                      | \$ 34 079              | \$ 34 911              |
| Actions émises en circulation    | 2 456                                          | 2 753                  | 2 963                  |
| VNI par action                   | \$ 12,32                                       | \$ 12,38               | \$ 11,78               |
| Catégorie Z en AUD (couverte) :  |                                                |                        |                        |
| Distribution                     | AUD 35 305                                     | AUD 29 049             | AUD 31 859             |
| Actions émises en circulation    | 3 367                                          | 2 754                  | 3 165                  |
| VNI par action                   | AUD 10,49                                      | AUD 10,55              | AUD 10,06              |

|                                     | Au<br>30 juin 2026            | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds PIMCO Climate Bond Fund |                        |                        |
| Actif net                           | \$ 406 092                    | \$ 370 822             | \$ 318 213             |
| Institutions :                      |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 47 946                     | \$ 52 843              | \$ 49 257              |
| Actions émises en circulation       | 4 426                         | 4 921                  | 4 937                  |
| VNI par action                      | \$ 10,83                      | \$ 10,74               | \$ 9,98                |
| Institutions en AUD (couverte) :    |                               |                        |                        |
| Distribution                        | AUD 6 280                     | AUD 6 907              | AUD 5 466              |
| Actions émises en circulation       | 591                           | 645                    | 531                    |
| VNI par action                      | AUD 10,62                     | AUD 10,71              | AUD 10,29              |
| Institutions en CHF (couverte) :    |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | CHF 18 766                    | CHF 18 557             | CHF 440                |
| Actions émises en circulation       | 2 111                         | 2 063                  | 50                     |
| VNI par action                      | CHF 8,89                      | CHF 9,00               | CHF 8,73               |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 73 668                      | € 40 736               | € 41 458               |
| Actions émises en circulation       | 7 519                         | 4 156                  | 4 459                  |
| VNI par action                      | € 9,80                        | € 9,80                 | € 9,30                 |
| Distribution                        | € 76 733                      | € 76 385               | € 76 438               |
| Actions émises en circulation       | 8 980                         | 8 786                  | 8 999                  |
| VNI par action                      | € 8,55                        | € 8,69                 | € 8,49                 |
| Institutions en GBP (couverte) :    |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | £ 53 808                      | £ 39 793               | £ 33 070               |
| Actions émises en circulation       | 5 088                         | 3 793                  | 3 391                  |
| VNI par action                      | £ 10,58                       | £ 10,49                | £ 9,75                 |
| Distribution                        | £ 22 706                      | £ 30 847               | £ 37 367               |
| Actions émises en circulation       | 2 458                         | 3 311                  | 4 183                  |
| VNI par action                      | £ 9,24                        | £ 9,32                 | £ 8,93                 |
| Institutions en SEK (couverte) :    |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | SEK 56 893                    | SEK 48 021             | SEK 48 224             |
| Actions émises en circulation       | 585                           | 493                    | 521                    |
| VNI par action                      | SEK 97,22                     | SEK 97,44              | SEK 92,56              |
| Institutions en SGD (couverte) :    |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | SGD 5 977                     | SGD 5 620              | SGD 5 436              |
| Actions émises en circulation       | 595                           | 557                    | 566                    |
| VNI par action                      | SGD 10,05                     | SGD 10,10              | SGD 9,60               |
| Investisseurs :                     |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 51                         | \$ 10                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 5                             | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                      | \$ 10,55                      | \$ 10,48               | O/S                    |
| Investisseurs en EUR (couverte) :   |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 10                          | € 10                   | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 1                             | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                      | € 10,27                       | € 10,29                | O/S                    |
| Administrations en EUR (couverte) : |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 146                         | € 106                  | € 2 110                |
| Actions émises en circulation       | 14                            | 10                     | 206                    |
| VNI par action                      | € 10,73                       | € 10,76                | € 10,26                |
| Administrations en SEK (couverte) : |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | SEK 5 230                     | SEK 3 142              | SEK 79                 |
| Actions émises en circulation       | 55                            | 33                     | 1                      |
| VNI par action                      | SEK 95,09                     | SEK 95,54              | SEK 91,21              |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 8 416                       | € 9 867                | € 10 844               |
| Actions émises en circulation       | 904                           | 1 055                  | 1 212                  |
| VNI par action                      | € 9,31                        | € 9,35                 | € 8,95                 |
| Catégorie Z :                       |                               |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 36 133                     | \$ 35 728              | \$ 33 020              |
| Actions émises en circulation       | 3 235                         | 3 235                  | 3 235                  |
| VNI par action                      | \$ 11,17                      | \$ 11,04               | \$ 10,21               |

|                                      | Au<br>30 juin 2026                         | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                      | Fonds Commodity Real Return Fund           |                        |                        |
| Actif net                            | \$ 1 156 789                               | \$ 836 732             | \$ 739 034             |
| Institutions :                       |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 498 775                                 | \$ 354 842             | \$ 322 068             |
| Actions émises en circulation        | 40 050                                     | 32 601                 | 34 852                 |
| VNI par action                       | \$ 12,45                                   | \$ 10,88               | \$ 9,24                |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 240 794                                  | € 166 537              | € 81 086               |
| Actions émises en circulation        | 21 354                                     | 16 742                 | 9 390                  |
| VNI par action                       | € 11,28                                    | € 9,95                 | € 8,64                 |
| Institutions en EUR (non couverte) : |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 20 146                                   | € 14 923               | € 38 289               |
| Actions émises en circulation        | 1 253                                      | 1 091                  | 2 907                  |
| VNI par action                       | € 16,08                                    | € 13,68                | € 13,17                |
| Institutions en GBP (couverte) :     |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | £ 16 864                                   | £ 11 403               | £ 19 222               |
| Actions émises en circulation        | 1 008                                      | 779                    | 1 542                  |
| VNI par action                       | £ 16,74                                    | £ 14,64                | £ 12,47                |
| Institutions en GBP (non couverte) : |                                            |                        |                        |
| Distribution                         | £ 1 333                                    | £ 1 301                | £ 24 945               |
| Actions émises en circulation        | 149                                        | 150                    | 3 061                  |
| VNI par action                       | £ 8,92                                     | £ 8,69                 | £ 8,15                 |
| Investisseurs :                      |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 35 400                                  | \$ 19 838              | \$ 19 264              |
| Actions émises en circulation        | 3 337                                      | 2 136                  | 2 434                  |
| VNI par action                       | \$ 10,61                                   | \$ 9,29                | \$ 7,91                |
| Investisseurs en EUR (couverte) :    |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 8                                        | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 1                                          | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                       | € 9,58                                     | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie E :                        |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 147 284                                 | \$ 125 076             | \$ 129 651             |
| Actions émises en circulation        | 15 259                                     | 14 760                 | 17 859                 |
| VNI par action                       | \$ 9,65                                    | \$ 8,47                | \$ 7,26                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :      |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 122 811                                  | € 84 736               | € 80 872               |
| Actions émises en circulation        | 14 685                                     | 11 436                 | 12 461                 |
| VNI par action                       | € 8,36                                     | € 7,41                 | € 6,49                 |
| Catégorie E en SGD (couverte) :      |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | SGD 7 297                                  | SGD 3 926              | SGD 2 218              |
| Actions émises en circulation        | 553                                        | 335                    | 216                    |
| VNI par action                       | SGD 13,20                                  | SGD 11,73              | SGD 10,29              |
| H Institutions :                     |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 6 786                                   | \$ 4 200               | \$ 3 755               |
| Actions émises en circulation        | 625                                        | 442                    | 465                    |
| VNI par action                       | \$ 10,85                                   | \$ 9,49                | \$ 8,07                |
| Actif net                            | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund |                        |                        |
|                                      | \$ 245 636                                 | \$ 267 262             | \$ 125 468             |
| Institutions :                       |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 93 514                                  | \$ 109 074             | \$ 57 768              |
| Actions émises en circulation        | 5 445                                      | 6 351                  | 3 630                  |
| VNI par action                       | \$ 17,18                                   | \$ 17,17               | \$ 15,91               |
| Institutions en CHF (couverte) :     |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | CHF 159                                    | CHF 299                | CHF 10 365             |
| Actions émises en circulation        | 14                                         | 26                     | 937                    |
| VNI par action                       | CHF 11,22                                  | CHF 11,44              | CHF 11,07              |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 47 804                                   | € 50 763               | € 26 749               |
| Actions émises en circulation        | 3 428                                      | 3 610                  | 2 010                  |
| VNI par action                       | € 13,94                                    | € 14,06                | € 13,31                |
| Institutions en GBP (couverte) :     |                                            |                        |                        |
| Capitalisation                       | £ 211                                      | £ 211                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 19                                         | 19                     | O/S                    |
| VNI par action                       | £ 10,82                                    | £ 10,81                | O/S                    |

|                                  | Au<br>30 juin 2026                                 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie E :                    |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 26 109                                          | \$ 24 171              | \$ 17 153              |
| Actions émises en circulation    | 1 899                                              | 1 751                  | 1 329                  |
| VNI par action                   | \$ 13,75                                           | \$ 13,81               | \$ 12,90               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 11 314                                           | € 13 728               | € 11 000               |
| Actions émises en circulation    | 1 012                                              | 1 212                  | 1 017                  |
| VNI par action                   | € 11,18                                            | € 11,32                | € 10,82                |
| H Institutions :                 |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 318                                             | \$ 183                 | \$ 11                  |
| Actions émises en circulation    | 28                                                 | 16                     | 1                      |
| VNI par action                   | \$ 11,43                                           | \$ 11,44               | \$ 10,62               |
| Catégorie Z :                    |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 57 627                                          | \$ 57 432              | \$ 10                  |
| Actions émises en circulation    | 5 279                                              | 5 279                  | 1                      |
| VNI par action                   | \$ 10,92                                           | \$ 10,88               | \$ 10,01               |
| Actif net                        | Fonds Diversified Income Fund                      |                        |                        |
|                                  | \$ 9 484 496                                       | \$ 10 206 450          | \$ 8 784 448           |
| Institutions :                   |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 266 453                                         | \$ 455 985             | \$ 439 820             |
| Actions émises en circulation    | 8 593                                              | 15 040                 | 15 997                 |
| VNI par action                   | \$ 31,01                                           | \$ 30,32               | \$ 27,50               |
| Distribution                     | \$ 198 096                                         | \$ 343 099             | \$ 294 391             |
| Actions émises en circulation    | 14 374                                             | 24 737                 | 22 117                 |
| VNI par action                   | \$ 13,78                                           | \$ 13,87               | \$ 13,31               |
| Institutions en CAD (couverte) : |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | CAD 289 365                                        | CAD 287 162            | CAD 463 149            |
| Actions émises en circulation    | 23 486                                             | 23 627                 | 41 335                 |
| VNI par action                   | CAD 12,32                                          | CAD 12,15              | CAD 11,20              |
| Institutions en CHF (couverte) : |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | CHF 4 100                                          | CHF 10 197             | CHF 8 274              |
| Actions émises en circulation    | 301                                                | 749                    | 642                    |
| VNI par action                   | CHF 13,64                                          | CHF 13,62              | CHF 12,89              |
| Distribution                     | CHF 6 706                                          | CHF 6 996              | CHF 5 241              |
| Actions émises en circulation    | 990                                                | 1 005                  | 752                    |
| VNI par action                   | CHF 6,77                                           | CHF 6,96               | CHF 6,97               |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 772 001                                          | € 810 082              | € 864 356              |
| Actions émises en circulation    | 40 999                                             | 43 599                 | 50 262                 |
| VNI par action                   | € 18,83                                            | € 18,58                | € 17,20                |
| Distribution                     | € 259 602                                          | € 230 138              | € 183 650              |
| Actions émises en circulation    | 32 908                                             | 28 699                 | 23 406                 |
| VNI par action                   | € 7,89                                             | € 8,02                 | € 7,85                 |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                   | £ 318 206                                          | £ 307 410              | £ 455 284              |
| Actions émises en circulation    | 19 228                                             | 18 983                 | 30 989                 |
| VNI par action                   | £ 16,55                                            | £ 16,19                | £ 14,69                |
| Distribution                     | £ 204 742                                          | £ 185 322              | £ 234 301              |
| Actions émises en circulation    | 33 116                                             | 29 749                 | 39 226                 |
| VNI par action                   | £ 6,18                                             | £ 6,23                 | £ 5,97                 |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                     | Au<br>30 juin 2026                    |           | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|-------------------------------------|---------------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
|                                     | Fonds Diversified Income Fund (suite) |           |                        |           |                        |           |
| Institutions en MXN (couverte) :    |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | MXN                                   | 3 027 931 | MXN                    | 2 611 699 | MXN                    | 1 242 611 |
| Actions émises en circulation       |                                       | 20 211    |                        | 18 093    |                        | 9 954     |
| VNI par action                      | MXN                                   | 149,82    | MXN                    | 144,35    | MXN                    | 124,83    |
| Institutions en SEK (couverte) :    |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | SEK                                   | 209 063   | SEK                    | 206 746   | SEK                    | 191 664   |
| Actions émises en circulation       |                                       | 1 074     |                        | 1 075     |                        | 1 075     |
| VNI par action                      | SEK                                   | 194,58    | SEK                    | 192,36    | SEK                    | 178,29    |
| Institutions en SGD (couverte) :    |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | SGD                                   | 8 038     | SGD                    | 5 913     | SGD                    | 5 274     |
| Actions émises en circulation       |                                       | 970       |                        | 700       |                        | 636       |
| VNI par action                      | SGD                                   | 8,29      | SGD                    | 8,45      | SGD                    | 8,30      |
| Investisseurs :                     |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | \$                                    | 40 729    | \$                     | 38 774    | \$                     | 30 952    |
| Actions émises en circulation       |                                       | 2 623     |                        | 2 549     |                        | 2 236     |
| VNI par action                      | \$                                    | 15,53     | \$                     | 15,21     | \$                     | 13,84     |
| Distribution                        | \$                                    | 25 633    | \$                     | 24 886    | \$                     | 68 729    |
| Actions émises en circulation       |                                       | 2 751     |                        | 2 654     |                        | 7 638     |
| VNI par action                      | \$                                    | 9,32      | \$                     | 9,38      | \$                     | 9,00      |
| Investisseurs en EUR (couverte) :   |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | €                                     | 16 277    | €                      | 15 911    | €                      | 19 887    |
| Actions émises en circulation       |                                       | 924       |                        | 913       |                        | 1 229     |
| VNI par action                      | €                                     | 17,62     | €                      | 17,42     | €                      | 16,18     |
| Distribution                        | €                                     | 7 489     | €                      | 7 416     | €                      | 8 720     |
| Actions émises en circulation       |                                       | 1 004     |                        | 978       |                        | 1 175     |
| VNI par action                      | €                                     | 7,46      | €                      | 7,58      | €                      | 7,42      |
| Administrations :                   |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | \$                                    | 53 266    | \$                     | 54 969    | \$                     | 69 014    |
| Actions émises en circulation       |                                       | 5 241     |                        | 5 376     |                        | 7 033     |
| VNI par action                      | \$                                    | 10,16     | \$                     | 10,22     | \$                     | 9,81      |
| Administrations en EUR (couverte) : |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | €                                     | 3 294     | €                      | 3 418     | €                      | 3 195     |
| Actions émises en circulation       |                                       | 192       |                        | 202       |                        | 203       |
| VNI par action                      | €                                     | 17,12     | €                      | 16,93     | €                      | 15,75     |
| Administrations en GBP (couverte) : |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | £                                     | 5 037     | £                      | 5 393     | £                      | 7 115     |
| Actions émises en circulation       |                                       | 543       |                        | 578       |                        | 794       |
| VNI par action                      | £                                     | 9,27      | £                      | 9,33      | £                      | 8,96      |
| Administrations en JPY (couverte) : |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | ¥                                     | 377 081   | ¥                      | 356 944   | ¥                      | 232 630   |
| Actions émises en circulation       |                                       | 426       |                        | 405       |                        | 278       |
| VNI par action                      | ¥                                     | 884,00    | ¥                      | 881,00    | ¥                      | 835,00    |
| Administrations en SEK (couverte) : |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | SEK                                   | 86        | SEK                    | 84        | SEK                    | 76        |
| Actions émises en circulation       |                                       | 1         |                        | 1         |                        | 1         |
| VNI par action                      | SEK                                   | 97,05     | SEK                    | 96,21     | SEK                    | 89,62     |
| Administrations en SGD (couverte) : |                                       |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | SGD                                   | 214 149   | SGD                    | 199 202   | SGD                    | 117 737   |
| Actions émises en circulation       |                                       | 25 113    |                        | 22 914    |                        | 13 797    |
| VNI par action                      | SGD                                   | 8,53      | SGD                    | 8,69      | SGD                    | 8,53      |

|                                       | Au<br>30 juin 2026 |           | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|---------------------------------------|--------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| Fonds Diversified Income Fund (suite) |                    |           |                        |           |                        |           |
| BE Détail :                           |                    |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | \$                 | 5 673     | \$                     | 10        |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation         |                    | 544       |                        | 1         |                        | O/S       |
| VNI par action                        | \$                 | 10,44     | \$                     | 10,30     |                        | O/S       |
| BM Détail :                           |                    |           |                        |           |                        |           |
| Décumulation                          | \$                 | 2 493 715 | \$                     | 2 722 042 | \$                     | 1 058 480 |
| Actions émises en circulation         |                    | 275 135   |                        | 290 662   |                        | 111 286   |
| VNI par action                        | \$                 | 9,06      | \$                     | 9,36      | \$                     | 9,51      |
| Distribution II                       | \$                 | 360 670   | \$                     | 376 038   | \$                     | 228 683   |
| Actions émises en circulation         |                    | 39 351    |                        | 40 259    |                        | 24 838    |
| VNI par action                        | \$                 | 9,17      | \$                     | 9,34      | \$                     | 9,21      |
| Catégorie E :                         |                    |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | \$                 | 406 670   | \$                     | 479 147   | \$                     | 536 183   |
| Actions émises en circulation         |                    | 15 713    |                        | 18 850    |                        | 23 051    |
| VNI par action                        | \$                 | 25,88     | \$                     | 25,42     | \$                     | 23,26     |
| Distribution                          | \$                 | 231 571   | \$                     | 252 154   | \$                     | 274 182   |
| Actions émises en circulation         |                    | 18 819    |                        | 20 362    |                        | 23 069    |
| VNI par action                        | \$                 | 12,31     | \$                     | 12,38     | \$                     | 11,89     |
| Catégorie E en CHF (couverte) :       |                    |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | CHF                | 5 677     | CHF                    | 5 633     | CHF                    | 5 623     |
| Actions émises en circulation         |                    | 620       |                        | 614       |                        | 642       |
| VNI par action                        | CHF                | 9,15      | CHF                    | 9,18      | CHF                    | 8,76      |
| Catégorie E en EUR (couverte) :       |                    |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | €                  | 727 649   | €                      | 783 800   | €                      | 858 568   |
| Actions émises en circulation         |                    | 45 521    |                        | 49 471    |                        | 58 024    |
| VNI par action                        | €                  | 15,99     | €                      | 15,84     | €                      | 14,80     |
| Distribution                          | €                  | 406 274   | €                      | 448 285   | €                      | 511 531   |
| Actions émises en circulation         |                    | 45 131    |                        | 48 999    |                        | 57 128    |
| VNI par action                        | €                  | 9,00      | €                      | 9,15      | €                      | 8,95      |
| Catégorie E en SGD (couverte) :       |                    |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                          | SGD                | 15 703    | SGD                    | 15 568    | SGD                    | 14 060    |
| Actions émises en circulation         |                    | 1 902     |                        | 1 848     |                        | 1 701     |
| VNI par action                        | SGD                | 8,26      | SGD                    | 8,42      | SGD                    | 8,27      |
| H Institutions :                      |                    |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | \$                 | 976 494   | \$                     | 843 814   | \$                     | 1 317 568 |
| Actions émises en circulation         |                    | 41 997    |                        | 37 082    |                        | 63 736    |
| VNI par action                        | \$                 | 23,25     | \$                     | 22,76     | \$                     | 20,67     |
| Distribution                          | \$                 | 421       | \$                     | 641       | \$                     | 592       |
| Actions émises en circulation         |                    | 45        |                        | 68        |                        | 65        |
| VNI par action                        | \$                 | 9,40      | \$                     | 9,46      | \$                     | 9,08      |
| M Détail :                            |                    |           |                        |           |                        |           |
| Décumulation                          | \$                 | 199 273   | \$                     | 226 434   | \$                     | 93 200    |
| Actions émises en circulation         |                    | 21 410    |                        | 23 686    |                        | 9 700     |
| VNI par action                        | \$                 | 9,31      | \$                     | 9,56      | \$                     | 9,61      |
| Distribution                          | \$                 | 97 146    | \$                     | 108 939   | \$                     | 116 582   |
| Actions émises en circulation         |                    | 9 235     |                        | 10 293    |                        | 11 476    |
| VNI par action                        | \$                 | 10,52     | \$                     | 10,58     | \$                     | 10,16     |
| Distribution II                       | \$                 | 181 749   | \$                     | 185 349   | \$                     | 179 723   |
| Actions émises en circulation         |                    | 22 747    |                        | 22 876    |                        | 22 751    |
| VNI par action                        | \$                 | 7,99      | \$                     | 8,10      | \$                     | 7,90      |

|                                 |     | Au<br>30 juin 2026                            | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|---------------------------------|-----|-----------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                 |     | Fonds Diversified Income Fund (suite)         |                        |                        |
| M Détail en AUD (couverte) :    |     |                                               |                        |                        |
| Distribution                    | AUD | 38 764                                        | AUD 43 595             | AUD 44 049             |
| Actions émises en circulation   |     | 4 132                                         | 4 616                  | 4 843                  |
| VNI par action                  | AUD | 9,38                                          | AUD 9,44               | AUD 9,09               |
| N Détail :                      |     |                                               |                        |                        |
| Distribution II                 |     | O/S                                           | \$ 12                  | \$ 10                  |
| Actions émises en circulation   |     | O/S                                           | 1                      | 1                      |
| VNI par action                  |     | O/S                                           | 10,79                  | \$ 9,88                |
| Catégorie T :                   |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | \$  | 17 300                                        | \$ 18 128              | \$ 21 617              |
| Actions émises en circulation   |     | 1 256                                         | 1 337                  | 1 736                  |
| VNI par action                  | \$  | 13,77                                         | \$ 13,55               | \$ 12,45               |
| Distribution                    | \$  | 4 787                                         | \$ 4 643               | \$ 5 172               |
| Actions émises en circulation   |     | 495                                           | 477                    | 554                    |
| VNI par action                  | \$  | 9,66                                          | \$ 9,73                | \$ 9,33                |
| Catégorie T en EUR (couverte) : |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | €   | 27 574                                        | € 31 578               | € 33 260               |
| Actions émises en circulation   |     | 2 500                                         | 2 883                  | 3 238                  |
| VNI par action                  | €   | 11,03                                         | € 10,95                | € 10,27                |
| Distribution                    | €   | 15 816                                        | € 15 895               | € 17 152               |
| Actions émises en circulation   |     | 2 051                                         | 2 028                  | 2 236                  |
| VNI par action                  | €   | 7,71                                          | € 7,84                 | € 7,67                 |
| Catégorie W :                   |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | \$  | 20 791                                        | \$ 21 023              | \$ 21 697              |
| Actions émises en circulation   |     | 1 799                                         | 1 862                  | 2 122                  |
| VNI par action                  | \$  | 11,56                                         | \$ 11,29               | \$ 10,22               |
| Distribution                    | \$  | 7 519                                         | \$ 8 424               | \$ 9 203               |
| Actions émises en circulation   |     | 860                                           | 957                    | 1 090                  |
| VNI par action                  | \$  | 8,74                                          | \$ 8,80                | \$ 8,44                |
| Catégorie W en CHF (couverte) : |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | CHF | 980                                           | CHF 980                | CHF 1 140              |
| Actions émises en circulation   |     | 103                                           | 103                    | 127                    |
| VNI par action                  | CHF | 9,51                                          | CHF 9,48               | CHF 8,96               |
| Distribution                    | CHF | 141                                           | CHF 78                 | CHF 78                 |
| Actions émises en circulation   |     | 20                                            | 11                     | 10                     |
| VNI par action                  | CHF | 7,19                                          | CHF 7,40               | CHF 7,41               |
| Catégorie W en EUR (couverte) : |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | €   | 3 660                                         | € 3 682                | € 3 789                |
| Actions émises en circulation   |     | 352                                           | 359                    | 400                    |
| VNI par action                  | €   | 10,39                                         | € 10,25                | € 9,47                 |
| Distribution                    | €   | 232                                           | € 235                  | € 694                  |
| Actions émises en circulation   |     | 29                                            | 29                     | 89                     |
| VNI par action                  | €   | 7,87                                          | € 8,00                 | € 7,82                 |
| Catégorie W en GBP (couverte) : |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | £   | 339                                           | £ 331                  | £ 300                  |
| Actions émises en circulation   |     | 30                                            | 30                     | 30                     |
| VNI par action                  | £   | 11,24                                         | £ 10,99                | £ 9,95                 |
| Distribution                    | £   | 17                                            | £ 17                   | £ 16                   |
| Actions émises en circulation   |     | 2                                             | 2                      | 2                      |
| VNI par action                  | £   | 8,51                                          | £ 8,57                 | £ 8,22                 |
| Catégorie W en SGD (couverte) : |     |                                               |                        |                        |
| Distribution                    | SGD | 893                                           | SGD 911                | SGD 1 563              |
| Actions émises en circulation   |     | 110                                           | 110                    | 192                    |
| VNI par action                  | SGD | 8,14                                          | SGD 8,31               | SGD 8,15               |
| Actif net                       |     |                                               |                        |                        |
|                                 |     | Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund |                        |                        |
|                                 | \$  | 419 379                                       | \$ 380 653             | \$ 296 525             |
| Institutions :                  |     |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                  | \$  | 28 207                                        | \$ 31 735              | \$ 25 938              |
| Actions émises en circulation   |     | 1 418                                         | 1 648                  | 1 485                  |
| VNI par action                  | \$  | 19,89                                         | \$ 19,25               | \$ 17,48               |

|                                  |    | Au<br>30 juin 2026                                    | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|----|-------------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  |    | Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite) |                        |                        |
| Institutions en EUR (couverte) : |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | €  | 51 828                                                | € 33 777               | € 21 182               |
| Actions émises en circulation    |    | 3 144                                                 | 2 097                  | 1 420                  |
| VNI par action                   | €  | 16,49                                                 | € 16,10                | € 14,91                |
| Distribution II                  | €  | 4 796                                                 | € 4 775                | € 8 925                |
| Actions émises en circulation    |    | 666                                                   | 654                    | 1 225                  |
| VNI par action                   | €  | 7,21                                                  | € 7,31                 | € 7,29                 |
| Institutions en GBP (couverte) : |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | £  | 83 078                                                | £ 77 886               | £ 76 976               |
| Actions émises en circulation    |    | 4 345                                                 | 4 205                  | 4 577                  |
| VNI par action                   | £  | 19,12                                                 | £ 18,52                | £ 16,82                |
| Distribution                     | £  | 12 897                                                | £ 8 943                | £ 2 139                |
| Actions émises en circulation    |    | 1 516                                                 | 1 050                  | 258                    |
| VNI par action                   | £  | 8,51                                                  | £ 8,52                 | £ 8,28                 |
| Investisseurs :                  |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ | 6 317                                                 | \$ 6 385               | \$ 5 592               |
| Actions émises en circulation    |    | 386                                                   | 402                    | 387                    |
| VNI par action                   | \$ | 16,37                                                 | \$ 15,88               | \$ 14,46               |
| Catégorie E :                    |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ | 40 244                                                | \$ 33 161              | \$ 25 811              |
| Actions émises en circulation    |    | 2 565                                                 | 2 174                  | 1 847                  |
| VNI par action                   | \$ | 15,69                                                 | \$ 15,26               | \$ 13,97               |
| Distribution                     | \$ | 44 925                                                | \$ 43 619              | \$ 43 284              |
| Actions émises en circulation    |    | 4 464                                                 | 4 334                  | 4 423                  |
| VNI par action                   | \$ | 10,06                                                 | \$ 10,07               | \$ 9,79                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | €  | 67 348                                                | € 64 969               | € 43 160               |
| Actions émises en circulation    |    | 4 608                                                 | 4 532                  | 3 222                  |
| VNI par action                   | €  | 14,62                                                 | € 14,34                | € 13,40                |
| Distribution                     | €  | 26 735                                                | € 23 315               | € 20 232               |
| Actions émises en circulation    |    | 3 498                                                 | 3 020                  | 2 645                  |
| VNI par action                   | €  | 7,64                                                  | € 7,72                 | € 7,65                 |
| Actif net                        |    |                                                       |                        |                        |
|                                  |    | Fonds Diversified Income ESG Fund                     |                        |                        |
|                                  | \$ | 46 701                                                | \$ 50 129              | \$ 49 578              |
| Institutions :                   |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ | 11 143                                                | \$ 10 918              | \$ 10 864              |
| Actions émises en circulation    |    | 866                                                   | 866                    | 947                    |
| VNI par action                   | \$ | 12,87                                                 | \$ 12,61               | \$ 11,47               |
| Institutions en EUR (couverte) : |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | €  | 30 798                                                | € 33 094               | € 37 105               |
| Actions émises en circulation    |    | 2 596                                                 | 2 821                  | 3 407                  |
| VNI par action                   | €  | 11,86                                                 | € 11,73                | € 10,89                |
| Institutions en GBP (couverte) : |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | £  | 242                                                   | £ 237                  | £ 216                  |
| Actions émises en circulation    |    | 19                                                    | 19                     | 19                     |
| VNI par action                   | £  | 12,63                                                 | £ 12,39                | £ 11,28                |
| Catégorie E :                    |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ | 12                                                    | \$ 12                  | \$ 11                  |
| Actions émises en circulation    |    | 1                                                     | 1                      | 1                      |
| VNI par action                   | \$ | 12,43                                                 | \$ 12,23               | \$ 11,23               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | €  | 11                                                    | € 11                   | € 10                   |
| Actions émises en circulation    |    | 1                                                     | 1                      | 1                      |
| VNI par action                   | €  | 11,45                                                 | € 11,38                | € 10,66                |
| Actif net                        |    |                                                       |                        |                        |
|                                  |    | Fonds Dynamic Bond Fund                               |                        |                        |
|                                  | \$ | 4 616 903                                             | \$ 4 554 937           | \$ 3 669 925           |
| Institutions :                   |    |                                                       |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ | 431 394                                               | \$ 393 808             | \$ 329 051             |
| Actions émises en circulation    |    | 25 215                                                | 23 378                 | 21 239                 |
| VNI par action                   | \$ | 17,11                                                 | \$ 16,85               | \$ 15,49               |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                     | Au<br>30 juin 2026              | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds Dynamic Bond Fund (suite) |                        |                        |
| Distribution                        | \$ 16 403                       | \$ 61 979              | \$ 86 104              |
| Actions émises en circulation       | 1 476                           | 5 546                  | 8 046                  |
| VNI par action                      | \$ 11,11                        | \$ 11,17               | \$ 10,70               |
| Institutions en CAD (couverte) :    |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | CAD 7 453                       | CAD 8 175              | CAD 9 839              |
| Actions émises en circulation       | 610                             | 674                    | 868                    |
| VNI par action                      | CAD 12,21                       | CAD 12,12              | CAD 11,34              |
| Institutions en CHF (couverte) :    |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | CHF 2 750                       | CHF 3 017              | CHF 3 271              |
| Actions émises en circulation       | 255                             | 278                    | 314                    |
| VNI par action                      | CHF 10,80                       | CHF 10,85              | CHF 10,42              |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 54 828                        | € 65 386               | € 44 317               |
| Actions émises en circulation       | 3 928                           | 4 715                  | 3 402                  |
| VNI par action                      | € 13,96                         | € 13,87                | € 13,03                |
| Distribution                        | € 3 440                         | € 3 418                | € 3 660                |
| Actions émises en circulation       | 381                             | 372                    | 408                    |
| VNI par action                      | € 9,03                          | € 9,17                 | € 8,96                 |
| Institutions en GBP (couverte) :    |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | £ 2 832 165                     | £ 2 721 878            | £ 2 297 577            |
| Actions émises en circulation       | 188 142                         | 183 557                | 168 298                |
| VNI par action                      | £ 15,05                         | £ 14,83                | £ 13,65                |
| Distribution                        | £ 3 707                         | £ 3 790                | £ 4 356                |
| Actions émises en circulation       | 498                             | 505                    | 491                    |
| VNI par action                      | £ 7,45                          | £ 7,50                 | £ 8,88                 |
| Institutions en NOK (couverte) :    |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | NOK 127                         | NOK 156                | NOK 168                |
| Actions émises en circulation       | 9                               | 11                     | 13                     |
| VNI par action                      | NOK 14,84                       | NOK 14,59              | NOK 13,43              |
| Investisseurs :                     |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 36 529                       | \$ 41 451              | \$ 39 173              |
| Actions émises en circulation       | 2 557                           | 2 941                  | 3 012                  |
| VNI par action                      | \$ 14,29                        | \$ 14,09               | \$ 13,01               |
| Distribution                        | \$ 486                          | \$ 548                 | \$ 832                 |
| Actions émises en circulation       | 49                              | 55                     | 87                     |
| VNI par action                      | \$ 9,94                         | \$ 9,99                | \$ 9,57                |
| Investisseurs en EUR (couverte) :   |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 1 691                         | € 743                  | € 2 190                |
| Actions émises en circulation       | 144                             | 64                     | 199                    |
| VNI par action                      | € 11,73                         | € 11,68                | € 11,01                |
| Administrations :                   |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 12 630                       | \$ 11 328              | \$ 12 311              |
| Actions émises en circulation       | 801                             | 728                    | 856                    |
| VNI par action                      | \$ 15,76                        | \$ 15,55               | \$ 14,38               |
| Administrations en EUR (couverte) : |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 785                           | € 868                  | € 994                  |
| Actions émises en circulation       | 61                              | 68                     | 82                     |
| VNI par action                      | € 12,87                         | € 12,82                | € 12,10                |
| Administrations en SEK (couverte) : |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                      | SEK 46 799                      | SEK 47 359             | SEK 49 342             |
| Actions émises en circulation       | 395                             | 401                    | 442                    |
| VNI par action                      | SEK 118,34                      | SEK 118,06             | SEK 111,64             |

|                                      | Au<br>30 juin 2026              | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                      | Fonds Dynamic Bond Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie E :                        |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 71 468                       | \$ 71 779              | \$ 65 913              |
| Actions émises en circulation        | 5 310                           | 5 393                  | 5 336                  |
| VNI par action                       | \$ 13,46                        | \$ 13,31               | \$ 12,35               |
| Distribution                         | \$ 15 576                       | \$ 15 903              | \$ 12 048              |
| Actions émises en circulation        | 1 534                           | 1 557                  | 1 232                  |
| VNI par action                       | \$ 10,15                        | \$ 10,21               | \$ 9,78                |
| Catégorie E en CHF (couverte) :      |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | CHF 5 302                       | CHF 5 958              | CHF 6 634              |
| Actions émises en circulation        | 567                             | 632                    | 725                    |
| VNI par action                       | CHF 9,35                        | CHF 9,43               | CHF 9,14               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :      |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 65 975                        | € 74 789               | € 63 848               |
| Actions émises en circulation        | 5 482                           | 6 227                  | 5 609                  |
| VNI par action                       | € 12,04                         | € 12,01                | € 11,38                |
| Catégorie E en GBP (couverte) :      |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | £ 1 975                         | £ 1 782                | £ 1 428                |
| Actions émises en circulation        | 155                             | 141                    | 122                    |
| VNI par action                       | £ 12,76                         | £ 12,62                | £ 11,73                |
| G Détail en EUR (couverte) :         |                                 |                        |                        |
| Distribution                         | € 4 545                         | € 4 833                | € 5 119                |
| Actions émises en circulation        | 553                             | 589                    | 638                    |
| VNI par action                       | € 8,23                          | € 8,21                 | € 8,02                 |
| H Institutions :                     |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 27 045                       | \$ 26 421              | \$ 26 938              |
| Actions émises en circulation        | 2 122                           | 2 103                  | 2 327                  |
| VNI par action                       | \$ 12,75                        | \$ 12,56               | \$ 11,58               |
| Catégorie R :                        |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 5 242                        | \$ 5 194               | \$ 5 505               |
| Actions émises en circulation        | 377                             | 379                    | 436                    |
| VNI par action                       | \$ 13,92                        | \$ 13,71               | \$ 12,62               |
| Catégorie Z :                        |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 63 442                       | \$ 59 314              | \$ 60 681              |
| Actions émises en circulation        | 5 292                           | 5 048                  | 5 665                  |
| VNI par action                       | \$ 11,99                        | \$ 11,75               | \$ 10,71               |
| Actif net                            | \$ 6 578 231                    | \$ 6 443 057           | \$ 2 840 608           |
| Institutions :                       |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 3 678 884                    | \$ 3 273 039           | \$ 1 818 589           |
| Actions émises en circulation        | 200 640                         | 182 286                | 124 801                |
| VNI par action                       | \$ 18,34                        | \$ 17,96               | \$ 14,57               |
| Distribution                         | \$ 350 946                      | \$ 358 903             | \$ 101 066             |
| Actions émises en circulation        | 49 699                          | 50 117                 | 16 227                 |
| VNI par action                       | \$ 7,06                         | \$ 7,16                | \$ 6,23                |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 203 779                       | € 185 559              | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 19 596                          | 18 021                 | O/S                    |
| VNI par action                       | € 10,40                         | € 10,30                | O/S                    |
| Institutions en EUR (non couverte) : |                                 |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 952 804                       | € 959 566              | € 495 517              |
| Actions émises en circulation        | 53 869                          | 56 909                 | 31 927                 |
| VNI par action                       | € 17,69                         | € 16,86                | € 15,52                |



|                                        | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------------|--------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Local Bond Fund (suite) |                    |                        |                        |
| Distribution                           | € 388 680          | € 376 987              | € 171 761              |
| Actions émises en circulation          | 54 635             | 53 668                 | 24 787                 |
| VNI par action                         | € 7,11             | € 7,02                 | € 6,93                 |
| Institutions en GBP (couverte) :       |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | £ 18               | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation          | 19                 | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                         | £ 10,13            | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en GBP (non couverte) :   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | £ 57 711           | £ 52 669               | £ 36 430               |
| Actions émises en circulation          | 2 114              | 1 997                  | 1 585                  |
| VNI par action                         | £ 27,30            | £ 26,38                | £ 22,99                |
| Investisseurs :                        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | \$ 32 420          | \$ 19 213              | \$ 5 832               |
| Actions émises en circulation          | 2 374              | 1 434                  | 534                    |
| VNI par action                         | \$ 13,66           | \$ 13,40               | \$ 10,91               |
| Catégorie E :                          |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | \$ 81 763          | \$ 58 372              | \$ 34 706              |
| Actions émises en circulation          | 5 307              | 3 850                  | 2 792                  |
| VNI par action                         | \$ 15,41           | \$ 15,16               | \$ 12,43               |
| Distribution                           | \$ 28 100          | \$ 34 095              | \$ 14 581              |
| Actions émises en circulation          | 4 248              | 5 083                  | 2 500                  |
| VNI par action                         | \$ 6,61            | \$ 6,71                | \$ 5,83                |
| Catégorie E en EUR (non couverte) :    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | € 153 842          | € 116 717              | € 76 471               |
| Actions émises en circulation          | 8 288              | 6 564                  | 4 626                  |
| VNI par action                         | € 18,56            | € 17,78                | € 16,53                |
| Distribution                           | € 29 936           | € 2 511                | € 3 022                |
| Actions émises en circulation          | 3 097              | 263                    | 321                    |
| VNI par action                         | € 9,66             | € 9,54                 | € 9,41                 |
| H Institutions :                       |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | \$ 164 748         | \$ 654 775             | \$ 593                 |
| Actions émises en circulation          | 12 830             | 52 039                 | 58                     |
| VNI par action                         | \$ 12,84           | \$ 12,58               | \$ 10,23               |
| Catégorie Z :                          |                    |                        |                        |
| Distribution                           | \$ 187 710         | \$ 46 143              | \$ 46 333              |
| Actions émises en circulation          | 22 181             | 5 378                  | 6 210                  |
| VNI par action                         | \$ 8,46            | \$ 8,58                | \$ 7,46                |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund     |                    |                        |                        |
| Actif net                              | \$ 223 352         | \$ 141 849             | \$ 116 904             |
| Institutions :                         |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | \$ 11              | \$ 11                  | \$ 4 410               |
| Actions émises en circulation          | 1                  | 1                      | 369                    |
| VNI par action                         | \$ 14,99           | \$ 14,72               | \$ 11,95               |
| Distribution                           | \$ 814             | \$ 873                 | \$ 31                  |
| Actions émises en circulation          | 70                 | 74                     | 3                      |
| VNI par action                         | \$ 11,66           | \$ 11,86               | \$ 10,31               |
| Institutions en EUR (non couverte) :   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | € 184 038          | € 110 139              | € 99 656               |
| Actions émises en circulation          | 13 872             | 8 683                  | 8 541                  |
| VNI par action                         | € 13,27            | € 12,68                | € 11,67                |
| Distribution                           | € 87               | € 66                   | € 11                   |
| Actions émises en circulation          | 8                  | 6                      | 1                      |
| VNI par action                         | € 10,32            | € 10,22                | € 10,08                |
| Institutions en GBP (non couverte) :   |                    |                        |                        |
| Distribution                           | £ 10               | £ 10                   | £ 8                    |
| Actions émises en circulation          | 1                  | 1                      | 1                      |
| VNI par action                         | £ 10,04            | £ 10,09                | £ 9,42                 |
| Catégorie E :                          |                    |                        |                        |
| Capitalisation                         | \$ 14              | \$ 14                  | \$ 12                  |
| Actions émises en circulation          | 1                  | 1                      | 1                      |
| VNI par action                         | \$ 14,42           | \$ 14,23               | \$ 11,67               |

|                                            | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------------|--------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite) |                    |                        |                        |
| Distribution                               | \$ 14              | \$ 14                  | \$ 12                  |
| Actions émises en circulation              | 1                  | 1                      | 1                      |
| VNI par action                             | \$ 11,66           | \$ 11,86               | \$ 10,31               |
| Catégorie E en EUR (non couverte) :        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | € 156              | € 36                   | € 10                   |
| Actions émises en circulation              | 12                 | 3                      | 1                      |
| VNI par action                             | € 12,77            | € 12,27                | € 11,40                |
| Distribution                               | € 84               | € 11                   | € 10                   |
| Actions émises en circulation              | 8                  | 1                      | 1                      |
| VNI par action                             | € 10,32            | € 10,22                | € 10,07                |
| Catégorie Z :                              |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | \$ 11 700          | \$ 11 439              | \$ 9 201               |
| Actions émises en circulation              | 742                | 742                    | 742                    |
| VNI par action                             | \$ 15,78           | \$ 15,42               | \$ 12,41               |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund           |                    |                        |                        |
| Actif net                                  | \$ 6 780 693       | \$ 6 712 555           | \$ 4 179 583           |
| Institutions :                             |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | \$ 1 573 120       | \$ 1 649 748           | \$ 1 424 377           |
| Actions émises en circulation              | 23 882             | 25 941                 | 26 027                 |
| VNI par action                             | \$ 65,87           | \$ 63,60               | \$ 54,73               |
| Distribution                               | \$ 232 937         | \$ 188 358             | \$ 142 911             |
| Actions émises en circulation              | 13 756             | 11 109                 | 9 092                  |
| VNI par action                             | \$ 16,93           | \$ 16,96               | \$ 15,72               |
| Institutions en CHF (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Distribution                               | CHF 11 534         | CHF 9 316              | CHF 17 165             |
| Actions émises en circulation              | 813                | 641                    | 1 222                  |
| VNI par action                             | CHF 14,19          | CHF 14,53              | CHF 14,04              |
| Institutions en EUR (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | € 1 583 882        | € 1 353 786            | € 640 030              |
| Actions émises en circulation              | 32 898             | 28 861                 | 15 533                 |
| VNI par action                             | € 48,15            | € 46,91                | € 41,20                |
| Distribution                               | € 834 291          | € 751 343              | € 432 534              |
| Actions émises en circulation              | 114 110            | 101 592                | 61 899                 |
| VNI par action                             | € 7,31             | € 7,40                 | € 6,99                 |
| Institutions en EUR (non couverte) :       |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | € 120 750          | € 126 258              | € 188 191              |
| Actions émises en circulation              | 7 884              | 8 771                  | 13 395                 |
| VNI par action                             | € 15,32            | € 14,39                | € 14,05                |
| Institutions en GBP (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | £ 58 220           | £ 57 995               | £ 21 958               |
| Actions émises en circulation              | 1 720              | 1 774                  | 780                    |
| VNI par action                             | £ 33,84            | £ 32,70                | £ 28,15                |
| Distribution                               | £ 48 501           | £ 47 460               | £ 47 257               |
| Actions émises en circulation              | 12 272             | 11 972                 | 12 870                 |
| VNI par action                             | £ 3,95             | £ 3,96                 | £ 3,67                 |
| Institutions en NOK (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | NOK 474 191        | NOK 433 722            | O/S                    |
| Actions émises en circulation              | 4 105              | 3 886                  | O/S                    |
| VNI par action                             | NOK 115,52         | NOK 111,61             | O/S                    |
| Institutions en SEK (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Capitalisation                             | SEK 133 988        | SEK 117 272            | O/S                    |
| Actions émises en circulation              | 1 183              | 1 061                  | O/S                    |
| VNI par action                             | SEK 113,27         | SEK 110,58             | O/S                    |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                   | Au<br>30 juin 2026                       |           | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |         |
|-----------------------------------|------------------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|---------|
|                                   | Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite) |           |                        |           |                        |         |
| Institutions en SGD (couverte) :  |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | SGD                                      | 50 825    | SGD                    | 42 387    | SGD                    | 29 366  |
| Actions émises en circulation     |                                          | 3 782     |                        | 3 224     |                        | 2 538   |
| VNI par action                    | SGD                                      | 13,44     | SGD                    | 13,15     | SGD                    | 11,57   |
| Investisseurs :                   |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | \$                                       | 11 203    | \$                     | 6 585     | \$                     | 4 668   |
| Actions émises en circulation     |                                          | 185       |                        | 112       |                        | 92      |
| VNI par action                    | \$                                       | 60,55     | \$                     | 58,55     | \$                     | 50,56   |
| Investisseurs en EUR (couverte) : |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | €                                        | 3 328     | €                      | 5 097     | €                      | 3 762   |
| Actions émises en circulation     |                                          | 304       |                        | 476       |                        | 399     |
| VNI par action                    | €                                        | 10,96     | €                      | 10,70     | €                      | 9,43    |
| Administrations :                 |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | \$                                       | 22 177    | \$                     | 28 647    | \$                     | 27 182  |
| Actions émises en circulation     |                                          | 377       |                        | 503       |                        | 552     |
| VNI par action                    | \$                                       | 58,87     | \$                     | 56,98     | \$                     | 49,28   |
| BM Détail :                       |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Décumulation                      | \$                                       | 25 702    | \$                     | 20 874    | \$                     | 5 419   |
| Actions émises en circulation     |                                          | 2 763     |                        | 2 174     |                        | 573     |
| VNI par action                    | \$                                       | 9,30      | \$                     | 9,60      | \$                     | 9,45    |
| Distribution II                   | \$                                       | 3 745     | \$                     | 2 407     | \$                     | 1 960   |
| Actions émises en circulation     |                                          | 393       |                        | 249       |                        | 213     |
| VNI par action                    | \$                                       | 9,52      | \$                     | 9,66      | \$                     | 9,19    |
| Catégorie E :                     |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | \$                                       | 218 804   | \$                     | 194 411   | \$                     | 164 774 |
| Actions émises en circulation     |                                          | 3 975     |                        | 3 642     |                        | 3 555   |
| VNI par action                    | \$                                       | 55,04     | \$                     | 53,38     | \$                     | 46,35   |
| Distribution                      | \$                                       | 69 106    | \$                     | 62 232    | \$                     | 48 537  |
| Actions émises en circulation     |                                          | 6 773     |                        | 6 091     |                        | 5 124   |
| VNI par action                    | \$                                       | 10,20     | \$                     | 10,22     | \$                     | 9,47    |
| Catégorie E en EUR (couverte) :   |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | €                                        | 181 533   | €                      | 154 875   | €                      | 128 913 |
| Actions émises en circulation     |                                          | 4 520     |                        | 3 940     |                        | 3 700   |
| VNI par action                    | €                                        | 40,16     | €                      | 39,31     | €                      | 34,84   |
| Catégorie E en SGD (couverte) :   |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | SGD                                      | 16 913    | SGD                    | 17 087    | SGD                    | 12 777  |
| Actions émises en circulation     |                                          | 232       |                        | 239       |                        | 201     |
| VNI par action                    | SGD                                      | 72,81     | SGD                    | 71,55     | SGD                    | 63,54   |
| H Institutions :                  |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Capitalisation                    | \$                                       | 1 166 844 | \$                     | 1 405 406 | \$                     | 701 032 |
| Actions émises en circulation     |                                          | 18 286    |                        | 22 793    |                        | 13 190  |
| VNI par action                    | \$                                       | 63,81     | \$                     | 61,66     | \$                     | 53,15   |
| Distribution                      | \$                                       | 299       | \$                     | 299       | \$                     | 276     |
| Actions émises en circulation     |                                          | 34        |                        | 34        |                        | 34      |
| VNI par action                    | \$                                       | 8,68      | \$                     | 8,69      | \$                     | 8,06    |
| M Détail :                        |                                          |           |                        |           |                        |         |
| Décumulation                      | \$                                       | 27 585    | \$                     | 42 121    | \$                     | 30 040  |
| Actions émises en circulation     |                                          | 2 885     |                        | 4 296     |                        | 3 149   |
| VNI par action                    | \$                                       | 9,56      | \$                     | 9,81      | \$                     | 9,54    |
| Distribution                      | \$                                       | 10 958    | \$                     | 11 960    | \$                     | 10 703  |
| Actions émises en circulation     |                                          | 1 193     |                        | 1 301     |                        | 1 256   |
| VNI par action                    | \$                                       | 9,18      | \$                     | 9,19      | \$                     | 8,52    |

|                                      |     | Au<br>30 juin 2026                       |     | Au<br>31 décembre 2025 |     | Au<br>31 décembre 2024 |  |
|--------------------------------------|-----|------------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|--|
|                                      |     | Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite) |     |                        |     |                        |  |
| Distribution II                      | \$  | 9 689                                    | \$  | 11 055                 | \$  | 10 269                 |  |
| Actions émises en circulation        |     | 1 326                                    |     | 1 499                  |     | 1 477                  |  |
| VNI par action                       | \$  | 7,31                                     | \$  | 7,38                   | \$  | 6,95                   |  |
| M Détail en AUD (couverte) :         |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Distribution                         | AUD | 5 250                                    | AUD | 5 850                  | AUD | 4 429                  |  |
| Actions émises en circulation        |     | 656                                      |     | 730                    |     | 594                    |  |
| VNI par action                       | AUD | 8,00                                     | AUD | 8,02                   | AUD | 7,46                   |  |
| Catégorie Z :                        |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Distribution                         | \$  | 20 706                                   | \$  | 20 450                 | \$  | 25 278                 |  |
| Actions émises en circulation        |     | 1 839                                    |     | 1 814                  |     | 2 419                  |  |
| VNI par action                       | \$  | 11,26                                    | \$  | 11,28                  | \$  | 10,45                  |  |
|                                      |     | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund     |     |                        |     |                        |  |
| Actif net                            | \$  | 3 464 812                                | \$  | 3 473 761              | \$  | 2 676 135              |  |
| Institutions :                       |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Capitalisation                       | \$  | 1 046 307                                | \$  | 1 081 138              | \$  | 832 226                |  |
| Actions émises en circulation        |     | 52 387                                   |     | 55 616                 |     | 49 059                 |  |
| VNI par action                       | \$  | 19,97                                    | \$  | 19,44                  | \$  | 16,96                  |  |
| Distribution                         | \$  | 323 717                                  | \$  | 328 592                | \$  | 308 216                |  |
| Actions émises en circulation        |     | 37 924                                   |     | 38 248                 |     | 38 328                 |  |
| VNI par action                       | \$  | 8,54                                     | \$  | 8,59                   | \$  | 8,04                   |  |
| Institutions en CHF (couverte) :     |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Capitalisation                       | CHF | 597 790                                  | CHF | 588 340                | CHF | 517 230                |  |
| Actions émises en circulation        |     | 62 943                                   |     | 62 302                 |     | 60 140                 |  |
| VNI par action                       | CHF | 9,50                                     | CHF | 9,44                   | CHF | 8,60                   |  |
| Institutions en EUR (couverte) :     |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Capitalisation                       | €   | 934 507                                  | €   | 907 442                | €   | 757 945                |  |
| Actions émises en circulation        |     | 72 915                                   |     | 72 071                 |     | 67 583                 |  |
| VNI par action                       | €   | 12,82                                    | €   | 12,59                  | €   | 11,21                  |  |
| Distribution                         | €   | 167 826                                  | €   | 138 864                | €   | 96 146                 |  |
| Actions émises en circulation        |     | 23 910                                   |     | 19 455                 |     | 14 116                 |  |
| VNI par action                       | €   | 7,02                                     | €   | 7,14                   | €   | 6,81                   |  |
| Institutions en GBP (couverte) :     |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Distribution                         | £   | 19 265                                   | £   | 16 341                 | £   | 17 436                 |  |
| Actions émises en circulation        |     | 2 382                                    |     | 2 004                  |     | 2 288                  |  |
| VNI par action                       | £   | 8,09                                     | £   | 8,16                   | £   | 7,62                   |  |
| Institutions en GBP (non couverte) : |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Distribution                         | £   | 2 685                                    | £   | 5 749                  | £   | 6 483                  |  |
| Actions émises en circulation        |     | 329                                      |     | 710                    |     | 797                    |  |
| VNI par action                       | £   | 8,15                                     | £   | 8,10                   | £   | 8,14                   |  |
| Investisseurs en NOK (couverte) :    |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Capitalisation                       | NOK | 5 648                                    | NOK | 5 920                  | NOK | 3 746                  |  |
| Actions émises en circulation        |     | 40                                       |     | 43                     |     | 31                     |  |
| VNI par action                       | NOK | 140,82                                   | NOK | 137,43                 | NOK | 120,38                 |  |
| Investisseurs en SEK (couverte) :    |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Capitalisation                       | SEK | 9 168                                    | SEK | 10 496                 | SEK | 26 674                 |  |
| Actions émises en circulation        |     | 74                                       |     | 86                     |     | 246                    |  |
| VNI par action                       | SEK | 123,08                                   | SEK | 121,42                 | SEK | 108,60                 |  |
| Administrations :                    |     |                                          |     |                        |     |                        |  |
| Capitalisation                       | \$  | 866                                      | \$  | 722                    | \$  | 633                    |  |
| Actions émises en circulation        |     | 73                                       |     | 62                     |     | 62                     |  |
| VNI par action                       | \$  | 11,85                                    | \$  | 11,56                  | \$  | 10,14                  |  |

|                                              | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------------------|--------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite) |                    |                        |                        |
| Distribution                                 | \$ 1 114           | \$ 820                 | \$ 768                 |
| Actions émises en circulation                | 130                | 95                     | 95                     |
| VNI par action                               | \$ 8,54            | \$ 8,60                | \$ 8,05                |
| Administrations en EUR (couverte) :          |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | € 196              | € 115                  | € 740                  |
| Actions émises en circulation                | 16                 | 10                     | 69                     |
| VNI par action                               | € 12,23            | € 12,05                | € 10,78                |
| Administrations en SEK (couverte) :          |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | SEK 3 703          | SEK 906                | SEK 407                |
| Actions émises en circulation                | 37                 | 9                      | 5                      |
| VNI par action                               | SEK 99,99          | SEK 98,72              | SEK 88,49              |
| Catégorie E :                                |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | \$ 10 827          | \$ 8 339               | \$ 6 083               |
| Actions émises en circulation                | 1 024              | 807                    | 668                    |
| VNI par action                               | \$ 10,57           | \$ 10,33               | \$ 9,10                |
| Distribution                                 | \$ 1 609           | \$ 1 124               | \$ 615                 |
| Actions émises en circulation                | 196                | 136                    | 80                     |
| VNI par action                               | \$ 8,20            | \$ 8,25                | \$ 7,71                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :              |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | € 41 717           | € 42 477               | € 37 595               |
| Actions émises en circulation                | 3 849              | 3 972                  | 3 911                  |
| VNI par action                               | € 10,84            | € 10,70                | € 9,61                 |
| H Institutions :                             |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | \$ 11              | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                | 10                 | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                               | \$ 10,10           | O/S                    | O/S                    |
| H Institutions en CHF (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | CHF 8              | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                | 1                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                               | CHF 10,07          | O/S                    | O/S                    |
| H Institutions en EUR (couverte) :           |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | € 9                | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                | 1                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                               | € 10,09            | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie Z :                                |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | \$ 14              | \$ 14                  | \$ 12                  |
| Actions émises en circulation                | 1                  | 1                      | 1                      |
| VNI par action                               | \$ 14,42           | \$ 13,98               | \$ 12,10               |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund   |                    |                        |                        |
| Actif net                                    | \$ 160 606         | \$ 167 518             | \$ 146 021             |
| Institutions :                               |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | \$ 8 037           | \$ 11 159              | \$ 9 210               |
| Actions émises en circulation                | 406                | 575                    | 523                    |
| VNI par action                               | \$ 19,80           | \$ 19,41               | \$ 17,62               |
| Institutions en EUR (couverte) :             |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | € 103 183          | € 102 169              | € 94 542               |
| Actions émises en circulation                | 6 660              | 6 667                  | 6 658                  |
| VNI par action                               | € 15,49            | € 15,32                | € 14,20                |
| Catégorie E :                                |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | \$ 6 710           | \$ 6 968               | \$ 10 215              |
| Actions émises en circulation                | 463                | 487                    | 780                    |
| VNI par action                               | \$ 14,50           | \$ 14,28               | \$ 13,09               |
| Catégorie E en CHF (couverte) :              |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | CHF 5 698          | CHF 5 926              | CHF 7 726              |
| Actions émises en circulation                | 552                | 572                    | 779                    |
| VNI par action                               | CHF 10,32          | CHF 10,37              | CHF 9,92               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :              |                    |                        |                        |
| Capitalisation                               | € 18 216           | € 18 663               | € 19 481               |
| Actions émises en circulation                | 1 383              | 1 426                  | 1 592                  |
| VNI par action                               | € 13,17            | € 13,09                | € 12,24                |

|                                                       | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------------------------|--------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund       |                    |                        |                        |
| Actif net                                             | \$ 1 782 017       | \$ 751 526             | \$ 327 198             |
| Institutions :                                        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | \$ 697 008         | \$ 160 782             | \$ 65 773              |
| Actions émises en circulation                         | 44 794             | 10 801                 | 5 366                  |
| VNI par action                                        | \$ 15,56           | \$ 14,89               | \$ 12,26               |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) :        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | € 605 111          | € 289 093              | € 104 475              |
| Actions émises en circulation                         | 43 588             | 21 958                 | 8 962                  |
| VNI par action                                        | € 13,88            | € 13,17                | € 11,66                |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) :        |                    |                        |                        |
| Distribution                                          | £ 15 807           | £ 4 077                | £ 917                  |
| Actions émises en circulation                         | 1 494              | 391                    | 95                     |
| VNI par action                                        | £ 10,58            | £ 10,42                | £ 9,64                 |
| Investisseurs en EUR (partiellement couverte)         |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | € 9                | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                         | 1                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                        | € 10,26            | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie E :                                         |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | \$ 29 120          | \$ 5 376               | \$ 123                 |
| Actions émises en circulation                         | 2 033              | 391                    | 11                     |
| VNI par action                                        | \$ 14,32           | \$ 13,76               | \$ 11,43               |
| Distribution                                          | \$ 12 385          | \$ 1 809               | \$ 144                 |
| Actions émises en circulation                         | 1 057              | 155                    | 14                     |
| VNI par action                                        | \$ 11,72           | \$ 11,68               | \$ 10,50               |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :         |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | € 168 797          | € 46 332               | € 9 813                |
| Actions émises en circulation                         | 13 065             | 3 765                  | 892                    |
| VNI par action                                        | € 12,92            | € 12,31                | € 11,00                |
| Distribution                                          | € 2 266            | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                         | 229                | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                        | € 9,91             | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie Z :                                         |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | \$ 135 114         | \$ 184 135             | \$ 141 665             |
| Actions émises en circulation                         | 8 635              | 12 350                 | 11 634                 |
| VNI par action                                        | \$ 15,65           | \$ 14,91               | \$ 12,18               |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund |                    |                        |                        |
| Actif net                                             | \$ 20 617          | \$ 14 621              | \$ 15 660              |
| Institutions en EUR (non couverte) :                  |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | € 4 728            | € 1 116                | € 3 797                |
| Actions émises en circulation                         | 261                | 66                     | 234                    |
| VNI par action                                        | € 18,10            | € 16,84                | € 16,20                |
| Catégorie E :                                         |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | \$ 4 613           | \$ 4 163               | \$ 3 442               |
| Actions émises en circulation                         | 292                | 274                    | 265                    |
| VNI par action                                        | \$ 15,80           | \$ 15,17               | \$ 12,98               |
| Catégorie E en EUR (non couverte) :                   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | € 9 270            | € 7 789                | € 8 002                |
| Actions émises en circulation                         | 557                | 502                    | 531                    |
| VNI par action                                        | € 16,64            | € 15,55                | € 15,10                |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                           |                    |                        |                        |
| Actif net                                             | \$ 648 800         | \$ 524 755             | \$ 351 843             |
| Institutions :                                        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                        | \$ 39 775          | \$ 30 216              | \$ 56 954              |
| Actions émises en circulation                         | 3 471              | 2 659                  | 5 464                  |
| VNI par action                                        | \$ 11,46           | \$ 11,37               | \$ 10,42               |
| Distribution                                          | \$ 7               | \$ 7                   | \$ 7                   |
| Actions émises en circulation                         | 1                  | 1                      | 1                      |
| VNI par action                                        | \$ 9,43            | \$ 9,58                | \$ 9,23                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                     | Au<br>30 juin 2026                  |           | Au<br>31 décembre 2025 |         | Au<br>31 décembre 2024 |         |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-----------|------------------------|---------|------------------------|---------|
|                                     | Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite) |           |                        |         |                        |         |
| Institutions en AUD (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Distribution                        | AUD                                 | 58 765    | AUD                    | 59 980  | AUD                    | 61 367  |
| Actions émises en circulation       |                                     | 6 516     |                        | 6 541   |                        | 6 923   |
| VNI par action                      | AUD                                 | 9,02      | AUD                    | 9,17    | AUD                    | 8,86    |
| Institutions en CHF (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      |                                     | O/S       |                        | O/S     | CHF                    | 2 028   |
| Actions émises en circulation       |                                     | O/S       |                        | O/S     |                        | 219     |
| VNI par action                      |                                     | O/S       |                        | O/S     | CHF                    | 9,24    |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | €                                   | 65 683    | €                      | 81 987  | €                      | 53 433  |
| Actions émises en circulation       |                                     | 6 315     |                        | 7 875   |                        | 5 477   |
| VNI par action                      | €                                   | 10,40     | €                      | 10,41   | €                      | 9,76    |
| Distribution                        | €                                   | 30 838    | €                      | 32 524  | €                      | 44 222  |
| Actions émises en circulation       |                                     | 3 614     |                        | 3 713   |                        | 5 127   |
| VNI par action                      | €                                   | 8,53      | €                      | 8,76    | €                      | 8,63    |
| Institutions en GBP (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Distribution                        | £                                   | 74 089    | £                      | 78 509  | £                      | 12 766  |
| Actions émises en circulation       |                                     | 8 058     |                        | 8 398   |                        | 1 416   |
| VNI par action                      | £                                   | 9,19      | £                      | 9,35    | £                      | 9,01    |
| Institutions en NOK (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | NOK                                 | 1 072 500 | NOK                    | 888 389 | NOK                    | 608 917 |
| Actions émises en circulation       |                                     | 9 107     |                        | 7 605   |                        | 5 679   |
| VNI par action                      | NOK                                 | 117,77    | NOK                    | 116,81  | NOK                    | 107,23  |
| Institutions en SEK (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | SEK                                 | 2 017 617 | SEK                    | 742 759 | SEK                    | 502 524 |
| Actions émises en circulation       |                                     | 19 482    |                        | 7 153   |                        | 5 159   |
| VNI par action                      | SEK                                 | 103,56    | SEK                    | 103,84  | SEK                    | 97,42   |
| Institutions en SGD (couverte) :    |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Distribution                        | SGD                                 | 5 030     | SGD                    | 3 836   | SGD                    | 1 896   |
| Actions émises en circulation       |                                     | 574       |                        | 425     |                        | 213     |
| VNI par action                      | SGD                                 | 8,76      | SGD                    | 9,03    | SGD                    | 8,91    |
| Administrations en EUR (couverte) : |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | €                                   | 10        | €                      | 10      | €                      | 9       |
| Actions émises en circulation       |                                     | 1         |                        | 1       |                        | 1       |
| VNI par action                      | €                                   | 10,46     | €                      | 10,49   | €                      | 9,88    |
| Administrations en SEK (couverte) : |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | SEK                                 | 110 901   | SEK                    | 35 826  | SEK                    | 30 695  |
| Actions émises en circulation       |                                     | 1 028     |                        | 330     |                        | 300     |
| VNI par action                      | SEK                                 | 107,87    | SEK                    | 108,44  | SEK                    | 102,24  |
| Catégorie E :                       |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | \$                                  | 2 883     | \$                     | 3 058   | \$                     | 3 335   |
| Actions émises en circulation       |                                     | 264       |                        | 281     |                        | 331     |
| VNI par action                      | \$                                  | 10,93     | \$                     | 10,89   | \$                     | 10,08   |
| Distribution                        | \$                                  | 1 660     | \$                     | 1 595   | \$                     | 1 061   |
| Actions émises en circulation       |                                     | 181       |                        | 170     |                        | 116     |
| VNI par action                      | \$                                  | 9,19      | \$                     | 9,38    | \$                     | 9,12    |
| Catégorie E en CHF (couverte) :     |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Distribution                        |                                     | O/S       |                        | O/S     | CHF                    | 579     |
| Actions émises en circulation       |                                     | O/S       |                        | O/S     |                        | 72      |
| VNI par action                      |                                     | O/S       |                        | O/S     | CHF                    | 8,07    |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                                     |           |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                      | €                                   | 7 263     | €                      | 7 067   | €                      | 6 900   |
| Actions émises en circulation       |                                     | 734       |                        | 711     |                        | 734     |
| VNI par action                      | €                                   | 9,89      | €                      | 9,94    | €                      | 9,40    |

|                                  |     | Au<br>30 juin 2026                  |     | Au<br>31 décembre 2025 |     | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|-----|-------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|
|                                  |     | Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite) |     |                        |     |                        |
| Distribution                     | €   | 5 394                               | €   | 5 096                  | €   | 2 745                  |
| Actions émises en circulation    |     | 649                                 |     | 594                    |     | 322                    |
| VNI par action                   | €   | 8,32                                | €   | 8,58                   | €   | 8,53                   |
| Catégorie R en AUD (couverte) :  |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Distribution                     | AUD | 5 346                               | AUD | 22 442                 | AUD | 23 071                 |
| Actions émises en circulation    |     | 597                                 |     | 2 462                  |     | 2 611                  |
| VNI par action                   | AUD | 8,95                                | AUD | 9,12                   | AUD | 8,84                   |
| Catégorie Z :                    |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | \$  | 4 688                               | \$  | 5 021                  | \$  | 4 961                  |
| Actions émises en circulation    |     | 419                                 |     | 454                    |     | 492                    |
| VNI par action                   | \$  | 11,18                               | \$  | 11,05                  | \$  | 10,08                  |
|                                  |     |                                     |     |                        |     |                        |
|                                  |     | Fonds Euro Bond Fund                |     |                        |     |                        |
| Actif net                        | €   | 1 577 299                           | €   | 1 634 324              | €   | 1 675 554              |
| Institutions :                   |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | €   | 1 116 291                           | €   | 1 173 160              | €   | 1 203 768              |
| Actions émises en circulation    |     | 44 860                              |     | 47 717                 |     | 50 327                 |
| VNI par action                   | €   | 24,88                               | €   | 24,59                  | €   | 23,92                  |
| Distribution                     | €   | 22 968                              | €   | 23 293                 | €   | 25 983                 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 583                               |     | 1 597                  |     | 1 777                  |
| VNI par action                   | €   | 14,51                               | €   | 14,59                  | €   | 14,62                  |
| Institutions en CHF (couverte) : |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | CHF | 275 064                             | CHF | 262 149                | CHF | 263 054                |
| Actions émises en circulation    |     | 8 798                               |     | 8 387                  |     | 8 448                  |
| VNI par action                   | CHF | 31,27                               | CHF | 31,26                  | CHF | 31,14                  |
| Investisseurs :                  |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | €   | 23 778                              | €   | 24 808                 | €   | 23 314                 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 039                               |     | 1 095                  |     | 1 054                  |
| VNI par action                   | €   | 22,88                               | €   | 22,65                  | €   | 22,11                  |
| Catégorie E :                    |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | €   | 95 721                              | €   | 109 127                | €   | 118 440                |
| Actions émises en circulation    |     | 4 620                               |     | 5 308                  |     | 5 868                  |
| VNI par action                   | €   | 20,72                               | €   | 20,56                  | €   | 20,18                  |
| Distribution                     | €   | 20 285                              | €   | 22 194                 | €   | 23 734                 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 937                               |     | 2 108                  |     | 2 250                  |
| VNI par action                   | €   | 10,47                               | €   | 10,53                  | €   | 10,55                  |
|                                  |     |                                     |     |                        |     |                        |
|                                  |     | Fonds Euro Credit Fund              |     |                        |     |                        |
| Actif net                        | €   | 525 240                             | €   | 552 204                | €   | 506 513                |
| Institutions :                   |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | €   | 352 539                             | €   | 363 095                | €   | 336 100                |
| Actions émises en circulation    |     | 20 858                              |     | 21 699                 |     | 20 806                 |
| VNI par action                   | €   | 16,90                               | €   | 16,73                  | €   | 16,15                  |
| Distribution II                  | €   | 167                                 | €   | 179                    | €   | 336                    |
| Actions émises en circulation    |     | 18                                  |     | 19                     |     | 35                     |
| VNI par action                   | €   | 9,37                                | €   | 9,47                   | €   | 9,52                   |
| Catégorie E :                    |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | €   | 23 604                              | €   | 27 016                 | €   | 30 859                 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 834                               |     | 2 111                  |     | 2 475                  |
| VNI par action                   | €   | 12,87                               | €   | 12,80                  | €   | 12,47                  |
| H Institutions :                 |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                   | €   | 148 928                             | €   | 161 912                | €   | 139 130                |
| Actions émises en circulation    |     | 14 573                              |     | 16 011                 |     | 14 263                 |
| VNI par action                   | €   | 10,22                               | €   | 10,11                  | €   | 9,76                   |

|                               | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au4<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------|--------------------------------|------------------------|-------------------------|
|                               | Fonds Euro Crédit Fund (suite) |                        |                         |
| Distribution II               | € 2                            | € 2                    | 88                      |
| Actions émises en circulation | 0                              | 0                      | 10                      |
| VNI par action                | € 8,54                         | € 8,62                 | € 8,67                  |

|                               |                             |             |             |
|-------------------------------|-----------------------------|-------------|-------------|
|                               | Fonds Euro Income Bond Fund |             |             |
| Actif net                     | € 2 853 703                 | € 2 627 574 | € 1 676 869 |
| Institutions :                |                             |             |             |
| Capitalisation                | € 1 027 378                 | € 1 008 854 | € 473 586   |
| Actions émises en circulation | 59 937                      | 59 552      | 29 590      |
| VNI par action                | € 17,14                     | € 16,94     | € 16,00     |
| Distribution                  | € 177 984                   | € 178 636   | € 63 630    |
| Actions émises en circulation | 17 720                      | 17 639      | 6 390       |
| VNI par action                | € 10,04                     | € 10,13     | € 9,96      |

|                               |          |          |          |
|-------------------------------|----------|----------|----------|
| Investisseurs :               |          |          |          |
| Capitalisation                | € 28 241 | € 22 114 | € 14 459 |
| Actions émises en circulation | 2 596    | 2 054    | 1 416    |
| VNI par action                | € 10,88  | € 10,77  | € 10,21  |
| Distribution                  | € 11 045 | € 12 330 | € 10 224 |
| Actions émises en circulation | 1 143    | 1 264    | 1 061    |
| VNI par action                | € 9,66   | € 9,76   | € 9,63   |

|                               |         |         |         |
|-------------------------------|---------|---------|---------|
| Administrations :             |         |         |         |
| Capitalisation                | € 2 192 | € 1 708 | € 1 577 |
| Actions émises en circulation | 195     | 153     | 149     |
| VNI par action                | € 11,24 | € 11,14 | € 10,58 |

|                               |           |           |           |
|-------------------------------|-----------|-----------|-----------|
| Catégorie E :                 |           |           |           |
| Capitalisation                | € 892 312 | € 862 407 | € 643 783 |
| Actions émises en circulation | 59 760    | 58 178    | 45 557    |
| VNI par action                | € 14,93   | € 14,82   | € 14,13   |
| Distribution                  | € 466 404 | € 460 176 | € 408 562 |
| Actions émises en circulation | 53 765    | 52 349    | 46 815    |
| VNI par action                | € 8,67    | € 8,79    | € 8,73    |

|                               |           |     |     |
|-------------------------------|-----------|-----|-----|
| G Institutions :              |           |     |     |
| Distribution                  | € 168 531 | O/S | O/S |
| Actions émises en circulation | 16 671    | O/S | O/S |
| VNI par action                | € 10,11   | O/S | O/S |

|                               |          |          |          |
|-------------------------------|----------|----------|----------|
| Catégorie T :                 |          |          |          |
| Capitalisation                | € 58 002 | € 59 442 | € 43 963 |
| Actions émises en circulation | 5 117    | 5 272    | 4 074    |
| VNI par action                | € 11,33  | € 11,27  | € 10,79  |
| Distribution                  | € 21 614 | € 21 907 | € 17 085 |
| Actions émises en circulation | 2 852    | 2 847    | 2 227    |
| VNI par action                | € 7,58   | € 7,70   | € 7,67   |

|                               |                                       |             |             |
|-------------------------------|---------------------------------------|-------------|-------------|
|                               | Fonds Euro Long Average Duration Fund |             |             |
| Actif net                     | € 1 300 486                           | € 1 178 488 | € 1 188 893 |
| Institutions :                |                                       |             |             |
| Capitalisation                | € 1 299 233                           | € 1 177 097 | € 1 187 154 |
| Actions émises en circulation | 69 078                                | 64 132      | 59 552      |
| VNI par action                | € 18,81                               | € 18,35     | € 19,93     |
| Catégorie E :                 |                                       |             |             |
| Capitalisation                | € 1 253                               | € 1 391     | € 1 739     |
| Actions émises en circulation | 126                                   | 143         | 163         |
| VNI par action                | € 9,95                                | € 9,75      | € 10,69     |

|                               |                            |           |           |
|-------------------------------|----------------------------|-----------|-----------|
|                               | Fonds Euro Short-Term Fund |           |           |
| Actif net                     | € 485 947                  | € 467 790 | € 265 893 |
| Institutions :                |                            |           |           |
| Capitalisation                | € 360 209                  | € 337 749 | € 171 411 |
| Actions émises en circulation | 26 961                     | 25 507    | 13 309    |
| VNI par action                | € 13,36                    | € 13,24   | € 12,88   |
| Investisseurs :               |                            |           |           |
| Capitalisation                | € 2 533                    | € 2 814   | € 4 337   |
| Actions émises en circulation | 241                        | 269       | 425       |
| VNI par action                | € 10,53                    | € 10,45   | € 10,20   |

|                               | Au<br>30 juin 2026                 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------|------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                               | Fonds Euro Short-Term Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie E :                 |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                | € 123 205                          | € 127 227              | € 90 145               |
| Actions émises en circulation | 10 733                             | 11 141                 | 8 055                  |
| VNI par action                | € 11,48                            | € 11,42                | € 11,19                |

|                               |                                           |           |           |
|-------------------------------|-------------------------------------------|-----------|-----------|
|                               | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |           |           |
| Actif net                     | € 596 876                                 | € 524 488 | € 383 525 |
| Institutions :                |                                           |           |           |
| Capitalisation                | € 367 145                                 | € 313 123 | € 215 760 |
| Actions émises en circulation | 28 476                                    | 24 759    | 18 136    |
| VNI par action                | € 12,89                                   | € 12,65   | € 11,90   |

|                                  |          |     |     |
|----------------------------------|----------|-----|-----|
| Institutions en USD (couverte) : |          |     |     |
| Distribution                     | \$ 5 774 | O/S | O/S |
| Actions émises en circulation    | 571      | O/S | O/S |
| VNI par action                   | \$ 10,10 | O/S | O/S |

|                               |          |          |          |
|-------------------------------|----------|----------|----------|
| Catégorie E :                 |          |          |          |
| Capitalisation                | € 39 429 | € 31 091 | € 12 225 |
| Actions émises en circulation | 3 072    | 2 458    | 1 018    |
| VNI par action                | € 12,84  | € 12,65  | € 12,01  |
| Distribution                  | € 1 690  | € 675    | € 78     |
| Actions émises en circulation | 156      | 62       | 7        |
| VNI par action                | € 10,81  | € 10,88  | € 10,79  |

|                               |           |           |           |
|-------------------------------|-----------|-----------|-----------|
| Catégorie Z :                 |           |           |           |
| Capitalisation                | € 183 562 | € 179 599 | € 155 462 |
| Actions émises en circulation | 13 752    | 13 752    | 12 727    |
| VNI par action                | € 13,35   | € 13,06   | € 12,22   |

|                               |                                                    |             |           |
|-------------------------------|----------------------------------------------------|-------------|-----------|
|                               | Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund |             |           |
| Actif net                     | € 1 229 097                                        | € 1 245 180 | € 955 095 |
| Institutions :                |                                                    |             |           |
| Capitalisation                | € 1 113 187                                        | € 1 154 700 | € 897 651 |
| Actions émises en circulation | 87 299                                             | 91 332      | 74 419    |
| VNI par action                | € 12,75                                            | € 12,64     | € 12,06   |

|                               |          |          |          |
|-------------------------------|----------|----------|----------|
| Catégorie E :                 |          |          |          |
| Capitalisation                | € 42 343 | € 24 794 | € 12 790 |
| Actions émises en circulation | 3 956    | 2 329    | 1 250    |
| VNI par action                | € 10,70  | € 10,65  | € 10,23  |

|                               |          |          |          |
|-------------------------------|----------|----------|----------|
| H Institutions :              |          |          |          |
| Capitalisation                | € 73 567 | € 65 686 | € 44 654 |
| Actions émises en circulation | 6 685    | 6 015    | 4 278    |
| VNI par action                | € 11,01  | € 10,92  | € 10,44  |

|                               |                             |            |            |
|-------------------------------|-----------------------------|------------|------------|
|                               | Fonds Global Advantage Fund |            |            |
| Actif net                     | \$ 431 477                  | \$ 441 745 | \$ 404 337 |
| Institutions :                |                             |            |            |
| Capitalisation                | \$ 1 981                    | \$ 1 957   | \$ 7 549   |
| Actions émises en circulation | 125                         | 123        | 530        |
| VNI par action                | \$ 15,88                    | \$ 15,91   | \$ 14,25   |

|                                                |            |            |             |
|------------------------------------------------|------------|------------|-------------|
| Institutions en CHF (partiellement couverte) : |            |            |             |
| Distribution                                   | CHF 73 721 | CHF 75 258 | CHF 107 327 |
| Actions émises en circulation                  | 8 936      | 8 936      | 12 443      |
| VNI par action                                 | CHF 8,25   | CHF 8,42   | CHF 8,63    |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                                        |     | Au<br>30 juin 2026                  |     | Au<br>31 décembre 2025 |     | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|
|                                                        |     | Fonds Global Advantage Fund (suite) |     |                        |     |                        |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) :         |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | €   | 228 756                             | €   | 229 432                | €   | 207 312                |
| Actions émises en circulation                          |     | 15 594                              |     | 15 808                 |     | 14 783                 |
| VNI par action                                         | €   | 14,67                               | €   | 14,51                  | €   | 14,02                  |
| Institutions en NOK (partiellement couverte) :         |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | NOK | 697 458                             | NOK | 693 961                | NOK | 658 128                |
| Actions émises en circulation                          |     | 4 121                               |     | 4 118                  |     | 4 112                  |
| VNI par action                                         | NOK | 169,25                              | NOK | 168,52                 | NOK | 160,06                 |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :          |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | €   | 5 322                               | €   | 5 568                  | €   | 5 542                  |
| Actions émises en circulation                          |     | 425                                 |     | 447                    |     | 456                    |
| VNI par action                                         | €   | 12,51                               | €   | 12,44                  | €   | 12,14                  |
|                                                        |     | Fonds Global Bond Fund              |     |                        |     |                        |
| Actif net                                              | \$  | 17 609 718                          | \$  | 17 559 421             | \$  | 15 803 937             |
| Institutions :                                         |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | \$  | 7 849 723                           | \$  | 7 754 764              | \$  | 7 494 424              |
| Actions émises en circulation                          |     | 205 042                             |     | 203 935                |     | 210 411                |
| VNI par action                                         | \$  | 38,28                               | \$  | 38,03                  | \$  | 35,62                  |
| Distribution                                           | \$  | 374 386                             | \$  | 355 487                | \$  | 279 660                |
| Actions émises en circulation                          |     | 20 016                              |     | 18 749                 |     | 15 127                 |
| VNI par action                                         | \$  | 18,70                               | \$  | 18,96                  | \$  | 18,49                  |
| Institutions (exposition au risque de change) :        |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | \$  | 1 046 264                           | \$  | 1 003 890              | \$  | 443 063                |
| Actions émises en circulation                          |     | 31 114                              |     | 29 629                 |     | 14 400                 |
| VNI par action                                         | \$  | 33,63                               | \$  | 33,88                  | \$  | 30,77                  |
| Distribution                                           | \$  | 18 827                              | \$  | 19 131                 | \$  | 18 092                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 993                                 |     | 981                    |     | 982                    |
| VNI par action                                         | \$  | 18,96                               | \$  | 19,49                  | \$  | 18,42                  |
| Institutions en AUD (couverte) :                       |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | AUD | 103 637                             | AUD | 88 887                 | AUD | 48 080                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 9 357                               |     | 8 080                  |     | 4 648                  |
| VNI par action                                         | AUD | 11,08                               | AUD | 11,00                  | AUD | 10,34                  |
| Institutions en CAD (couverte) :                       |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | CAD | 45 762                              | CAD | 48 975                 | CAD | 46 576                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 3 908                               |     | 4 175                  |     | 4 168                  |
| VNI par action                                         | CAD | 11,71                               | CAD | 11,73                  | CAD | 11,18                  |
| Institutions en CHF (couverte) :                       |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | CHF | 377 981                             | CHF | 394 189                | CHF | 375 487                |
| Actions émises en circulation                          |     | 12 123                              |     | 12 472                 |     | 12 143                 |
| VNI par action                                         | CHF | 31,18                               | CHF | 31,60                  | CHF | 30,92                  |
| Distribution                                           | CHF | 74 627                              | CHF | 76 613                 | CHF | 134 921                |
| Actions émises en circulation                          |     | 4 642                               |     | 4 603                  |     | 7 962                  |
| VNI par action                                         | CHF | 16,08                               | CHF | 16,64                  | CHF | 16,95                  |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : |     |                                     |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | €   | 140 927                             | €   | 162 281                | €   | 179 536                |
| Actions émises en circulation                          |     | 10 125                              |     | 11 887                 |     | 12 770                 |
| VNI par action                                         | €   | 13,92                               | €   | 13,65                  | €   | 14,06                  |

|                                                        | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------------------------|--------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                        | Fonds Global Bond Fund (suite) |                        |                        |
| Institutions en EUR (couverte) :                       |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | € 1 774 187                    | € 1 795 906            | € 1 895 699            |
| Actions émises en circulation                          | 62 345                         | 62 968                 | 69 491                 |
| VNI par action                                         | € 28,46                        | € 28,52                | € 27,28                |
| Distribution                                           | € 360 824                      | € 358 663              | € 305 250              |
| Actions émises en circulation                          | 22 725                         | 22 072                 | 18 877                 |
| VNI par action                                         | € 15,88                        | € 16,25                | € 16,17                |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change) : |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | £ 2 410                        | £ 2 406                | £ 2 572                |
| Actions émises en circulation                          | 215                            | 216                    | 236                    |
| VNI par action                                         | £ 11,22                        | £ 11,16                | £ 10,88                |
| Institutions en GBP (couverte) :                       |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | £ 313 866                      | £ 210 016              | £ 246 287              |
| Actions émises en circulation                          | 12 704                         | 8 555                  | 10 706                 |
| VNI par action                                         | £ 24,71                        | £ 24,55                | £ 23,00                |
| Distribution                                           | £ 104 702                      | £ 97 146               | £ 120 734              |
| Actions émises en circulation                          | 8 213                          | 7 511                  | 9 560                  |
| VNI par action                                         | £ 12,75                        | £ 12,93                | £ 12,63                |
| Institutions en NOK (couverte) :                       |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | NOK 2 638 906                  | NOK 2 717 775          | NOK 2 452 611          |
| Actions émises en circulation                          | 10 942                         | 11 345                 | 10 933                 |
| VNI par action                                         | NOK 241,16                     | NOK 239,56             | NOK 224,34             |
| Institutions en NZD (couverte) :                       |                                |                        |                        |
| Distribution                                           | NZD 83 803                     | NZD 95 957             | NZD 95 661             |
| Actions émises en circulation                          | 1 989                          | 2 226                  | 2 253                  |
| VNI par action                                         | NZD 42,13                      | NZD 43,12              | NZD 42,47              |
| Institutions en RMB (non couverte) :                   |                                |                        |                        |
| Distribution                                           | CNH 74                         | CNH 75                 | CNH 74                 |
| Actions émises en circulation                          | 1                              | 1                      | 1                      |
| VNI par action                                         | CNH 96,64                      | CNH 100,75             | CNH 103,32             |
| Institutions en SEK (couverte) :                       |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | SEK 392 760                    | SEK 412 144            | SEK 441 453            |
| Actions émises en circulation                          | 1 783                          | 1 864                  | 2 085                  |
| VNI par action                                         | SEK 220,26                     | SEK 221,12             | SEK 211,74             |
| Institutions en SGD (couverte) :                       |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | SGD 1 412 843                  | SGD 1 161 298          | SGD 882 913            |
| Actions émises en circulation                          | 73 079                         | 59 696                 | 47 347                 |
| VNI par action                                         | SGD 19,33                      | SGD 19,45              | SGD 18,65              |
| Distribution                                           | O/S                            | O/S                    | SGD 143                |
| Actions émises en circulation                          | O/S                            | O/S                    | 14                     |
| VNI par action                                         | O/S                            | O/S                    | SGD 10,17              |
| Investisseurs :                                        |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | \$ 157 539                     | \$ 164 528             | \$ 223 988             |
| Actions émises en circulation                          | 4 525                          | 4 749                  | 6 878                  |
| VNI par action                                         | \$ 34,82                       | \$ 34,64               | \$ 32,57               |
| Distribution                                           | \$ 32 191                      | \$ 40 326              | \$ 61 677              |
| Actions émises en circulation                          | 2 049                          | 2 533                  | 3 971                  |
| VNI par action                                         | \$ 15,71                       | \$ 15,92               | \$ 15,53               |
| Investisseurs en CHF (couverte) :                      |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                         | CHF 9 636                      | CHF 5 768              | CHF 97 065             |
| Actions émises en circulation                          | 813                            | 479                    | 8 217                  |
| VNI par action                                         | CHF 11,85                      | CHF 12,03              | CHF 11,81              |



|                                                   | Fonds Global Bond Fund (suite) |                        |                        |
|---------------------------------------------------|--------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                   | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
| Investisseurs en EUR (couverte) :                 |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | € 77 731                       | € 89 214               | € 87 352               |
| Actions émises en circulation                     | 2 946                          | 3 368                  | 3 435                  |
| VNI par action                                    | € 26,39                        | € 26,49                | € 25,43                |
| Investisseurs en GBP (couverte) :                 |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | £ 7 002                        | £ 10 375               | £ 9 062                |
| Actions émises en circulation                     | 305                            | 454                    | 422                    |
| VNI par action                                    | £ 22,96                        | £ 22,85                | £ 21,49                |
| Investisseurs en NOK (couverte) :                 |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | NOK 45 754                     | NOK 52 969             | NOK 56 086             |
| Actions émises en circulation                     | 204                            | 237                    | 267                    |
| VNI par action                                    | NOK 224,81                     | NOK 223,70             | NOK 210,22             |
| Administrations :                                 |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 27 007                      | \$ 23 037              | \$ 14 351              |
| Actions émises en circulation                     | 802                            | 687                    | 455                    |
| VNI par action                                    | \$ 33,68                       | \$ 33,54               | \$ 31,57               |
| Administrations en SEK (couverte) :               |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | SEK 28 172                     | SEK 33 839             | SEK 60 541             |
| Actions émises en circulation                     | 297                            | 354                    | 658                    |
| VNI par action                                    | SEK 94,98                      | SEK 95,58              | SEK 91,99              |
| Catégorie E :                                     |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 313 561                     | \$ 352 126             | \$ 376 135             |
| Actions émises en circulation                     | 9 844                          | 11 081                 | 12 523                 |
| VNI par action                                    | \$ 31,85                       | \$ 31,78               | \$ 30,04               |
| Distribution                                      | \$ 113 128                     | \$ 125 345             | \$ 144 043             |
| Actions émises en circulation                     | 8 376                          | 9 155                  | 10 788                 |
| VNI par action                                    | \$ 13,51                       | \$ 13,69               | \$ 13,35               |
| Catégorie E (exposition au risque de change) :    |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 32 231                      | \$ 33 979              | \$ 35 147              |
| Actions émises en circulation                     | 2 475                          | 2 579                  | 2 911                  |
| VNI par action                                    | \$ 13,02                       | \$ 13,18               | \$ 12,07               |
| Distribution                                      | \$ 13 548                      | \$ 15 930              | \$ 17 691              |
| Actions émises en circulation                     | 1 336                          | 1 527                  | 1 794                  |
| VNI par action                                    | \$ 10,14                       | \$ 10,43               | \$ 9,86                |
| Catégorie E en CHF (couverte) :                   |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | CHF 1 850                      | CHF 2 254              | CHF 2 435              |
| Actions émises en circulation                     | 206                            | 246                    | 269                    |
| VNI par action                                    | CHF 8,99                       | CHF 9,15               | CHF 9,04               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                   |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | € 479 747                      | € 556 472              | € 637 289              |
| Actions émises en circulation                     | 20 256                         | 23 339                 | 27 695                 |
| VNI par action                                    | € 23,68                        | € 23,84                | € 23,01                |
| Distribution                                      | € 34 144                       | € 38 095               | € 38 813               |
| Actions émises en circulation                     | 3 918                          | 4 272                  | 4 373                  |
| VNI par action                                    | € 8,72                         | € 8,92                 | € 8,88                 |
| G Détail en EUR (couverte) :                      |                                |                        |                        |
| Distribution                                      | € 74 520                       | € 82 827               | € 94 897               |
| Actions émises en circulation                     | 8 340                          | 9 208                  | 10 606                 |
| VNI par action                                    | € 8,94                         | € 9,00                 | € 8,95                 |
| H Institutions :                                  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 907 115                     | \$ 853 294             | \$ 687 222             |
| Actions émises en circulation                     | 24 652                         | 23 327                 | 20 022                 |
| VNI par action                                    | \$ 36,80                       | \$ 36,58               | \$ 34,32               |
| Distribution                                      | \$ 816                         | \$ 1 973               | \$ 1 974               |
| Actions émises en circulation                     | 86                             | 206                    | 212                    |
| VNI par action                                    | \$ 9,44                        | \$ 9,57                | \$ 9,33                |
| H Institutions (exposition au risque de change) : |                                |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 112 467                     | \$ 237 743             | \$ 22 113              |
| Actions émises en circulation                     | 11 937                         | 25 022                 | 2 558                  |
| VNI par action                                    | \$ 9,42                        | \$ 9,50                | \$ 8,64                |
| M Détail :                                        |                                |                        |                        |
| Distribution II                                   | \$ 722                         | \$ 1 111               | \$ 838                 |
| Actions émises en circulation                     | 80                             | 120                    | 91                     |
| VNI par action                                    | \$ 9,08                        | \$ 9,27                | \$ 9,16                |

|                                  | Fonds Global Bond Fund (suite) |                        |                        |
|----------------------------------|--------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Au<br>30 juin 2026             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
| M Détail en HKD (non couverte) : |                                |                        |                        |
| Distribution II                  | HKD 15 936                     | HKD 17 936             | HKD 18 218             |
| Actions émises en circulation    | 1 744                          | 1 938                  | 1 994                  |
| VNI par action                   | HKD 9,14                       | HKD 9,26               | HKD 9,13               |
| M Détail en SGD (couverte) :     |                                |                        |                        |
| Distribution II                  | SGD 116 699                    | SGD 97 663             | SGD 33 083             |
| Actions émises en circulation    | 12 329                         | 9 980                  | 3 341                  |
| VNI par action                   | SGD 9,47                       | SGD 9,79               | SGD 9,90               |
| Catégorie R en EUR (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 6 281                        | € 6 020                | € 6 875                |
| Actions émises en circulation    | 532                            | 508                    | 605                    |
| VNI par action                   | € 11,80                        | € 11,84                | € 11,36                |
| Catégorie T :                    |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 11 897                      | \$ 13 496              | \$ 16 840              |
| Actions émises en circulation    | 966                            | 1 097                  | 1 444                  |
| VNI par action                   | \$ 12,32                       | \$ 12,31               | \$ 11,67               |
| Distribution                     | \$ 4 072                       | \$ 4 879               | \$ 5 021               |
| Actions émises en circulation    | 378                            | 447                    | 472                    |
| VNI par action                   | \$ 10,77                       | \$ 10,91               | \$ 10,64               |
| Catégorie T en EUR (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 19 841                       | € 23 586               | € 24 726               |
| Actions émises en circulation    | 1 973                          | 2 327                  | 2 520                  |
| VNI par action                   | € 10,05                        | € 10,14                | € 9,81                 |
| Catégorie W :                    |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 140 394                     | \$ 140 655             | \$ 145 178             |
| Actions émises en circulation    | 12 907                         | 13 025                 | 14 367                 |
| VNI par action                   | \$ 10,88                       | \$ 10,80               | \$ 10,10               |
| Distribution                     | \$ 67 002                      | \$ 56 595              | \$ 60 726              |
| Actions émises en circulation    | 7 271                          | 6 059                  | 6 666                  |
| VNI par action                   | \$ 9,22                        | \$ 9,34                | \$ 9,11                |
| Distribution II                  | \$ 3 920                       | \$ 8 566               | \$ 3 246               |
| Actions émises en circulation    | 374                            | 804                    | 311                    |
| VNI par action                   | \$ 10,49                       | \$ 10,65               | \$ 10,43               |
| Catégorie W en CHF (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | CHF 33 831                     | CHF 35 967             | CHF 37 669             |
| Actions émises en circulation    | 3 766                          | 3 951                  | 4 234                  |
| VNI par action                   | CHF 8,98                       | CHF 9,10               | CHF 8,90               |
| Distribution                     | CHF 5 514                      | CHF 7 662              | CHF 7 574              |
| Actions émises en circulation    | 725                            | 973                    | 945                    |
| VNI par action                   | CHF 7,60                       | CHF 7,87               | CHF 8,01               |
| Catégorie W en EUR (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 81 225                       | € 76 634               | € 55 338               |
| Actions émises en circulation    | 8 269                          | 7 789                  | 5 886                  |
| VNI par action                   | € 9,82                         | € 9,84                 | € 9,40                 |
| Distribution                     | € 4 210                        | € 4 627                | € 5 564                |
| Actions émises en circulation    | 506                            | 543                    | 656                    |
| VNI par action                   | € 8,32                         | € 8,52                 | € 8,48                 |
| Catégorie W en GBP (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | £ 19 720                       | £ 20 907               | £ 16 645               |
| Actions émises en circulation    | 1 852                          | 1 977                  | 1 682                  |
| VNI par action                   | £ 10,65                        | £ 10,57                | £ 9,90                 |
| Distribution                     | £ 8 821                        | £ 12 155               | £ 11 968               |
| Actions émises en circulation    | 978                            | 1 328                  | 1 341                  |
| VNI par action                   | £ 9,02                         | £ 9,15                 | £ 8,92                 |
| Catégorie W en NOK (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | NOK 7 922                      | NOK 6 991              | NOK 9 482              |
| Actions émises en circulation    | 76                             | 68                     | 98                     |
| VNI par action                   | NOK 104,16                     | NOK 103,42             | NOK 96,75              |
| Catégorie W en SGD (couverte) :  |                                |                        |                        |
| Distribution II                  | SGD 12 628                     | SGD 14 785             | SGD 17 871             |
| Actions émises en circulation    | 1 289                          | 1 466                  | 1 769                  |
| VNI par action                   | SGD 9,80                       | SGD 10,09              | SGD 10,10              |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                                        | Fonds Global Bond ESG Fund |                        |                        |
|--------------------------------------------------------|----------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                        | Au<br>30 juin 2026         | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
| Actif net                                              | \$ 3 883 563               | \$ 4 125 766           | \$ 3 964 473           |
| Institutions :                                         |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | \$ 214 544                 | \$ 258 179             | \$ 579 646             |
| Actions émises en circulation                          | 16 914                     | 20 478                 | 49 098                 |
| VNI par action                                         | \$ 12,68                   | \$ 12,61               | \$ 11,81               |
| Distribution                                           | \$ 10 984                  | \$ 29 602              | \$ 40 771              |
| Actions émises en circulation                          | 1 126                      | 2 996                  | 4 245                  |
| VNI par action                                         | \$ 9,75                    | \$ 9,88                | \$ 9,60                |
| Institutions en AUD (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | AUD 23 480                 | AUD 23 338             | O/S                    |
| Actions émises en circulation                          | 2 196                      | 2 196                  | O/S                    |
| VNI par action                                         | AUD 10,69                  | AUD 10,63              | O/S                    |
| Institutions en CHF (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | CHF 1 008 617              | CHF 916 725            | CHF 735 914            |
| Actions émises en circulation                          | 106 612                    | 95 520                 | 78 387                 |
| VNI par action                                         | CHF 9,46                   | CHF 9,60               | CHF 9,39               |
| Institutions en EUR (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | € 858 737                  | € 1 047 732            | € 978 456              |
| Actions émises en circulation                          | 81 689                     | 99 367                 | 97 074                 |
| VNI par action                                         | € 10,51                    | € 10,54                | € 10,08                |
| Distribution                                           | € 32 843                   | € 34 397               | € 41 698               |
| Actions émises en circulation                          | 3 796                      | 3 886                  | 4 749                  |
| VNI par action                                         | € 8,65                     | € 8,85                 | € 8,78                 |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change) : |                            |                        |                        |
| Distribution                                           | £ 1 176                    | £ 1 331                | £ 24 153               |
| Actions émises en circulation                          | 140                        | 149                    | 2 637                  |
| VNI par action                                         | £ 8,43                     | £ 8,96                 | £ 9,16                 |
| Institutions en GBP (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | £ 5 743                    | £ 14 448               | £ 161 745              |
| Actions émises en circulation                          | 537                        | 1 357                  | 16 225                 |
| VNI par action                                         | £ 10,70                    | £ 10,64                | £ 9,97                 |
| Distribution                                           | £ 89 885                   | £ 94 666               | £ 112 981              |
| Actions émises en circulation                          | 9 399                      | 9 762                  | 11 983                 |
| VNI par action                                         | £ 9,56                     | £ 9,70                 | £ 9,43                 |
| Institutions en GBP (non couverte) :                   |                            |                        |                        |
| Distribution                                           | £ 3 385                    | £ 795                  | £ 9 484                |
| Actions émises en circulation                          | 381                        | 89                     | 1 013                  |
| VNI par action                                         | £ 8,88                     | £ 8,96                 | £ 9,36                 |
| Institutions en NOK (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | NOK 7 135 501              | NOK 7 321 451          | NOK 6 806 984          |
| Actions émises en circulation                          | 605 875                    | 625 410                | 621 090                |
| VNI par action                                         | NOK 11,78                  | NOK 11,71              | NOK 10,96              |
| Institutions en NZD (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Distribution                                           | NZD 49 784                 | NZD 47 739             | NZD 60 358             |
| Actions émises en circulation                          | 4 974                      | 4 667                  | 6 010                  |
| VNI par action                                         | NZD 10,01                  | NZD 10,23              | NZD 10,04              |
| Institutions en SEK (couverte) :                       |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | SEK 310 120                | SEK 299 428            | SEK 425 576            |
| Actions émises en circulation                          | 3 203                      | 3 079                  | 4 570                  |
| VNI par action                                         | SEK 96,82                  | SEK 97,26              | SEK 93,12              |
| Investisseurs :                                        |                            |                        |                        |
| Capitalisation                                         | \$ 3 292                   | \$ 3 897               | \$ 5 562               |
| Actions émises en circulation                          | 275                        | 327                    | 497                    |
| VNI par action                                         | \$ 11,95                   | \$ 11,90               | \$ 11,19               |

|                                                 | Fonds Global Bond ESG Fund (suite) |                        |                        |
|-------------------------------------------------|------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                 | Au<br>30 juin 2026                 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
| Administrations en SEK (couverte) :             |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | SEK 199 743                        | SEK 221 421            | SEK 165 604            |
| Actions émises en circulation                   | 1 853                              | 2 039                  | 1 585                  |
| VNI par action                                  | SEK 107,82                         | SEK 108,59             | SEK 104,48             |
| Catégorie E :                                   |                                    |                        |                        |
| Distribution                                    | \$ 5 850                           | \$ 5 619               | \$ 4 197               |
| Actions émises en circulation                   | 579                                | 548                    | 421                    |
| VNI par action                                  | \$ 10,11                           | \$ 10,24               | \$ 9,96                |
| Catégorie E en CHF (couverte) :                 |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | CHF 5 266                          | CHF 4 610              | CHF 3 533              |
| Actions émises en circulation                   | 546                                | 469                    | 364                    |
| VNI par action                                  | CHF 9,65                           | CHF 9,84               | CHF 9,71               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                 |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | € 33 481                           | € 37 327               | € 38 281               |
| Actions émises en circulation                   | 3 460                              | 3 828                  | 4 070                  |
| VNI par action                                  | € 9,68                             | € 9,75                 | € 9,40                 |
| Catégorie Z en AUD (couverte) :                 |                                    |                        |                        |
| Distribution                                    | AUD 552 880                        | AUD 563 560            | AUD 564 460            |
| Actions émises en circulation                   | 55 978                             | 56 289                 | 57 806                 |
| VNI par action                                  | AUD 9,88                           | AUD 10,01              | AUD 9,76               |
| Actif net                                       | \$ 1 061 891                       | \$ 1 028 005           | \$ 1 096 286           |
| Institutions :                                  |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 554 971                         | \$ 554 714             | \$ 587 687             |
| Actions émises en circulation                   | 20 312                             | 20 490                 | 22 704                 |
| VNI par action                                  | \$ 27,32                           | \$ 27,07               | \$ 25,89               |
| Distribution                                    | \$ 94 372                          | \$ 86 231              | \$ 71 993              |
| Actions émises en circulation                   | 5 853                              | 5 294                  | 4 442                  |
| VNI par action                                  | \$ 16,12                           | \$ 16,29               | \$ 16,21               |
| Institutions (exposition au risque de change) : |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 73 662                          | \$ 67 312              | O/S                    |
| Actions émises en circulation                   | 7 381                              | 6 636                  | O/S                    |
| VNI par action                                  | \$ 9,98                            | \$ 10,14               | O/S                    |
| Institutions en EUR (couverte) :                |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | € 31 932                           | € 24 683               | € 22 739               |
| Actions émises en circulation                   | 1 745                              | 1 349                  | 1 273                  |
| VNI par action                                  | € 18,30                            | € 18,29                | € 17,86                |
| Investisseurs :                                 |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 5 907                           | \$ 6 683               | \$ 6 424               |
| Actions émises en circulation                   | 232                                | 265                    | 265                    |
| VNI par action                                  | \$ 25,43                           | \$ 25,24               | \$ 24,22               |
| Administrations :                               |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 8 584                           | \$ 8 627               | \$ 10 660              |
| Actions émises en circulation                   | 350                                | 354                    | 456                    |
| VNI par action                                  | \$ 24,50                           | \$ 24,34               | \$ 23,39               |
| Catégorie E :                                   |                                    |                        |                        |
| Distribution                                    | \$ 14 010                          | \$ 23 035              | \$ 40 100              |
| Actions émises en circulation                   | 895                                | 1 456                  | 2 548                  |
| VNI par action                                  | \$ 15,66                           | \$ 15,82               | \$ 15,74               |
| Catégorie E (exposition au risque de change) :  |                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 10                              | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                   | 1                                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                  | \$ 10,10                           | O/S                    | O/S                    |

|                                                   | Au<br>30 juin 2026                   | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|---------------------------------------------------|--------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                   | Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite) |                        |                        |
| Distribution                                      | \$ 10 968                            | \$ 7 963               | \$ 30 683              |
| Actions émises en circulation                     | 1 362                                | 954                    | 3 914                  |
| VNI par action                                    | \$ 8,05                              | \$ 8,35                | \$ 7,84                |
| H Institutions :                                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 126 170                           | \$ 115 781             | \$ 133 385             |
| Actions émises en circulation                     | 10 323                               | 9 556                  | 11 495                 |
| VNI par action                                    | \$ 12,22                             | \$ 12,12               | \$ 11,60               |
| H Institutions (exposition au risque de change) : |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 6 558                             | \$ 10                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 667                                  | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                                    | \$ 9,83                              | \$ 10,01               | O/S                    |
| Catégorie Z :                                     |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 130 171                           | \$ 128 661             | \$ 191 808             |
| Actions émises en circulation                     | 10 957                               | 10 957                 | 17 167                 |
| VNI par action                                    | \$ 11,88                             | \$ 11,74               | \$ 11,17               |
|                                                   | Fonds Global Bond Opportunities Fund |                        |                        |
| Actif net                                         | \$ 14 901                            | O/S                    | O/S                    |
| Institutions :                                    |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 2 506                             | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 248                                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | \$ 10,10                             | O/S                    | O/S                    |
| Institutions (exposition au risque de change) :   |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 1 002                             | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 100                                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | \$ 10,02                             | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en CHF (couverte) :                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | CHF 196                              | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 19                                   | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | CHF 10,06                            | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en EUR (couverte) :                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | € 9                                  | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 1                                    | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | € 10,10                              | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en GBP (couverte) :                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | £ 178                                | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 18                                   | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | £ 10,11                              | O/S                    | O/S                    |
| Distribution                                      | £ 7                                  | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 1                                    | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | £ 10,11                              | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en NOK (couverte) :                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | NOK 2 318                            | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 23                                   | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | NOK 100,61                           | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en SEK (couverte) :                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | SEK 2 319                            | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 23                                   | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | SEK 100,49                           | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en SGD (couverte) :                  |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | SGD 319                              | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 32                                   | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | SGD 10,06                            | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie E :                                     |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 10                                | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 1                                    | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | \$ 10,10                             | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                   |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | € 206                                | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 20                                   | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | € 10,09                              | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie Z :                                     |                                      |                        |                        |
| Capitalisation                                    | \$ 9 929                             | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation                     | 982                                  | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                                    | \$ 10,11                             | O/S                    | O/S                    |

|                                   | Au<br>30 juin 2026                | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                   | Fonds Global High Yield Bond Fund |                        |                        |
| Actif net                         | \$ 2 417 657                      | \$ 2 867 321           | \$ 2 868 819           |
| Institutions :                    |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 498 491                        | \$ 569 278             | \$ 614 526             |
| Actions émises en circulation     | 14 396                            | 16 687                 | 19 485                 |
| VNI par action                    | \$ 34,63                          | \$ 34,11               | \$ 31,54               |
| Distribution                      | \$ 105 362                        | \$ 112 748             | \$ 250 283             |
| Actions émises en circulation     | 9 852                             | 10 388                 | 23 503                 |
| VNI par action                    | \$ 10,69                          | \$ 10,85               | \$ 10,65               |
| Institutions en CHF (couverte) :  |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | CHF 17 525                        | CHF 18 533             | CHF 28 390             |
| Actions émises en circulation     | 956                               | 1 005                  | 1 596                  |
| VNI par action                    | CHF 18,33                         | CHF 18,43              | CHF 17,79              |
| Distribution                      | CHF 5 446                         | CHF 5 642              | CHF 4 994              |
| Actions émises en circulation     | 778                               | 777                    | 672                    |
| VNI par action                    | CHF 7,00                          | CHF 7,26               | CHF 7,43               |
| Institutions en EUR (couverte) :  |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 475 917                         | € 441 033              | € 547 812              |
| Actions émises en circulation     | 17 160                            | 15 996                 | 21 055                 |
| VNI par action                    | € 27,74                           | € 27,57                | € 26,02                |
| Distribution                      | € 274 433                         | € 277 012              | € 226 032              |
| Actions émises en circulation     | 27 392                            | 26 975                 | 22 005                 |
| VNI par action                    | € 10,02                           | € 10,27                | € 10,27                |
| Institutions en GBP (couverte) :  |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | £ 121 951                         | £ 115 406              | £ 61 412               |
| Actions émises en circulation     | 6 280                             | 6 027                  | 3 466                  |
| VNI par action                    | £ 19,42                           | £ 19,15                | £ 17,72                |
| Distribution                      | £ 47 156                          | £ 292 935              | £ 255 038              |
| Actions émises en circulation     | 8 878                             | 54 288                 | 48 078                 |
| VNI par action                    | £ 5,31                            | £ 5,40                 | £ 5,30                 |
| Investisseurs :                   |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 5 114                          | \$ 4 493               | \$ 4 005               |
| Actions émises en circulation     | 318                               | 283                    | 272                    |
| VNI par action                    | \$ 16,08                          | \$ 15,87               | \$ 14,73               |
| Distribution                      | O/S                               | O/S                    | \$ 12                  |
| Actions émises en circulation     | O/S                               | O/S                    | 1                      |
| VNI par action                    | O/S                               | O/S                    | \$ 10,89               |
| Investisseurs en EUR (couverte) : |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 2 499                           | € 2 276                | € 2 296                |
| Actions émises en circulation     | 95                                | 87                     | 93                     |
| VNI par action                    | € 26,27                           | € 26,16                | € 24,77                |
| Administrations :                 |                                   |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 20 854                         | \$ 27 243              | \$ 26 904              |
| Actions émises en circulation     | 658                               | 870                    | 925                    |
| VNI par action                    | \$ 31,68                          | \$ 31,29               | \$ 29,07               |
| Distribution                      | \$ 17 492                         | \$ 15 681              | \$ 16 643              |
| Actions émises en circulation     | 1 671                             | 1 476                  | 1 597                  |
| VNI par action                    | \$ 10,47                          | \$ 10,62               | \$ 10,42               |
| BM Détail :                       |                                   |                        |                        |
| Décumulation                      | \$ 494                            | \$ 10                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 52                                | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                    | \$ 9,45                           | \$ 9,88                | O/S                    |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                     | Au<br>30 juin 2026                        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds Global High Yield Bond Fund (suite) |                        |                        |
| Distribution II                     | \$ 28 732                                 | \$ 30 841              | \$ 27 706              |
| Actions émises en circulation       | 3 059                                     | 3 197                  | 2 856                  |
| VNI par action                      | \$ 9,39                                   | \$ 9,65                | \$ 9,70                |
| Catégorie E :                       |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 136 556                                | \$ 144 965             | \$ 137 990             |
| Actions émises en circulation       | 4 711                                     | 5 054                  | 5 158                  |
| VNI par action                      | \$ 28,98                                  | \$ 28,68               | \$ 26,76               |
| Distribution                        | \$ 63 779                                 | \$ 69 205              | \$ 71 937              |
| Actions émises en circulation       | 6 053                                     | 6 471                  | 6 857                  |
| VNI par action                      | \$ 10,54                                  | \$ 10,69               | \$ 10,49               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 180 228                                 | € 191 532              | € 205 795              |
| Actions émises en circulation       | 6 911                                     | 7 355                  | 8 299                  |
| VNI par action                      | € 26,08                                   | € 26,04                | € 24,80                |
| Distribution                        | € 22 474                                  | € 23 903               | € 24 418               |
| Actions émises en circulation       | 2 744                                     | 2 848                  | 2 908                  |
| VNI par action                      | € 8,19                                    | € 8,39                 | € 8,40                 |
| Catégorie E en USD (non couverte) : |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 407                                     | € 108                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 39                                        | 11                     | O/S                    |
| VNI par action                      | € 10,56                                   | € 10,17                | O/S                    |
| Distribution                        | € 791                                     | € 461                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 78                                        | 46                     | O/S                    |
| VNI par action                      | € 10,15                                   | € 10,03                | O/S                    |
| Catégorie E en GBP (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Distribution                        | £ 1 710                                   | £ 1 930                | £ 3 422                |
| Actions émises en circulation       | 152                                       | 169                    | 305                    |
| VNI par action                      | £ 11,24                                   | £ 11,42                | £ 11,20                |
| Catégorie E en SGD (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 48 026                                | SGD 19 705             | SGD 14 356             |
| Actions émises en circulation       | 5 227                                     | 2 086                  | 1 516                  |
| VNI par action                      | SGD 9,19                                  | SGD 9,44               | SGD 9,47               |
| H Institutions :                    |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 99 294                                 | \$ 107 970             | \$ 141 380             |
| Actions émises en circulation       | 3 002                                     | 3 310                  | 4 681                  |
| VNI par action                      | \$ 33,08                                  | \$ 32,62               | \$ 30,20               |
| Distribution                        | \$ 9 987                                  | \$ 19 420              | \$ 10 288              |
| Actions émises en circulation       | 1 053                                     | 2 019                  | 1 090                  |
| VNI par action                      | \$ 9,48                                   | \$ 9,62                | \$ 9,44                |
| M Détail :                          |                                           |                        |                        |
| Décumulation                        | \$ 10                                     | \$ 10                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 1                                         | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                      | \$ 9,53                                   | \$ 9,91                | O/S                    |
| Distribution                        | \$ 13 830                                 | \$ 14 654              | \$ 16 073              |
| Actions émises en circulation       | 1 330                                     | 1 389                  | 1 553                  |
| VNI par action                      | \$ 10,40                                  | \$ 10,55               | \$ 10,35               |
| Distribution II                     | \$ 24 468                                 | \$ 45 301              | \$ 49 841              |
| Actions émises en circulation       | 3 067                                     | 5 557                  | 6 144                  |
| VNI par action                      | \$ 7,98                                   | \$ 8,15                | \$ 8,11                |
| Catégorie R :                       |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 1 346                                  | \$ 1 929               | \$ 2 126               |
| Actions émises en circulation       | 71                                        | 104                    | 123                    |
| VNI par action                      | \$ 18,86                                  | \$ 18,60               | \$ 17,24               |
| Catégorie T :                       |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 5 673                                  | \$ 6 231               | \$ 7 201               |
| Actions émises en circulation       | 373                                       | 413                    | 509                    |
| VNI par action                      | \$ 15,22                                  | \$ 15,09               | \$ 14,13               |
| Distribution                        | O/S                                       | O/S                    | \$ 1 857               |
| Actions émises en circulation       | O/S                                       | O/S                    | 190                    |
| VNI par action                      | O/S                                       | O/S                    | \$ 9,77                |

|                                                 | Au<br>30 juin 2026                        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                 | Fonds Global High Yield Bond ESG Fund     |                        |                        |
| Actif net                                       | \$ 27 031                                 | \$ 26 735              | \$ 10 456              |
| Institutions :                                  |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 10 526                                 | \$ 10 408              | \$ 9 653               |
| Actions émises en circulation                   | 921                                       | 921                    | 921                    |
| VNI par action                                  | \$ 11,43                                  | \$ 11,30               | \$ 10,48               |
| Institutions en EUR (couverte) :                |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | € 256                                     | € 255                  | € 242                  |
| Actions émises en circulation                   | 23                                        | 23                     | 23                     |
| VNI par action                                  | € 10,99                                   | € 10,97                | € 10,38                |
| Institutions en GBP (couverte) :                |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | £ 227                                     | £ 224                  | £ 208                  |
| Actions émises en circulation                   | 20                                        | 20                     | 20                     |
| VNI par action                                  | £ 11,40                                   | £ 11,28                | £ 10,47                |
| Institutions en SEK (couverte) :                |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | SEK 2 925                                 | SEK 2 924              | SEK 2 773              |
| Actions émises en circulation                   | 27                                        | 27                     | 27                     |
| VNI par action                                  | SEK 108,87                                | SEK 108,82             | SEK 103,21             |
| Catégorie E :                                   |                                           |                        |                        |
| Distribution                                    | \$ 11                                     | \$ 11                  | \$ 10                  |
| Actions émises en circulation                   | 1                                         | 1                      | 1                      |
| VNI par action                                  | \$ 10,17                                  | \$ 10,35               | \$ 10,17               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                 |                                           |                        |                        |
| Distribution                                    | € 10                                      | € 25                   | € 10                   |
| Actions émises en circulation                   | 1                                         | 2                      | 1                      |
| VNI par action                                  | € 9,78                                    | € 10,05                | € 10,07                |
| Catégorie E en GBP (couverte) :                 |                                           |                        |                        |
| Distribution                                    | £ 9                                       | £ 9                    | £ 8                    |
| Actions émises en circulation                   | 1                                         | 1                      | 1                      |
| VNI par action                                  | £ 10,14                                   | £ 10,33                | £ 10,15                |
| Catégorie Z :                                   |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 15 575                                 | \$ 15 356              | \$ 11                  |
| Actions émises en circulation                   | 1 346                                     | 1 347                  | 1                      |
| VNI par action                                  | \$ 11,57                                  | \$ 11,41               | \$ 10,51               |
|                                                 | Fonds Global Investment Grade Credit Fund |                        |                        |
| Actif net                                       | \$ 7 396 140                              | \$ 7 863 675           | \$ 8 618 950           |
| Institutions :                                  |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 1 797 527                              | \$ 1 909 115           | \$ 2 085 815           |
| Actions émises en circulation                   | 77 511                                    | 83 591                 | 98 150                 |
| VNI par action                                  | \$ 23,19                                  | \$ 22,84               | \$ 21,25               |
| Distribution                                    | \$ 420 404                                | \$ 494 877             | \$ 526 458             |
| Actions émises en circulation                   | 36 202                                    | 42 284                 | 46 279                 |
| VNI par action                                  | \$ 11,61                                  | \$ 11,70               | \$ 11,38               |
| Institutions (exposition au risque de change) : |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 144 618                                | \$ 155 301             | \$ 123 221             |
| Actions émises en circulation                   | 8 555                                     | 9 221                  | 8 131                  |
| VNI par action                                  | \$ 16,90                                  | \$ 16,84               | \$ 15,16               |
| Distribution                                    | \$ 10 941                                 | \$ 12 234              | \$ 12 177              |
| Actions émises en circulation                   | 1 276                                     | 1 398                  | 1 481                  |
| VNI par action                                  | \$ 8,58                                   | \$ 8,75                | \$ 8,22                |

|                                                        |     | Au<br>30 juin 2026                                   |     | Au<br>31 décembre 2025 |     | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------------------------|-----|------------------------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|
|                                                        |     | Fonds Global Investment Grade Credit<br>Fund (suite) |     |                        |     |                        |
| Institutions en AUD (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                                           | AUD | 4 402                                                | AUD | 3 036                  | AUD | 3 480                  |
| Actions émises en circulation                          |     | 491                                                  |     | 336                    |     | 395                    |
| VNI par action                                         | AUD | 8,96                                                 | AUD | 9,04                   | AUD | 8,81                   |
| Institutions en CHF (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | CHF | 303 424                                              | CHF | 326 670                | CHF | 467 528                |
| Actions émises en circulation                          |     | 19 161                                               |     | 20 518                 |     | 30 208                 |
| VNI par action                                         | CHF | 15,84                                                | CHF | 15,92                  | CHF | 15,48                  |
| Distribution                                           | CHF | 23 483                                               | CHF | 25 332                 | CHF | 28 641                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 3 530                                                |     | 3 698                  |     | 4 120                  |
| VNI par action                                         | CHF | 6,65                                                 | CHF | 6,85                   | CHF | 6,95                   |
| Institutions en CZK (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                                           | CZK | 183 095                                              | CZK | 185 233                | CZK | 186 294                |
| Actions émises en circulation                          |     | 20 735                                               |     | 20 735                 |     | 21 305                 |
| VNI par action                                         | CZK | 8,83                                                 | CZK | 8,93                   | CZK | 8,74                   |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | €   | 58 846                                               | €   | 56 534                 | €   | 53 067                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 3 981                                                |     | 3 943                  |     | 3 626                  |
| VNI par action                                         | €   | 14,78                                                | €   | 14,34                  | €   | 14,64                  |
| Institutions en EUR (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | €   | 587 068                                              | €   | 659 821                | €   | 886 073                |
| Actions émises en circulation                          |     | 30 047                                               |     | 33 981                 |     | 48 038                 |
| VNI par action                                         | €   | 19,54                                                | €   | 19,42                  | €   | 18,45                  |
| Distribution                                           | €   | 268 473                                              | €   | 275 083                | €   | 345 966                |
| Actions émises en circulation                          |     | 28 215                                               |     | 28 402                 |     | 36 026                 |
| VNI par action                                         | €   | 9,52                                                 | €   | 9,69                   | €   | 9,60                   |
| Institutions en GBP (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | £   | 106 307                                              | £   | 62 430                 | £   | 120 135                |
| Actions émises en circulation                          |     | 4 615                                                |     | 2 750                  |     | 5 686                  |
| VNI par action                                         | £   | 23,03                                                | £   | 22,70                  | £   | 21,13                  |
| Distribution                                           | £   | 302 533                                              | £   | 310 181                | £   | 580 490                |
| Actions émises en circulation                          |     | 25 843                                               |     | 26 252                 |     | 50 498                 |
| VNI par action                                         | £   | 11,71                                                | £   | 11,82                  | £   | 11,50                  |
| Institutions en HKD (non couverte) :                   |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                                           | HKD | 34 823                                               | HKD | 11 463                 | HKD | 82 078                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 3 371                                                |     | 1 110                  |     | 8 191                  |
| VNI par action                                         | HKD | 10,33                                                | HKD | 10,33                  | HKD | 10,02                  |
| Institutions en NOK (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | NOK | 297 159                                              | NOK | 297 842                | NOK | 292 087                |
| Actions émises en circulation                          |     | 1 836                                                |     | 1 869                  |     | 1 970                  |
| VNI par action                                         | NOK | 161,81                                               | NOK | 159,36                 | NOK | 148,24                 |
| Institutions en SEK (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                                         | SEK | 2 169 344                                            | SEK | 2 291 913              | SEK | 2 577 248              |
| Actions émises en circulation                          |     | 130 748                                              |     | 138 716                |     | 163 987                |
| VNI par action                                         | SEK | 16,59                                                | SEK | 16,52                  | SEK | 15,72                  |
| Institutions en SGD (couverte) :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                                           | SGD | 137 186                                              | SGD | 89 524                 | SGD | 50 838                 |
| Actions émises en circulation                          |     | 15 535                                               |     | 9 922                  |     | 5 668                  |
| VNI par action                                         | SGD | 8,83                                                 | SGD | 9,02                   | SGD | 8,97                   |

|                                         |     | Au<br>30 juin 2026                                   |     | Au<br>31 décembre 2025 |     | Au<br>31 décembre 2024 |
|-----------------------------------------|-----|------------------------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|
|                                         |     | Fonds Global Investment Grade Credit<br>Fund (suite) |     |                        |     |                        |
| Investisseurs :                         |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                          | \$  | 220 104                                              | \$  | 230 496                | \$  | 287 174                |
| Actions émises en circulation           |     | 8 817                                                |     | 9 359                  |     | 12 488                 |
| VNI par action                          | \$  | 24,96                                                | \$  | 24,63                  | \$  | 23,00                  |
| Distribution                            | \$  | 40 456                                               | \$  | 44 206                 | \$  | 69 267                 |
| Actions émises en circulation           |     | 3 274                                                |     | 3 549                  |     | 5 722                  |
| VNI par action                          | \$  | 12,36                                                | \$  | 12,45                  | \$  | 12,10                  |
| Investisseurs en AUD (couverte) :       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                            | AUD | 9 708                                                | AUD | 9 885                  | AUD | 2 758                  |
| Actions émises en circulation           |     | 1 104                                                |     | 1 114                  |     | 319                    |
| VNI par action                          | AUD | 8,79                                                 | AUD | 8,87                   | AUD | 8,64                   |
| Investisseurs en CHF (couverte) :       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                          | CHF | 4 295                                                | CHF | 4 849                  | CHF | 4 470                  |
| Actions émises en circulation           |     | 375                                                  |     | 420                    |     | 397                    |
| VNI par action                          | CHF | 11,46                                                | CHF | 11,54                  | CHF | 11,26                  |
| Distribution                            | CHF | 2 064                                                | CHF | 2 217                  | CHF | 2 941                  |
| Actions émises en circulation           |     | 241                                                  |     | 251                    |     | 328                    |
| VNI par action                          | CHF | 8,57                                                 | CHF | 8,82                   | CHF | 8,96                   |
| Investisseurs en EUR (couverte) :       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                          | €   | 14 461                                               | €   | 17 162                 | €   | 26 998                 |
| Actions émises en circulation           |     | 794                                                  |     | 947                    |     | 1 563                  |
| VNI par action                          | €   | 18,20                                                | €   | 18,12                  | €   | 17,27                  |
| Distribution                            | €   | 7 838                                                | €   | 9 405                  | €   | 8 126                  |
| Actions émises en circulation           |     | 786                                                  |     | 926                    |     | 807                    |
| VNI par action                          | €   | 9,98                                                 | €   | 10,16                  | €   | 10,07                  |
| Investisseurs en GBP (couverte) :       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                            | £   | 2 898                                                | £   | 3 743                  | £   | 3 838                  |
| Actions émises en circulation           |     | 253                                                  |     | 323                    |     | 341                    |
| VNI par action                          | £   | 11,48                                                | £   | 11,58                  | £   | 11,25                  |
| Investisseurs en SGD (couverte) :       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                            | SGD | 4 020                                                | SGD | 4 714                  | SGD | 7 401                  |
| Actions émises en circulation           |     | 467                                                  |     | 536                    |     | 846                    |
| VNI par action                          | SGD | 8,61                                                 | SGD | 8,80                   | SGD | 8,74                   |
| Administrations :                       |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                          | \$  | 78 340                                               | \$  | 84 415                 | \$  | 94 258                 |
| Actions émises en circulation           |     | 3 686                                                |     | 4 023                  |     | 4 803                  |
| VNI par action                          | \$  | 21,26                                                | \$  | 20,99                  | \$  | 19,62                  |
| Distribution                            | \$  | 65 496                                               | \$  | 70 836                 | \$  | 83 600                 |
| Actions émises en circulation           |     | 5 483                                                |     | 5 884                  |     | 7 145                  |
| VNI par action                          | \$  | 11,94                                                | \$  | 12,04                  | \$  | 11,70                  |
| Administrations en CHF (couverte) :     |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                          | CHF | 92                                                   | CHF | 119                    | CHF | 164                    |
| Actions émises en circulation           |     | 9                                                    |     | 12                     |     | 17                     |
| VNI par action                          | CHF | 10,03                                                | CHF | 10,11                  | CHF | 9,87                   |
| Administrations en EUR (couverte) :     |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Capitalisation                          | €   | 6 871                                                | €   | 7 142                  | €   | 10 968                 |
| Actions émises en circulation           |     | 402                                                  |     | 419                    |     | 674                    |
| VNI par action                          | €   | 17,10                                                | €   | 17,03                  | €   | 16,26                  |
| Distribution                            | €   | 15 995                                               | €   | 16 841                 | €   | 7 189                  |
| Actions émises en circulation           |     | 1 660                                                |     | 1 717                  |     | 739                    |
| VNI par action                          | €   | 9,64                                                 | €   | 9,81                   | €   | 9,72                   |
| Administrations en GBP (couverte) :     |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                            | £   | 5 264                                                | £   | 5 552                  | £   | 5 696                  |
| Actions émises en circulation           |     | 461                                                  |     | 482                    |     | 509                    |
| VNI par action                          | £   | 11,42                                                | £   | 11,52                  | £   | 11,19                  |
| Administrations en HKD (non couverte) : |     |                                                      |     |                        |     |                        |
| Distribution                            | HKD | 21 338                                               | HKD | 30 912                 | HKD | 27 840                 |
| Actions émises en circulation           |     | 2 323                                                |     | 3 365                  |     | 3 124                  |
| VNI par action                          | HKD | 9,18                                                 | HKD | 9,19                   | HKD | 8,91                   |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                                       | Au<br>30 juin 2026                                   |         | Au<br>31 décembre 2025 |         | Au<br>31 décembre 2024 |         |
|-------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
|                                                       | Fonds Global Investment Grade Credit<br>Fund (suite) |         |                        |         |                        |         |
| Administrations en SEK (couverte) :                   |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | SEK                                                  | 53 298  | SEK                    | 53 366  | SEK                    | 54 105  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 4 624   |                        | 4 638   |                        | 4 919   |
| VNI par action                                        | SEK                                                  | 11,53   | SEK                    | 11,51   | SEK                    | 11,00   |
| Administrations en SGD (couverte) :                   |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Distribution                                          | SGD                                                  | 9 225   | SGD                    | 8 750   | SGD                    | 12 867  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 1 110   |                        | 1 030   |                        | 1 525   |
| VNI par action                                        | SGD                                                  | 8,31    | SGD                    | 8,49    | SGD                    | 8,44    |
| BE Détail :                                           |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | \$                                                   | 154     | \$                     | 10      |                        | O/S     |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 15      |                        | 1       |                        | O/S     |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 10,25   | \$                     | 10,19   |                        | O/S     |
| BM Détail :                                           |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Décumulation                                          | \$                                                   | 91 469  | \$                     | 105 903 | \$                     | 28 418  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 10 440  |                        | 11 653  |                        | 3 026   |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 8,76    | \$                     | 9,09    | \$                     | 9,39    |
| Catégorie E :                                         |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | \$                                                   | 540 692 | \$                     | 575 487 | \$                     | 674 947 |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 27 281  |                        | 29 354  |                        | 36 668  |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 19,82   | \$                     | 19,61   | \$                     | 18,41   |
| Distribution                                          | \$                                                   | 151 849 | \$                     | 169 938 | \$                     | 200 786 |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 12 050  |                        | 13 379  |                        | 16 265  |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 12,60   | \$                     | 12,70   | \$                     | 12,35   |
| Catégorie E en CHF (couverte) :                       |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | CHF                                                  | 33 627  | CHF                    | 38 038  | CHF                    | 42 271  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 3 292   |                        | 3 687   |                        | 4 177   |
| VNI par action                                        | CHF                                                  | 10,21   | CHF                    | 10,32   | CHF                    | 10,12   |
| Catégorie E en EUR (exposition au risque de change) : |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Distribution                                          | €                                                    | 1 277   | €                      | 1 268   | €                      | 1 352   |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 140     |                        | 140     |                        | 140     |
| VNI par action                                        | €                                                    | 9,12    | €                      | 9,06    | €                      | 9,66    |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                       |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | €                                                    | 231 194 | €                      | 262 972 | €                      | 293 534 |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 14 201  |                        | 16 181  |                        | 18 845  |
| VNI par action                                        | €                                                    | 16,28   | €                      | 16,25   | €                      | 15,58   |
| Distribution                                          | €                                                    | 158 485 | €                      | 168 177 | €                      | 179 306 |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 19 308  |                        | 20 132  |                        | 21 646  |
| VNI par action                                        | €                                                    | 8,21    | €                      | 8,35    | €                      | 8,28    |
| Catégorie E en GBP (couverte) :                       |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Distribution                                          | £                                                    | 13 081  | £                      | 18 917  | £                      | 20 299  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 1 097   |                        | 1 573   |                        | 1 737   |
| VNI par action                                        | £                                                    | 11,92   | £                      | 12,03   | £                      | 11,69   |
| Catégorie E en SGD (couverte) :                       |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Distribution                                          | SGD                                                  | 35 477  | SGD                    | 39 192  | SGD                    | 51 239  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 4 010   |                        | 4 336   |                        | 5 703   |
| VNI par action                                        | SGD                                                  | 8,85    | SGD                    | 9,04    | SGD                    | 8,98    |
| H Institutions :                                      |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | \$                                                   | 255 256 | \$                     | 244 514 | \$                     | 260 760 |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 10 644  |                        | 10 344  |                        | 11 835  |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 23,98   | \$                     | 23,64   | \$                     | 22,03   |
| Distribution                                          | \$                                                   | 28 138  | \$                     | 24 800  | \$                     | 16 106  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 3 002   |                        | 2 625   |                        | 1 754   |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 9,37    | \$                     | 9,45    | \$                     | 9,18    |
| H Institutions (exposition au risque de change) :     |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Capitalisation                                        | \$                                                   | 197 224 | \$                     | 177 023 | \$                     | 12 740  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 19 749  |                        | 17 782  |                        | 1 420   |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 9,99    | \$                     | 9,95    | \$                     | 8,97    |
| M Détail :                                            |                                                      |         |                        |         |                        |         |
| Décumulation                                          | \$                                                   | 73 384  | \$                     | 70 237  | \$                     | 40 699  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 8 150   |                        | 7 566   |                        | 4 287   |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 9,00    | \$                     | 9,28    | \$                     | 9,49    |
| Distribution                                          | \$                                                   | 18 526  | \$                     | 21 149  | \$                     | 27 149  |
| Actions émises en circulation                         |                                                      | 1 943   |                        | 2 201   |                        | 2 907   |
| VNI par action                                        | \$                                                   | 9,54    | \$                     | 9,61    | \$                     | 9,34    |

|                                  |     | Au<br>30 juin 2026                                   | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |     |        |
|----------------------------------|-----|------------------------------------------------------|------------------------|------------------------|-----|--------|
|                                  |     | Fonds Global Investment Grade Credit<br>Fund (suite) |                        |                        |     |        |
| Distribution II                  | \$  | 67 375                                               | \$                     | 77 692                 | \$  | 83 511 |
| Actions émises en circulation    |     | 8 190                                                |                        | 9 307                  |     | 10 152 |
| VNI par action                   | \$  | 8,23                                                 | \$                     | 8,35                   | \$  | 8,23   |
| M Détail en HKD (non couverte) : |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Distribution                     | HKD | 9 033                                                | HKD                    | 14 075                 | HKD | 8 995  |
| Actions émises en circulation    |     | 983                                                  |                        | 1 532                  |     | 1 009  |
| VNI par action                   | HKD | 9,19                                                 | HKD                    | 9,19                   | HKD | 8,92   |
| Catégorie R :                    |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | \$  | 5 502                                                | \$                     | 5 921                  | \$  | 7 754  |
| Actions émises en circulation    |     | 377                                                  |                        | 412                    |     | 578    |
| VNI par action                   | \$  | 14,58                                                | \$                     | 14,38                  | \$  | 13,42  |
| Distribution                     | \$  | 3 116                                                | \$                     | 3 426                  | \$  | 4 571  |
| Actions émises en circulation    |     | 330                                                  |                        | 360                    |     | 494    |
| VNI par action                   | \$  | 9,45                                                 | \$                     | 9,53                   | \$  | 9,26   |
| Catégorie R en EUR (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Distribution                     | €   | 933                                                  | €                      | 1 367                  | €   | 1 892  |
| Actions émises en circulation    |     | 122                                                  |                        | 175                    |     | 245    |
| VNI par action                   | €   | 7,66                                                 | €                      | 7,79                   | €   | 7,73   |
| Catégorie R en GBP (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Distribution                     | £   | 2 763                                                | £                      | 2 670                  | £   | 5 562  |
| Actions émises en circulation    |     | 318                                                  |                        | 304                    |     | 652    |
| VNI par action                   | £   | 8,70                                                 | £                      | 8,78                   | £   | 8,53   |
| Catégorie T :                    |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | \$  | 18 774                                               | \$                     | 22 323                 | \$  | 23 322 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 536                                                |                        | 1 843                  |     | 2 043  |
| VNI par action                   | \$  | 12,22                                                | \$                     | 12,11                  | \$  | 11,42  |
| Catégorie T en EUR (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | €   | 2 780                                                | €                      | 3 639                  | €   | 3 114  |
| Actions émises en circulation    |     | 280                                                  |                        | 367                    |     | 326    |
| VNI par action                   | €   | 9,91                                                 | €                      | 9,91                   | €   | 9,54   |
| Catégorie W :                    |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | \$  | 84 999                                               | \$                     | 81 685                 | \$  | 79 909 |
| Actions émises en circulation    |     | 7 894                                                |                        | 7 707                  |     | 8 110  |
| VNI par action                   | \$  | 10,77                                                | \$                     | 10,60                  | \$  | 9,85   |
| Distribution                     | \$  | 23 371                                               | \$                     | 21 947                 | \$  | 20 149 |
| Actions émises en circulation    |     | 2 689                                                |                        | 2 505                  |     | 2 367  |
| VNI par action                   | \$  | 8,69                                                 | \$                     | 8,76                   | \$  | 8,51   |
| Catégorie W en CHF (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | CHF | 9 258                                                | CHF                    | 11 986                 | CHF | 17 421 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 044                                                |                        | 1 345                  |     | 2 014  |
| VNI par action                   | CHF | 8,87                                                 | CHF                    | 8,91                   | CHF | 8,65   |
| Catégorie W en EUR (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | €   | 11 869                                               | €                      | 14 007                 | €   | 14 094 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 224                                                |                        | 1 454                  |     | 1 542  |
| VNI par action                   | €   | 9,70                                                 | €                      | 9,63                   | €   | 9,14   |
| Distribution                     | €   | 4 685                                                | €                      | 4 760                  | €   | 4 926  |
| Actions émises en circulation    |     | 600                                                  |                        | 598                    |     | 625    |
| VNI par action                   | €   | 7,81                                                 | €                      | 7,95                   | €   | 7,89   |
| Catégorie W en GBP (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Capitalisation                   | £   | 2 385                                                | £                      | 2 512                  | £   | 4 238  |
| Actions émises en circulation    |     | 227                                                  |                        | 243                    |     | 441    |
| VNI par action                   | £   | 10,50                                                | £                      | 10,34                  | £   | 9,62   |
| Distribution                     | £   | 5 799                                                | £                      | 6 055                  | £   | 12 197 |
| Actions émises en circulation    |     | 685                                                  |                        | 709                    |     | 1 470  |
| VNI par action                   | £   | 8,46                                                 | £                      | 8,54                   | £   | 8,30   |
| Catégorie W en SGD (couverte) :  |     |                                                      |                        |                        |     |        |
| Distribution                     | SGD | 12 030                                               | SGD                    | 13 487                 | SGD | 13 473 |
| Actions émises en circulation    |     | 1 489                                                |                        | 1 634                  |     | 1 642  |
| VNI par action                   | SGD | 8,08                                                 | SGD                    | 8,25                   | SGD | 8,20   |



|                                     | Au<br>30 juin 2026                            |           | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
|                                     | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund |           |                        |           |                        |           |
| Actif net                           | \$                                            | 2 277 042 | \$                     | 2 514 161 | \$                     | 2 115 617 |
| Institutions :                      |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | \$                                            | 184 508   | \$                     | 223 936   | \$                     | 132 347   |
| Actions émises en circulation       |                                               | 14 450    |                        | 17 754    |                        | 11 271    |
| VNI par action                      | \$                                            | 12,77     | \$                     | 12,61     | \$                     | 11,74     |
| Distribution                        | \$                                            | 27 841    | \$                     | 63 352    | \$                     | 128 969   |
| Actions émises en circulation       |                                               | 2 904     |                        | 6 552     |                        | 13 791    |
| VNI par action                      | \$                                            | 9,59      | \$                     | 9,67      | \$                     | 9,35      |
| Institutions en CHF (couverte) :    |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | CHF                                           | 179 506   | CHF                    | 187 344   | CHF                    | 169 761   |
| Actions émises en circulation       |                                               | 18 121    |                        | 18 749    |                        | 17 480    |
| VNI par action                      | CHF                                           | 9,91      | CHF                    | 9,99      | CHF                    | 9,71      |
| Distribution                        | CHF                                           | 775       | CHF                    | 1 527     | CHF                    | 2 137     |
| Actions émises en circulation       |                                               | 104       |                        | 199       |                        | 276       |
| VNI par action                      | CHF                                           | 7,43      | CHF                    | 7,66      | CHF                    | 7,73      |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | €                                             | 830 250   | €                      | 803 612   | €                      | 574 679   |
| Actions émises en circulation       |                                               | 75 949    |                        | 73 729    |                        | 55 491    |
| VNI par action                      | €                                             | 10,93     | €                      | 10,90     | €                      | 10,36     |
| Distribution                        | €                                             | 155 337   | €                      | 163 731   | €                      | 178 249   |
| Actions émises en circulation       |                                               | 19 050    |                        | 19 716    |                        | 21 749    |
| VNI par action                      | €                                             | 8,15      | €                      | 8,30      | €                      | 8,20      |
| Institutions en GBP (couverte) :    |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | £                                             | 34 091    | £                      | 58 015    | £                      | 75 998    |
| Actions émises en circulation       |                                               | 2 831     |                        | 4 874     |                        | 6 858     |
| VNI par action                      | £                                             | 12,04     | £                      | 11,90     | £                      | 11,08     |
| Distribution                        | £                                             | 79 350    | £                      | 109 381   | £                      | 111 796   |
| Actions émises en circulation       |                                               | 8 515     |                        | 11 624    |                        | 12 254    |
| VNI par action                      | £                                             | 9,32      | £                      | 9,41      | £                      | 9,12      |
| Institutions en SEK (couverte) :    |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | SEK                                           | 27 503    | SEK                    | 26 145    | SEK                    | 30 935    |
| Actions émises en circulation       |                                               | 233       |                        | 222       |                        | 276       |
| VNI par action                      | SEK                                           | 118,08    | SEK                    | 117,93    | SEK                    | 112,20    |
| Investisseurs :                     |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | \$                                            | 227       | \$                     | 161       | \$                     | 151       |
| Actions émises en circulation       |                                               | 22        |                        | 16        |                        | 16        |
| VNI par action                      | \$                                            | 10,39     | \$                     | 10,28     | \$                     | 9,60      |
| Investisseurs en EUR (couverte) :   |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                        | €                                             | 11        | €                      | 11        | €                      | 10        |
| Actions émises en circulation       |                                               | 1         |                        | 1         |                        | 1         |
| VNI par action                      | €                                             | 10,01     | €                      | 10,20     | €                      | 10,06     |
| Administrations en SEK (couverte) : |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | SEK                                           | 5 079 996 | SEK                    | 5 335 868 | SEK                    | 6 640 716 |
| Actions émises en circulation       |                                               | 52 158    |                        | 54 723    |                        | 71 207    |
| VNI par action                      | SEK                                           | 97,40     | SEK                    | 97,51     | SEK                    | 93,26     |
| Catégorie E :                       |                                               |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                      | \$                                            | 11 416    | \$                     | 12 240    | \$                     | 12 549    |
| Actions émises en circulation       |                                               | 1 106     |                        | 1 195     |                        | 1 305     |
| VNI par action                      | \$                                            | 10,32     | \$                     | 10,24     | \$                     | 9,62      |
| Distribution                        | \$                                            | 2 095     | \$                     | 2 277     | \$                     | 2 722     |
| Actions émises en circulation       |                                               | 229       |                        | 247       |                        | 305       |
| VNI par action                      | \$                                            | 9,14      | \$                     | 9,21      | \$                     | 8,91      |

|                                 | Au<br>30 juin 2026                                       |        | Au<br>31 décembre 2025 |        | Au<br>31 décembre 2024 |        |
|---------------------------------|----------------------------------------------------------|--------|------------------------|--------|------------------------|--------|
|                                 | Fonds Global Investment Grade<br>Credit ESG Fund (suite) |        |                        |        |                        |        |
| Catégorie E en CHF (couverte) : |                                                          |        |                        |        |                        |        |
| Capitalisation                  | CHF                                                      | 259    | CHF                    | 150    | CHF                    | 475    |
| Actions émises en circulation   |                                                          | 31     |                        | 18     |                        | 57     |
| VNI par action                  | CHF                                                      | 8,40   | CHF                    | 8,51   | CHF                    | 8,35   |
| Distribution                    |                                                          | O/S    |                        | O/S    | CHF                    | 8      |
| Actions émises en circulation   |                                                          | O/S    |                        | O/S    |                        |        |
| VNI par action                  |                                                          | O/S    |                        | O/S    | CHF                    | 7,74   |
| Catégorie E en EUR (couverte) : |                                                          |        |                        |        |                        |        |
| Capitalisation                  | €                                                        | 17 869 | €                      | 24 805 | €                      | 27 452 |
| Actions émises en circulation   |                                                          | 1 940  |                        | 2 689  |                        | 3 104  |
| VNI par action                  | €                                                        | 9,21   | €                      | 9,22   | €                      | 8,84   |
| Distribution                    | €                                                        | 460    | €                      | 438    | €                      | 657    |
| Actions émises en circulation   |                                                          | 57     |                        | 53     |                        | 80     |
| VNI par action                  | €                                                        | 8,14   | €                      | 8,29   | €                      | 8,19   |
| Catégorie E en GBP (couverte) : |                                                          |        |                        |        |                        |        |
| Capitalisation                  | £                                                        | 790    | £                      | 785    | £                      | 709    |
| Actions émises en circulation   |                                                          | 79     |                        | 79     |                        | 76     |
| VNI par action                  | £                                                        | 9,98   | £                      | 9,91   | £                      | 9,31   |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |
|                                 |                                                          |        |                        |        |                        |        |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                                 | Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite) |                        |                        |
|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                 | Au<br>30 juin 2026                                 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
| Investisseurs :                                 |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 5 254                                           | \$ 4 091               | \$ 4 088               |
| Actions émises en circulation                   | 386                                                | 305                    | 326                    |
| VNI par action                                  | \$ 13,60                                           | \$ 13,40               | \$ 12,54               |
| Catégorie E :                                   |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 27 143                                          | \$ 23 949              | \$ 20 131              |
| Actions émises en circulation                   | 2 134                                              | 1 906                  | 1 702                  |
| VNI par action                                  | \$ 12,72                                           | \$ 12,57               | \$ 11,83               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                 |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | € 143 280                                          | € 113 746              | € 70 697               |
| Actions émises en circulation                   | 13 852                                             | 11 030                 | 7 134                  |
| VNI par action                                  | € 10,34                                            | € 10,31                | € 9,91                 |
| Actif net                                       | Fonds Global Real Return Fund                      |                        |                        |
|                                                 | \$ 2 541 081                                       | \$ 1 863 961           | \$ 2 090 147           |
| Institutions :                                  |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 651 298                                         | \$ 197 997             | \$ 205 925             |
| Actions émises en circulation                   | 26 521                                             | 8 190                  | 9 058                  |
| VNI par action                                  | \$ 24,56                                           | \$ 24,18               | \$ 22,73               |
| Distribution                                    | \$ 809                                             | \$ 1 240               | \$ 3 593               |
| Actions émises en circulation                   | 51                                                 | 78                     | 234                    |
| VNI par action                                  | \$ 15,73                                           | \$ 15,83               | \$ 15,35               |
| Institutions (exposition au risque de change) : |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 125 880                                         | \$ 107 916             | \$ 114 885             |
| Actions émises en circulation                   | 11 260                                             | 9 685                  | 11 394                 |
| VNI par action                                  | \$ 11,18                                           | \$ 11,14               | \$ 10,08               |
| Institutions en CHF (couverte) :                |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | CHF 23 888                                         | CHF 35 416             | CHF 43 126             |
| Actions émises en circulation                   | 1 858                                              | 2 740                  | 3 398                  |
| VNI par action                                  | CHF 12,86                                          | CHF 12,92              | CHF 12,69              |
| Distribution                                    | CHF 29 554                                         | CHF 25 233             | CHF 25 635             |
| Actions émises en circulation                   | 3 937                                              | 3 269                  | 3 282                  |
| VNI par action                                  | CHF 7,51                                           | CHF 7,72               | CHF 7,81               |
| Institutions en EUR (couverte) :                |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | € 648 737                                          | € 431 322              | € 537 601              |
| Actions émises en circulation                   | 33 783                                             | 22 608                 | 29 357                 |
| VNI par action                                  | € 19,20                                            | € 19,08                | € 18,31                |
| Distribution                                    | € 84 314                                           | € 86 229               | € 78 497               |
| Actions émises en circulation                   | 6 995                                              | 7 041                  | 6 479                  |
| VNI par action                                  | € 12,05                                            | € 12,25                | € 12,12                |
| Institutions en GBP (couverte) :                |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | £ 7 090                                            | £ 6 995                | £ 25 949               |
| Actions émises en circulation                   | 535                                                | 536                    | 2 115                  |
| VNI par action                                  | £ 13,24                                            | £ 13,04                | £ 12,27                |
| Distribution                                    | £ 17 340                                           | £ 21 539               | £ 182 969              |
| Actions émises en circulation                   | 2 292                                              | 2 709                  | 23 661                 |
| VNI par action                                  | £ 7,57                                             | £ 7,95                 | £ 7,73                 |
| Institutions en SGD (couverte) :                |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | SGD 500 718                                        | SGD 483 575            | SGD 449 951            |
| Actions émises en circulation                   | 29 853                                             | 28 906                 | 27 964                 |
| VNI par action                                  | SGD 16,77                                          | SGD 16,73              | SGD 16,09              |
| Investisseurs :                                 |                                                    |                        |                        |
| Capitalisation                                  | \$ 14 699                                          | \$ 17 044              | \$ 25 849              |
| Actions émises en circulation                   | 648                                                | 762                    | 1 225                  |
| VNI par action                                  | \$ 22,67                                           | \$ 22,36               | \$ 21,10               |
| Distribution                                    | \$ 4 155                                           | \$ 4 105               | \$ 4 372               |
| Actions émises en circulation                   | 303                                                | 298                    | 327                    |
| VNI par action                                  | \$ 13,69                                           | \$ 13,78               | \$ 13,35               |
| Investisseurs en CHF (couverte) :               |                                                    |                        |                        |
| Distribution                                    | O/S                                                | O/S                    | CHF 830                |
| Actions émises en circulation                   | O/S                                                | O/S                    | 84                     |
| VNI par action                                  | O/S                                                | O/S                    | CHF 9,83               |

|                                   | Fonds Global Real Return Fund (suite) |                        |                        |
|-----------------------------------|---------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                   | Au<br>30 juin 2026                    | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 3 998                               | € 2 872                | € 4 534                |
| Actions émises en circulation     | 225                                   | 162                    | 266                    |
| VNI par action                    | € 17,78                               | € 17,69                | € 17,04                |
| Administrations :                 |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 31 586                             | \$ 32 049              | \$ 31 590              |
| Actions émises en circulation     | 1 432                                 | 1 472                  | 1 536                  |
| VNI par action                    | \$ 22,06                              | \$ 21,77               | \$ 20,57               |
| Catégorie E :                     |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 123 770                            | \$ 121 595             | \$ 87 449              |
| Actions émises en circulation     | 6 061                                 | 6 022                  | 4 565                  |
| VNI par action                    | \$ 20,42                              | \$ 20,19               | \$ 19,16               |
| Distribution                      | \$ 16 173                             | \$ 18 464              | \$ 21 615              |
| Actions émises en circulation     | 1 230                                 | 1 395                  | 1 686                  |
| VNI par action                    | \$ 13,15                              | \$ 13,23               | \$ 12,82               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :   |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 90 963                              | € 102 605              | € 125 937              |
| Actions émises en circulation     | 5 691                                 | 6 432                  | 8 151                  |
| VNI par action                    | € 15,99                               | € 15,95                | € 15,45                |
| H Institutions :                  |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 135 334                            | \$ 135 229             | \$ 147 143             |
| Actions émises en circulation     | 5 717                                 | 5 798                  | 6 698                  |
| VNI par action                    | \$ 23,67                              | \$ 23,32               | \$ 21,97               |
| Catégorie R en GBP (couverte) :   |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | £ 3 703                               | £ 4 198                | £ 5 100                |
| Actions émises en circulation     | 300                                   | 344                    | 444                    |
| VNI par action                    | £ 12,36                               | £ 12,19                | £ 11,49                |
| Actif net                         | Fonds Income Fund                     |                        |                        |
|                                   | \$ 124 749 536                        | \$ 121 748 102         | \$ 89 286 860          |
| Institutions :                    |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 23 779 805                         | \$ 22 606 394          | \$ 15 407 659          |
| Actions émises en circulation     | 1 171 759                             | 1 129 383              | 851 558                |
| VNI par action                    | \$ 20,29                              | \$ 20,02               | \$ 18,09               |
| Distribution                      | \$ 8 721 491                          | \$ 9 541 609           | \$ 7 324 286           |
| Actions émises en circulation     | 796 283                               | 857 200                | 685 413                |
| VNI par action                    | \$ 10,95                              | \$ 11,13               | \$ 10,69               |
| Institutions en AUD (couverte) :  |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | AUD 87 188                            | AUD 90 328             | AUD 117 318            |
| Actions émises en circulation     | 6 626                                 | 6 956                  | 9 962                  |
| VNI par action                    | AUD 13,16                             | AUD 12,99              | AUD 11,78              |
| Distribution                      | AUD 63 304                            | AUD 41 014             | AUD 7 242              |
| Actions émises en circulation     | 6 204                                 | 3 949                  | 723                    |
| VNI par action                    | AUD 10,20                             | AUD 10,38              | AUD 10,02              |
| Institutions en BRL (couverte) :  |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 465 672                            | \$ 403 818             | \$ 326 146             |
| Actions émises en circulation     | 20 943                                | 20 299                 | 22 129                 |
| VNI par action                    | \$ 22,24                              | \$ 19,89               | \$ 14,74               |
| Institutions en CAD (couverte) :  |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                    | CAD 116 774                           | CAD 106 015            | CAD 65 288             |
| Actions émises en circulation     | 7 749                                 | 7 071                  | 4 736                  |
| VNI par action                    | CAD 15,07                             | CAD 14,99              | CAD 13,78              |

|                                      | Au<br>30 juin 2026        |           | Au<br>31 décembre 2025 |            | Au<br>31 décembre 2024 |            |
|--------------------------------------|---------------------------|-----------|------------------------|------------|------------------------|------------|
|                                      | Fonds Income Fund (suite) |           |                        |            |                        |            |
| Distribution                         | CAD                       | 73 806    | CAD                    | 75 824     | CAD                    | 86 483     |
| Actions émises en circulation        |                           | 8 196     |                        | 8 202      |                        | 9 565      |
| VNI par action                       | CAD                       | 9,00      | CAD                    | 9,24       | CAD                    | 9,04       |
| Institutions en CHF (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Capitalisation                       | CHF                       | 396 321   | CHF                    | 404 386    | CHF                    | 405 974    |
| Actions émises en circulation        |                           | 32 372    |                        | 32 808     |                        | 34 883     |
| VNI par action                       | CHF                       | 12,24     | CHF                    | 12,33      | CHF                    | 11,64      |
| Distribution                         | CHF                       | 219 239   | CHF                    | 234 726    | CHF                    | 214 547    |
| Actions émises en circulation        |                           | 31 941    |                        | 32 770     |                        | 29 601     |
| VNI par action                       | CHF                       | 6,86      | CHF                    | 7,16       | CHF                    | 7,25       |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Capitalisation                       | €                         | 7 275 291 | €                      | 7 195 930  | €                      | 5 715 921  |
| Actions émises en circulation        |                           | 446 210   |                        | 443 406    |                        | 381 533    |
| VNI par action                       | €                         | 16,30     | €                      | 16,23      | €                      | 14,98      |
| Distribution                         | €                         | 969 947   | €                      | 979 740    | €                      | 728 143    |
| Actions émises en circulation        |                           | 114 115   |                        | 112 079    |                        | 84 594     |
| VNI par action                       | €                         | 8,50      | €                      | 8,74       | €                      | 8,61       |
| Distribution II                      | €                         | 660 234   | €                      | 578 270    | €                      | 293 101    |
| Actions émises en circulation        |                           | 72 031    |                        | 62 119     |                        | 32 754     |
| VNI par action                       | €                         | 9,17      | €                      | 9,31       | €                      | 8,95       |
| Institutions en GBP (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Capitalisation                       | £                         | 286 108   | £                      | 220 108    | £                      | 328 281    |
| Actions émises en circulation        |                           | 21 819    |                        | 17 006     |                        | 28 041     |
| VNI par action                       | £                         | 13,11     | £                      | 12,94      | £                      | 11,71      |
| Distribution                         | £                         | 1 144 446 | £                      | 1 074 824  | £                      | 718 827    |
| Actions émises en circulation        |                           | 123 958   |                        | 114 390    |                        | 79 548     |
| VNI par action                       | £                         | 9,23      | £                      | 9,40       | £                      | 9,04       |
| Institutions en HKD (non couverte) : |                           |           |                        |            |                        |            |
| Distribution                         | HKD                       | 1 870 629 | HKD                    | 3 083 012  | HKD                    | 616 237    |
| Actions émises en circulation        |                           | 186 256   |                        | 304 337    |                        | 63 448     |
| VNI par action                       | HKD                       | 10,04     | HKD                    | 10,13      | HKD                    | 9,71       |
| Institutions en JPY (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Capitalisation                       | ¥                         | 5 654 753 | ¥                      | 10 903 530 | ¥                      | 11 709 740 |
| Actions émises en circulation        |                           | 5 219     |                        | 10 042     |                        | 11 454     |
| VNI par action                       | ¥                         | 1 083,00  | ¥                      | 1 086,00   | ¥                      | 1 022,00   |
| Distribution                         | ¥                         | 188 112   | ¥                      | 99 163     | ¥                      | 3 249      |
| Actions émises en circulation        |                           | 208       |                        | 106        |                        | 3          |
| VNI par action                       | ¥                         | 903,00    | ¥                      | 935,00     | ¥                      | 938,00     |
| Institutions en NOK (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Capitalisation                       | NOK                       | 2 741 445 | NOK                    | 2 863 197  | NOK                    | 2 383 760  |
| Actions émises en circulation        |                           | 20 340    |                        | 21 529     |                        | 19 826     |
| VNI par action                       | NOK                       | 134,78    | NOK                    | 132,99     | NOK                    | 120,23     |
| Institutions en RMB (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Distribution                         | CNH                       | 196 336   | CNH                    | 173 063    | CNH                    | 203 472    |
| Actions émises en circulation        |                           | 2 034     |                        | 1 738      |                        | 2 070      |
| VNI par action                       | CNH                       | 96,55     | CNH                    | 99,56      | CNH                    | 98,32      |
| Institutions en SEK (couverte) :     |                           |           |                        |            |                        |            |
| Capitalisation                       | SEK                       | 294 931   |                        | O/S        |                        | O/S        |
| Actions émises en circulation        |                           | 2 941     |                        | O/S        |                        | O/S        |
| VNI par action                       | SEK                       | 100,29    |                        | O/S        |                        | O/S        |

|                                       | Au<br>30 juin 2026        |           | Au<br>31 décembre 2025 |           | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|---------------------------------------|---------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
|                                       | Fonds Income Fund (suite) |           |                        |           |                        |           |
| Institutions en SGD (couverte) :      |                           |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | SGD                       | 656 940   | SGD                    | 499 928   | SGD                    | 247 319   |
| Actions émises en circulation         |                           | 54 014    |                        | 41 133    |                        | 22 002    |
| VNI par action                        | SGD                       | 12,16     | SGD                    | 12,15     | SGD                    | 11,24     |
| Distribution                          | SGD                       | 1 762 544 | SGD                    | 1 546 857 | SGD                    | 749 337   |
| Actions émises en circulation         |                           | 193 237   |                        | 164 332   |                        | 80 791    |
| VNI par action                        | SGD                       | 9,12      | SGD                    | 9,41      | SGD                    | 9,27      |
| Investisseurs :                       |                           |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | \$                        | 3 120 509 | \$                     | 2 963 358 | \$                     | 2 441 763 |
| Actions émises en circulation         |                           | 191 520   |                        | 184 078   |                        | 167 216   |
| VNI par action                        | \$                        | 16,29     | \$                     | 16,10     | \$                     | 14,60     |
| Distribution                          | \$                        | 2 189 644 | \$                     | 2 071 187 | \$                     | 1 780 936 |
| Actions émises en circulation         |                           | 229 929   |                        | 213 530   |                        | 190 451   |
| VNI par action                        | \$                        | 9,52      | \$                     | 9,70      | \$                     | 9,35      |
| Investisseurs en AUD (couverte) :     |                           |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | AUD                       | 14        |                        | O/S       |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation         |                           | 1         |                        | O/S       |                        | O/S       |
| VNI par action                        | AUD                       | 10,10     |                        | O/S       |                        | O/S       |
| Distribution                          | AUD                       | 115 536   | AUD                    | 74 439    | AUD                    | 63 762    |
| Actions émises en circulation         |                           | 13 571    |                        | 8 568     |                        | 7 568     |
| VNI par action                        | AUD                       | 8,51      | AUD                    | 8,69      | AUD                    | 8,42      |
| Investisseurs en CHF (couverte) :     |                           |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                          | CHF                       | 8         |                        | O/S       |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation         |                           | 1         |                        | O/S       |                        | O/S       |
| VNI par action                        | CHF                       | 9,93      |                        | O/S       |                        | O/S       |
| Investisseurs en EUR (couverte) :     |                           |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | €                         | 224 523   | €                      | 271 004   | €                      | 227 681   |
| Actions émises en circulation         |                           | 17 560    |                        | 21 257    |                        | 19 278    |
| VNI par action                        | €                         | 12,79     | €                      | 12,75     | €                      | 11,81     |
| Distribution                          | €                         | 106 237   | €                      | 100 157   | €                      | 82 149    |
| Actions émises en circulation         |                           | 14 539    |                        | 13 298    |                        | 11 029    |
| VNI par action                        | €                         | 7,31      | €                      | 7,53      | €                      | 7,45      |
| Distribution A                        | €                         | 20 168    | €                      | 20 892    | €                      | 21 015    |
| Actions émises en circulation         |                           | 2 528     |                        | 2 627     |                        | 2 698     |
| VNI par action                        | €                         | 7,98      | €                      | 7,95      | €                      | 7,79      |
| Investisseurs en GBP (couverte) :     |                           |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                          | £                         | 14 903    | £                      | 16 575    | £                      | 12 280    |
| Actions émises en circulation         |                           | 1 732     |                        | 1 889     |                        | 1 449     |
| VNI par action                        | £                         | 8,60      | £                      | 8,77      | £                      | 8,48      |
| Investisseurs en HKD (non couverte) : |                           |           |                        |           |                        |           |
| Distribution                          | HKD                       | 109 472   | HKD                    | 79 101    | HKD                    | 87        |
| Actions émises en circulation         |                           | 10 210    |                        | 7 298     |                        | 8         |
| VNI par action                        | HKD                       | 10,72     | HKD                    | 10,84     | HKD                    | 10,43     |
| Investisseurs en JPY (couverte) :     |                           |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | ¥                         | 387 600   | ¥                      | 762 593   | ¥                      | 153 876   |
| Actions émises en circulation         |                           | 363       |                        | 712       |                        | 152       |
| VNI par action                        | ¥                         | 1 068,00  | ¥                      | 1 072,00  | ¥                      | 1 013,00  |
| Investisseurs en RMB (couverte) :     |                           |           |                        |           |                        |           |
| Capitalisation                        | CNH                       | 106 406   | CNH                    | 128 706   | CNH                    | 92 810    |
| Actions émises en circulation         |                           | 795       |                        | 961       |                        | 746       |
| VNI par action                        | CNH                       | 133,88    | CNH                    | 133,88    | CNH                    | 124,46    |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                         | Au<br>30 juin 2026        |            | Au<br>31 décembre 2025 |            | Au<br>31 décembre 2024 |           |
|-----------------------------------------|---------------------------|------------|------------------------|------------|------------------------|-----------|
|                                         | Fonds Income Fund (suite) |            |                        |            |                        |           |
| Investisseurs en SGD (couverte) :       |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | SGD                       | 61 493     | SGD                    | 48 861     | SGD                    | 23 284    |
| Actions émises en circulation           |                           | 5 283      |                        | 4 194      |                        | 2 153     |
| VNI par action                          | SGD                       | 11,64      | SGD                    | 11,65      | SGD                    | 10,81     |
| Distribution                            | SGD                       | 273 366    | SGD                    | 196 087    | SGD                    | 119 519   |
| Actions émises en circulation           |                           | 32 510     |                        | 22 546     |                        | 13 899    |
| VNI par action                          | SGD                       | 8,41       | SGD                    | 8,70       | SGD                    | 8,60      |
| Administrations :                       |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | \$                        | 2 022 584  | \$                     | 1 878 307  | \$                     | 1 341 063 |
| Actions émises en circulation           |                           | 140 851    |                        | 132 289    |                        | 103 971   |
| VNI par action                          | \$                        | 14,36      | \$                     | 14,20      | \$                     | 12,90     |
| Distribution                            | \$                        | 6 858 814  | \$                     | 6 550 095  | \$                     | 5 224 940 |
| Actions émises en circulation           |                           | 678 250    |                        | 635 358    |                        | 524 774   |
| VNI par action                          | \$                        | 10,11      | \$                     | 10,31      | \$                     | 9,96      |
| Administrations en AUD (couverte) :     |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | AUD                       | 24 316     | AUD                    | 17 358     | AUD                    | 15        |
| Actions émises en circulation           |                           | 2 198      |                        | 1 586      |                        | 2         |
| VNI par action                          | AUD                       | 11,06      | AUD                    | 10,95      | AUD                    | 9,98      |
| Distribution                            | AUD                       | 595 785    | AUD                    | 584 907    | AUD                    | 497 594   |
| Actions émises en circulation           |                           | 68 647     |                        | 65 978     |                        | 57 766    |
| VNI par action                          | AUD                       | 8,68       | AUD                    | 8,87       | AUD                    | 8,61      |
| Administrations en EUR (couverte) :     |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | €                         | 94 016     | €                      | 55 781     | €                      | 98 047    |
| Actions émises en circulation           |                           | 7 438      |                        | 4 423      |                        | 8 380     |
| VNI par action                          | €                         | 12,64      | €                      | 12,61      | €                      | 11,70     |
| Distribution                            | €                         | 425 752    | €                      | 428 056    | €                      | 364 116   |
| Actions émises en circulation           |                           | 57 756     |                        | 56 282     |                        | 48 328    |
| VNI par action                          | €                         | 7,37       | €                      | 7,61       | €                      | 7,53      |
| Administrations en GBP (couverte) :     |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | £                         | 6 989      |                        | O/S        |                        | O/S       |
| Actions émises en circulation           |                           | 692        |                        | O/S        |                        | O/S       |
| VNI par action                          | £                         | 10,09      |                        | O/S        |                        | O/S       |
| Distribution                            | £                         | 173 002    | £                      | 163 651    | £                      | 160 323   |
| Actions émises en circulation           |                           | 20 927     |                        | 19 390     |                        | 19 633    |
| VNI par action                          | £                         | 8,27       | £                      | 8,44       | £                      | 8,17      |
| Administrations en HKD (non couverte) : |                           |            |                        |            |                        |           |
| Distribution                            | HKD                       | 8 722 606  | HKD                    | 5 974 821  | HKD                    | 3 896 729 |
| Actions émises en circulation           |                           | 967 527    |                        | 654 907    |                        | 442 930   |
| VNI par action                          | HKD                       | 9,02       | HKD                    | 9,12       | HKD                    | 8,80      |
| Administrations en SEK (couverte) :     |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | SEK                       | 3 210      | SEK                    | 3 275      | SEK                    | 2 637     |
| Actions émises en circulation           |                           | 30         |                        | 30         |                        | 26        |
| VNI par action                          | SEK                       | 107,65     | SEK                    | 107,63     | SEK                    | 99,98     |
| Administrations en SGD (couverte) :     |                           |            |                        |            |                        |           |
| Distribution                            | SGD                       | 6 734 173  | SGD                    | 6 385 976  | SGD                    | 3 465 568 |
| Actions émises en circulation           |                           | 730 563    |                        | 669 194    |                        | 366 388   |
| VNI par action                          | SGD                       | 9,22       | SGD                    | 9,54       | SGD                    | 9,46      |
| Catégorie E :                           |                           |            |                        |            |                        |           |
| Capitalisation                          | \$                        | 11 244 379 | \$                     | 10 385 657 | \$                     | 7 665 777 |
| Actions émises en circulation           |                           | 625 636    |                        | 583 258    |                        | 472 004   |
| VNI par action                          | \$                        | 17,97      | \$                     | 17,81      | \$                     | 16,24     |

|                                     | Au<br>30 juin 2026        |             | Au<br>31 décembre 2025 |             | Au<br>31 décembre 2024 |             |
|-------------------------------------|---------------------------|-------------|------------------------|-------------|------------------------|-------------|
|                                     | Fonds Income Fund (suite) |             |                        |             |                        |             |
| Distribution                        | \$                        | 13 281 211  | \$                     | 13 120 494  | \$                     | 10 789 424  |
| Actions émises en circulation       |                           | 1 399 898   |                        | 1 353 179   |                        | 1 146 679   |
| VNI par action                      | \$                        | 9,49        | \$                     | 9,70        | \$                     | 9,41        |
| Catégorie E en AUD (couverte) :     |                           |             |                        |             |                        |             |
| Distribution                        | AUD                       | 1 041 270   | AUD                    | 1 094 998   | AUD                    | 981 659     |
| Actions émises en circulation       |                           | 129 865     |                        | 133 362     |                        | 122 466     |
| VNI par action                      | AUD                       | 8,02        | AUD                    | 8,21        | AUD                    | 8,02        |
| Catégorie E en CHF (couverte) :     |                           |             |                        |             |                        |             |
| Capitalisation                      | CHF                       | 61 296      | CHF                    | 64 741      | CHF                    | 63 917      |
| Actions émises en circulation       |                           | 5 380       |                        | 5 619       |                        | 5 823       |
| VNI par action                      | CHF                       | 11,39       | CHF                    | 11,52       | CHF                    | 10,98       |
| Distribution                        | CHF                       | 569 147     | CHF                    | 560 223     | CHF                    | 334 875     |
| Actions émises en circulation       |                           | 94 125      |                        | 88 266      |                        | 51 570      |
| VNI par action                      | CHF                       | 6,05        | CHF                    | 6,35        | CHF                    | 6,49        |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                           |             |                        |             |                        |             |
| Capitalisation                      | €                         | 5 933 544   | €                      | 5 956 432   | €                      | 5 003 524   |
| Actions émises en circulation       |                           | 411 299     |                        | 412 966     |                        | 372 420     |
| VNI par action                      | €                         | 14,43       | €                      | 14,42       | €                      | 13,44       |
| Distribution                        | €                         | 3 593 420   | €                      | 3 701 954   | €                      | 3 515 468   |
| Actions émises en circulation       |                           | 488 352     |                        | 486 385     |                        | 463 975     |
| VNI par action                      | €                         | 7,36        | €                      | 7,61        | €                      | 7,58        |
| Distribution II                     | €                         | 328 044     | €                      | 297 920     | €                      | 225 785     |
| Actions émises en circulation       |                           | 36 891      |                        | 32 817      |                        | 25 612      |
| VNI par action                      | €                         | 8,89        | €                      | 9,08        | €                      | 8,82        |
| Distribution II Q                   | €                         | 55 621      | €                      | 48 280      | €                      | 34 473      |
| Actions émises en circulation       |                           | 6 343       |                        | 5 392       |                        | 3 964       |
| VNI par action                      | €                         | 8,77        | €                      | 8,95        | €                      | 8,70        |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : |                           |             |                        |             |                        |             |
| Distribution                        | €                         | 9           | €                      | 9           |                        | O/S         |
| Actions émises en circulation       |                           | 1           |                        | 1           |                        | O/S         |
| VNI par action                      | €                         | 10,03       | €                      | 9,98        |                        | O/S         |
| Catégorie E en GBP (couverte) :     |                           |             |                        |             |                        |             |
| Distribution                        | £                         | 288 146     | £                      | 301 126     | £                      | 256 357     |
| Actions émises en circulation       |                           | 36 708      |                        | 37 480      |                        | 32 817      |
| VNI par action                      | £                         | 7,85        | £                      | 8,03        | £                      | 7,81        |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : |                           |             |                        |             |                        |             |
| Distribution                        | HKD                       | 9 725 851   | HKD                    | 8 580 323   | HKD                    | 4 888 390   |
| Actions émises en circulation       |                           | 1 085 458   |                        | 943 926     |                        | 555 032     |
| VNI par action                      | HKD                       | 8,96        | HKD                    | 9,09        | HKD                    | 8,81        |
| Catégorie E en HUF (couverte) :     |                           |             |                        |             |                        |             |
| Capitalisation                      | HUF                       | 23 133 427  | HUF                    | 12 457 936  | HUF                    | 94 299      |
| Actions émises en circulation       |                           | 2 031 532   |                        | 1 114 201   |                        | 9 425       |
| VNI par action                      | HUF                       | 11,39       | HUF                    | 11,18       | HUF                    | 10,00       |
| Catégorie E en JPY (couverte) :     |                           |             |                        |             |                        |             |
| Capitalisation                      | ¥                         | 32 010 498  | ¥                      | 46 662 019  | ¥                      | 43 680 919  |
| Actions émises en circulation       |                           | 31 841      |                        | 46 107      |                        | 45 428      |
| VNI par action                      | ¥                         | 1 005,00    | ¥                      | 1 012,00    | ¥                      | 962,00      |
| Distribution                        | ¥                         | 158 381 897 | ¥                      | 178 897 496 | ¥                      | 167 720 684 |
| Actions émises en circulation       |                           | 192 629     |                        | 208 545     |                        | 192 054     |
| VNI par action                      | ¥                         | 822,00      | ¥                      | 858,00      | ¥                      | 873,00      |

|                                     | Au<br>30 juin 2026        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|---------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds Income Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie E en RMB (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | CNH 1 732 751             | CNH 1 668 265          | CNH 1 276 444          |
| Actions émises en circulation       | 17 624                    | 16 349                 | 12 514                 |
| VNI par action                      | CNH 98,32                 | CNH 102,04             | CNH 102,00             |
| Catégorie E en SGD (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 9 070 291             | SGD 9 067 586          | SGD 7 125 445          |
| Actions émises en circulation       | 1 129 890                 | 1 088 248              | 858 495                |
| VNI par action                      | SGD 8,03                  | SGD 8,33               | SGD 8,30               |
| G Détail en EUR (couverte) :        |                           |                        |                        |
| Distribution                        | € 228 465                 | € 260 916              | € 263 123              |
| Actions émises en circulation       | 30 005                    | 34 274                 | 35 129                 |
| VNI par action                      | € 7,61                    | € 7,61                 | € 7,49                 |
| H Institutions :                    |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 2 097 863              | \$ 1 878 077           | \$ 1 308 558           |
| Actions émises en circulation       | 148 565                   | 134 730                | 103 675                |
| VNI par action                      | \$ 14,12                  | \$ 13,94               | \$ 12,62               |
| Distribution                        | \$ 845 275                | \$ 815 809             | \$ 593 228             |
| Actions émises en circulation       | 89 909                    | 85 292                 | 64 474                 |
| VNI par action                      | \$ 9,40                   | \$ 9,56                | \$ 9,20                |
| H Institutions en AUD (couverte) :  |                           |                        |                        |
| Distribution                        | AUD 15                    | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 2                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                      | AUD 9,81                  | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie R :                       |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 104 735                | \$ 100 692             | \$ 153 259             |
| Actions émises en circulation       | 8 071                     | 7 857                  | 13 197                 |
| VNI par action                      | \$ 12,98                  | \$ 12,81               | \$ 11,61               |
| Distribution                        | \$ 77 636                 | \$ 71 985              | \$ 63 882              |
| Actions émises en circulation       | 8 210                     | 7 479                  | 6 893                  |
| VNI par action                      | \$ 9,46                   | \$ 9,62                | \$ 9,27                |
| Catégorie R en EUR (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 75 215                  | € 76 332               | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 7 035                     | 7 164                  | O/S                    |
| VNI par action                      | € 10,69                   | € 10,66                | O/S                    |
| Distribution                        | € 17 764                  | € 15 372               | € 11 900               |
| Actions émises en circulation       | 2 286                     | 1 920                  | 1 505                  |
| VNI par action                      | € 7,77                    | € 8,01                 | € 7,91                 |
| Catégorie R en EUR (non couverte) : |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 10                      | 10                     | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 1                         | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                      | € 10,86                   | € 10,45                | O/S                    |
| Catégorie R en GBP (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | £ 25 929                  | £ 24 195               | £ 24 232               |
| Actions émises en circulation       | 2 719                     | 2 489                  | 2 584                  |
| VNI par action                      | £ 9,54                    | £ 9,72                 | £ 9,38                 |
| Catégorie T :                       |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 564 760                | \$ 518 120             | \$ 426 502             |
| Actions émises en circulation       | 38 819                    | 35 876                 | 32 248                 |
| VNI par action                      | \$ 14,55                  | \$ 14,44               | \$ 13,23               |
| Distribution                        | \$ 165 411                | \$ 163 152             | \$ 143 087             |
| Actions émises en circulation       | 20 110                    | 19 359                 | 17 411                 |
| VNI par action                      | \$ 8,23                   | \$ 8,43                | \$ 8,22                |

|                                     | Au<br>30 juin 2026        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|---------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds Income Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie T en EUR (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 286 034                 | € 288 956              | € 250 816              |
| Actions émises en circulation       | 24 348                    | 24 553                 | 22 789                 |
| VNI par action                      | € 11,75                   | € 11,77                | € 11,01                |
| Distribution                        | € 170 714                 | € 177 362              | € 178 617              |
| Actions émises en circulation       | 26 615                    | 26 665                 | 26 845                 |
| VNI par action                      | € 6,41                    | € 6,65                 | € 6,65                 |
| Catégorie Z :                       |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 111 433                | \$ 85 950              | \$ 123 213             |
| Actions émises en circulation       | 5 101                     | 4 000                  | 6 379                  |
| VNI par action                      | \$ 21,84                  | \$ 21,49               | \$ 19,31               |
| Distribution                        | \$ 262 923                | \$ 42 408              | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 25 991                    | 4 136                  | O/S                    |
| VNI par action                      | \$ 10,12                  | \$ 10,25               | O/S                    |
| Catégorie Z en AUD (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution II                     | AUD 1 449 289             | AUD 1 374 823          | AUD 1 226 200          |
| Actions émises en circulation       | 144 955                   | 135 503                | 125 962                |
| VNI par action                      | AUD 10,00                 | AUD 10,15              | AUD 9,73               |
|                                     | Fonds Income Fund II      |                        |                        |
| Actif net                           | \$ 720 543                | \$ 602 943             | \$ 273 663             |
| Institutions :                      |                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 2 026                  | \$ 399                 | \$ 20                  |
| Actions émises en circulation       | 170                       | 34                     | 2                      |
| VNI par action                      | \$ 11,90                  | \$ 11,72               | \$ 10,62               |
| Distribution                        | O/S                       | O/S                    | \$ 11                  |
| Actions émises en circulation       | O/S                       | O/S                    | 1                      |
| VNI par action                      | O/S                       | O/S                    | \$ 10,16               |
| Catégorie E :                       |                           |                        |                        |
| Distribution                        | \$ 299 277                | \$ 246 066             | \$ 109 150             |
| Actions émises en circulation       | 34 351                    | 27 709                 | 12 677                 |
| VNI par action                      | \$ 8,71                   | \$ 8,88                | \$ 8,61                |
| Catégorie E en AUD (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | AUD 44 298                | AUD 42 622             | AUD 23 246             |
| Actions émises en circulation       | 5 354                     | 5 048                  | 2 826                  |
| VNI par action                      | AUD 8,27                  | AUD 8,44               | AUD 8,23               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | € 11 408                  | € 10 320               | € 6 866                |
| Actions émises en circulation       | 1 460                     | 1 281                  | 859                    |
| VNI par action                      | € 7,82                    | € 8,05                 | € 7,99                 |
| Catégorie E en GBP (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | £ 18 270                  | £ 17 292               | £ 8 568                |
| Actions émises en circulation       | 2 151                     | 1 995                  | 1 018                  |
| VNI par action                      | £ 8,49                    | £ 8,67                 | £ 8,41                 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : |                           |                        |                        |
| Distribution                        | HKD 2 268 679             | HKD 1 724 631          | HKD 509 914            |
| Actions émises en circulation       | 257 657                   | 193 640                | 59 152                 |
| VNI par action                      | HKD 8,81                  | HKD 8,91               | HKD 8,62               |
| Catégorie E en JPY (couverte) :     |                           |                        |                        |
| Distribution                        | ¥ 10 070 431              | ¥ 11 145 032           | ¥ 10 467 779           |
| Actions émises en circulation       | 11 214                    | 11 943                 | 11 055                 |
| VNI par action                      | ¥ 898,00                  | ¥ 933,00               | ¥ 947,00               |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                  | Au<br>30 juin 2026                                     | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds Low Average Duration Fund                        |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 523 255                                             | \$ 576 265             | \$ 676 383             |
| Institutions :                   |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 342 175                                             | \$ 399 330             | \$ 470 154             |
| Actions émises en circulation    | 18 749                                                 | 22 022                 | 27 399                 |
| VNI par action                   | \$ 18,25                                               | \$ 18,13               | \$ 17,16               |
| Distribution                     | \$ 23 817                                              | \$ 17 743              | \$ 28 141              |
| Actions émises en circulation    | 2 332                                                  | 1 716                  | 2 772                  |
| VNI par action                   | \$ 10,21                                               | \$ 10,34               | \$ 10,15               |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 8 367                                                | € 8 467                | € 10 911               |
| Actions émises en circulation    | 787                                                    | 794                    | 1 059                  |
| VNI par action                   | € 10,64                                                | € 10,66                | € 10,30                |
| Distribution                     | O/S                                                    | O/S                    | € 367                  |
| Actions émises en circulation    | O/S                                                    | O/S                    | 52                     |
| VNI par action                   | O/S                                                    | O/S                    | € 7,00                 |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | £ 3 703                                                | £ 4 424                | £ 54 287               |
| Actions émises en circulation    | 328                                                    | 394                    | 5 106                  |
| VNI par action                   | £ 11,30                                                | £ 11,23                | £ 10,63                |
| Distribution                     | £ 9 575                                                | £ 11 800               | £ 3 219                |
| Actions émises en circulation    | 1 064                                                  | 1 294                  | 357                    |
| VNI par action                   | £ 9,00                                                 | £ 9,12                 | £ 9,03                 |
| Investisseurs :                  |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 9 137                                               | \$ 9 604               | \$ 7 980               |
| Actions émises en circulation    | 541                                                    | 571                    | 499                    |
| VNI par action                   | \$ 16,90                                               | \$ 16,82               | \$ 15,98               |
| Distribution                     | \$ 611                                                 | \$ 348                 | \$ 725                 |
| Actions émises en circulation    | 60                                                     | 34                     | 72                     |
| VNI par action                   | \$ 10,13                                               | \$ 10,26               | \$ 10,07               |
| Administrations :                |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 1 869                                               | \$ 1 974               | \$ 1 995               |
| Actions émises en circulation    | 114                                                    | 121                    | 129                    |
| VNI par action                   | \$ 16,37                                               | \$ 16,30               | \$ 15,51               |
| Catégorie E :                    |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 36 320                                              | \$ 33 874              | \$ 31 906              |
| Actions émises en circulation    | 2 656                                                  | 2 482                  | 2 449                  |
| VNI par action                   | \$ 13,67                                               | \$ 13,65               | \$ 13,03               |
| Distribution                     | \$ 3 114                                               | \$ 3 084               | \$ 2 979               |
| Actions émises en circulation    | 296                                                    | 289                    | 285                    |
| VNI par action                   | \$ 10,53                                               | \$ 10,67               | \$ 10,47               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 10 156                                               | € 12 004               | € 11 806               |
| Actions émises en circulation    | 1 217                                                  | 1 429                  | 1 441                  |
| VNI par action                   | € 8,35                                                 | € 8,40                 | € 8,19                 |
| H Institutions :                 |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 58 153                                              | \$ 57 433              | \$ 31 317              |
| Actions émises en circulation    | 4 268                                                  | 4 240                  | 2 438                  |
| VNI par action                   | \$ 13,62                                               | \$ 13,55               | \$ 12,85               |
| Distribution                     | \$ 639                                                 | \$ 625                 | \$ 691                 |
| Actions émises en circulation    | 65                                                     | 63                     | 71                     |
| VNI par action                   | \$ 9,84                                                | \$ 9,97                | \$ 9,78                |
| Catégorie R :                    |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 8 620                                               | \$ 6 387               | \$ 4 571               |
| Actions émises en circulation    | 712                                                    | 530                    | 399                    |
| VNI par action                   | \$ 12,10                                               | \$ 12,04               | \$ 11,43               |
|                                  | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 688 209                                             | \$ 1 330 306           | \$ 1 084 966           |
| Institutions :                   |                                                        |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 385 183                                             | \$ 412 342             | \$ 331 273             |
| Actions émises en circulation    | 27 771                                                 | 30 024                 | 25 637                 |
| VNI par action                   | \$ 13,87                                               | \$ 13,73               | \$ 12,92               |

|                                  | Au<br>30 juin 2026                                             | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite) |                        |                        |
| Distribution                     | \$ 1 402                                                       | \$ 117 990             | \$ 51 434              |
| Actions émises en circulation    | 143                                                            | 11 934                 | 5 306                  |
| VNI par action                   | \$ 9,79                                                        | \$ 9,89                | \$ 9,69                |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 91 212                                                       | € 531 994              | € 564 775              |
| Actions émises en circulation    | 8 071                                                          | 47 120                 | 52 078                 |
| VNI par action                   | € 11,30                                                        | € 11,29                | € 10,84                |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | £ 88 270                                                       | £ 67 996               | £ 46 839               |
| Actions émises en circulation    | 6 830                                                          | 5 314                  | 3 886                  |
| VNI par action                   | £ 12,92                                                        | £ 12,80                | £ 12,05                |
| Distribution                     | O/S                                                            | O/S                    | £ 309                  |
| Actions émises en circulation    | O/S                                                            | O/S                    | 34                     |
| VNI par action                   | O/S                                                            | O/S                    | £ 9,10                 |
| Institutions en NOK (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | NOK 21 712                                                     | NOK 21 473             | NOK 23 908             |
| Actions émises en circulation    | 183                                                            | 182                    | 216                    |
| VNI par action                   | NOK 118,93                                                     | NOK 117,71             | NOK 110,78             |
| Institutions en SEK (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | SEK 312 123                                                    | SEK 312 225            | SEK 323 948            |
| Actions émises en circulation    | 2 800                                                          | 2 799                  | 3 018                  |
| VNI par action                   | SEK 111,49                                                     | SEK 111,55             | SEK 107,35             |
| Institutions en SGD (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | SGD 24 775                                                     | SGD 24 846             | SGD 337                |
| Actions émises en circulation    | 2 387                                                          | 2 387                  | 34                     |
| VNI par action                   | SGD 10,38                                                      | SGD 10,41              | SGD 10,02              |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 23 254                                                       | € 24 179               | € 25 799               |
| Actions émises en circulation    | 2 302                                                          | 2 385                  | 2 625                  |
| VNI par action                   | € 10,10                                                        | € 10,14                | € 9,83                 |
|                                  | Fonds Low Duration Income Fund                                 |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 8 510 176                                                   | \$ 5 208 161           | \$ 2 925 246           |
| Institutions :                   |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 2 386 425                                                   | \$ 1 700 105           | \$ 379 088             |
| Actions émises en circulation    | 169 890                                                        | 123 187                | 30 100                 |
| VNI par action                   | \$ 14,05                                                       | \$ 13,80               | \$ 12,59               |
| Distribution                     | \$ 1 164 258                                                   | \$ 249 400             | \$ 658 832             |
| Actions émises en circulation    | 113 641                                                        | 24 107                 | 66 000                 |
| VNI par action                   | \$ 10,25                                                       | \$ 10,35               | \$ 9,98                |
| Institutions en AUD (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | AUD 14                                                         | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation    | 1                                                              | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                   | AUD 10,07                                                      | O/S                    | O/S                    |
| Distribution                     | AUD 1 222 053                                                  | AUD 81 178             | AUD 286 742            |
| Actions émises en circulation    | 120 651                                                        | 7 935                  | 28 928                 |
| VNI par action                   | AUD 10,13                                                      | AUD 10,23              | AUD 9,91               |
| Institutions en CHF (couverte) : |                                                                |                        |                        |
| Capitalisation                   | CHF 8 920                                                      | CHF 75 938             | CHF 1 634              |
| Actions émises en circulation    | 797                                                            | 6 771                  | 153                    |
| VNI par action                   | CHF 11,19                                                      | CHF 11,21              | CHF 10,69              |



|                                       | Au<br>30 juin 2026                        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|---------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                       | Fonds Low Duration Income<br>Fund (suite) |                        |                        |
| Institutions en EUR (couverte) :      |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                        | € 1 029 976                               | € 922 264              | € 802 431              |
| Actions émises en circulation         | 86 003                                    | 77 686                 | 72 557                 |
| VNI par action                        | € 11,98                                   | € 11,87                | € 11,06                |
| Distribution                          | € 93 466                                  | € 83 852               | € 1 658                |
| Actions émises en circulation         | 10 230                                    | 8 997                  | 180                    |
| VNI par action                        | € 9,14                                    | € 9,32                 | € 9,19                 |
| Institutions en GBP (couverte) :      |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                        | £ 263 765                                 | £ 251 821              | £ 227 629              |
| Actions émises en circulation         | 19 927                                    | 19 356                 | 19 162                 |
| VNI par action                        | £ 13,24                                   | £ 13,01                | £ 11,88                |
| Distribution                          | £ 8 265                                   | £ 1 861                | £ 81 299               |
| Actions émises en circulation         | 861                                       | 192                    | 8 690                  |
| VNI par action                        | £ 9,60                                    | £ 9,69                 | £ 9,36                 |
| Institutions en HKD (non couverte) :  |                                           |                        |                        |
| Distribution                          | HKD 219                                   | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 22                                        | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                        | HKD 10,04                                 | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en RMB (couverte) :      |                                           |                        |                        |
| Distribution                          | CNH 857                                   | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 9                                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                        | CNH 100,04                                | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en SGD (couverte) :      |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                        | SGD 77 119                                | SGD 66 954             | SGD 30 581             |
| Actions émises en circulation         | 6 324                                     | 5 518                  | 2 699                  |
| VNI par action                        | SGD 12,19                                 | SGD 12,13              | SGD 11,33              |
| Distribution                          | SGD 43 361                                | SGD 31 738             | SGD 21 775             |
| Actions émises en circulation         | 4 409                                     | 3 150                  | 2 187                  |
| VNI par action                        | SGD 9,84                                  | SGD 10,08              | SGD 9,96               |
| Investisseurs :                       |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                        | \$ 178 924                                | \$ 21 215              | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 17 257                                    | 2 079                  | O/S                    |
| VNI par action                        | \$ 10,37                                  | \$ 10,20               | O/S                    |
| Distribution                          | \$ 103 855                                | \$ 15 312              | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 10 441                                    | 1 521                  | O/S                    |
| VNI par action                        | \$ 9,95                                   | \$ 10,07               | O/S                    |
| Investisseurs en AUD (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                        | AUD 14                                    | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 1                                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                        | AUD 10,06                                 | O/S                    | O/S                    |
| Distribution                          | AUD 316                                   | AUD 15                 | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 32                                        | 2                      | O/S                    |
| VNI par action                        | AUD 9,94                                  | AUD 10,06              | O/S                    |
| Investisseurs en EUR (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                        | € 44                                      | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 4                                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                        | € 10,06                                   | O/S                    | O/S                    |
| Distribution                          | € 1 707                                   | € 9                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 174                                       | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                        | € 9,82                                    | € 10,03                | O/S                    |
| Investisseurs en GBP (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Distribution                          | £ 400                                     | £ 7                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 40                                        | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                        | £ 9,94                                    | £ 10,06                | O/S                    |
| Investisseurs en HKD (non couverte) : |                                           |                        |                        |
| Distribution                          | HKD 12 235                                | HKD 80                 | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 1 220                                     | 8                      | O/S                    |
| VNI par action                        | HKD 10,03                                 | HKD 10,07              | O/S                    |
| Investisseurs en RMB (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Distribution                          | CNH 857                                   | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation         | 9                                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                        | CNH 100,00                                | O/S                    | O/S                    |

|                                     | Au<br>30 juin 2026                        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                     | Fonds Low Duration Income<br>Fund (suite) |                        |                        |
| Investisseurs en SGD (couverte) :   |                                           |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 3 495                                 | SGD 13                 | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 358                                       | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                      | SGD 9,77                                  | SGD 10,02              | O/S                    |
| Administrations en EUR (couverte) : |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 65 111                                  | € 76 426               | € 14 635               |
| Actions émises en circulation       | 5 803                                     | 6 855                  | 1 401                  |
| VNI par action                      | € 11,22                                   | € 11,15                | € 10,44                |
| Catégorie E :                       |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 676 857                                | \$ 489 826             | \$ 205 231             |
| Actions émises en circulation       | 51 697                                    | 37 910                 | 17 252                 |
| VNI par action                      | \$ 13,09                                  | \$ 12,92               | \$ 11,90               |
| Distribution                        | \$ 41 229                                 | \$ 33 128              | \$ 8 884               |
| Actions émises en circulation       | 4 293                                     | 3 398                  | 936                    |
| VNI par action                      | \$ 9,60                                   | \$ 9,75                | \$ 9,49                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 612 240                                 | € 498 956              | € 127 998              |
| Actions émises en circulation       | 54 917                                    | 44 949                 | 12 267                 |
| VNI par action                      | € 11,15                                   | € 11,10                | € 10,43                |
| Distribution                        | € 81 716                                  | € 71 411               | € 28 252               |
| Actions émises en circulation       | 10 046                                    | 8 563                  | 3 403                  |
| VNI par action                      | € 8,13                                    | € 8,34                 | € 8,30                 |
| Distribution II                     | € 433                                     | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 44                                        | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                      | € 9,89                                    | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie E en SGD (couverte) :     |                                           |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 1 840                                 | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 184                                       | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                      | SGD 9,98                                  | O/S                    | O/S                    |
| H Institutions :                    |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 270 435                                | \$ 89 444              | \$ 37 736              |
| Actions émises en circulation       | 20 862                                    | 7 017                  | 3 239                  |
| VNI par action                      | \$ 12,96                                  | \$ 12,75               | \$ 11,65               |
| Distribution                        | \$ 214 079                                | \$ 100 477             | \$ 21 273              |
| Actions émises en circulation       | 21 488                                    | 9 976                  | 2 185                  |
| VNI par action                      | \$ 9,96                                   | \$ 10,07               | \$ 9,74                |
| H Institutions en AUD (couverte) :  |                                           |                        |                        |
| Distribution                        | AUD 1 019                                 | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 103                                       | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                      | AUD 9,89                                  | O/S                    | O/S                    |
| H Institutions en SGD (couverte) :  |                                           |                        |                        |
| Distribution                        | SGD 13                                    | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation       | 1                                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                      | SGD 10,05                                 | O/S                    | O/S                    |
| Actif net                           | Fonds Low Duration Opportunities Fund     |                        |                        |
|                                     | \$ 1 065 653                              | \$ 886 858             | \$ 843 935             |
| Institutions :                      |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | \$ 154 900                                | \$ 28 832              | \$ 95 782              |
| Actions émises en circulation       | 11 121                                    | 2 107                  | 7 595                  |
| VNI par action                      | \$ 13,93                                  | \$ 13,68               | \$ 12,61               |
| Distribution                        | \$ 371                                    | \$ 27 094              | \$ 25 981              |
| Actions émises en circulation       | 35                                        | 2 535                  | 2 535                  |
| VNI par action                      | \$ 10,66                                  | \$ 10,69               | \$ 10,25               |
| Institutions en EUR (couverte) :    |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                      | € 8 800                                   | € 17 274               | € 17 170               |
| Actions émises en circulation       | 772                                       | 1 529                  | 1 615                  |
| VNI par action                      | € 11,40                                   | € 11,30                | € 10,63                |
| Distribution                        | O/S                                       | O/S                    | € 202                  |
| Actions émises en circulation       | O/S                                       | O/S                    | 22                     |
| VNI par action                      | O/S                                       | O/S                    | € 9,00                 |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                   | Au<br>30 juin 2026                            | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-----------------------------------|-----------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                   | Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite) |                        |                        |
| Institutions en GBP (couverte) :  |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | £ 330 108                                     | £ 256 640              | £ 234 989              |
| Actions émises en circulation     | 25 551                                        | 20 221                 | 20 073                 |
| VNI par action                    | £ 12,92                                       | £ 12,69                | £ 11,71                |
| Distribution                      | £ 332 431                                     | £ 335 083              | £ 322 902              |
| Actions émises en circulation     | 33 814                                        | 33 929                 | 33 652                 |
| VNI par action                    | £ 9,83                                        | £ 9,88                 | £ 9,60                 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | O/S                                           | O/S                    | € 1 616                |
| Actions émises en circulation     | O/S                                           | O/S                    | 161                    |
| VNI par action                    | O/S                                           | O/S                    | € 10,01                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :   |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 18 339                                      | € 12 557               | € 3 676                |
| Actions émises en circulation     | 1 784                                         | 1 229                  | 380                    |
| VNI par action                    | € 10,28                                       | € 10,22                | € 9,69                 |
|                                   | Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund     |                        |                        |
| Actif net                         | \$ 5 367                                      | \$ 5 294               | \$ 5 437               |
| Institutions :                    |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 5 367                                      | \$ 5 294               | \$ 4 909               |
| Actions émises en circulation     | 447                                           | 447                    | 447                    |
| VNI par action                    | \$ 12,01                                      | \$ 11,84               | \$ 10,98               |
| Distribution                      | O/S                                           | O/S                    | \$ 11                  |
| Actions émises en circulation     | O/S                                           | O/S                    | 1                      |
| VNI par action                    | O/S                                           | O/S                    | \$ 10,07               |
| Institutions en EUR (couverte) :  |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | O/S                                           | O/S                    | € 240                  |
| Actions émises en circulation     | O/S                                           | O/S                    | 23                     |
| VNI par action                    | O/S                                           | O/S                    | € 10,45                |
| Institutions en GBP (couverte) :  |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | O/S                                           | O/S                    | £ 214                  |
| Actions émises en circulation     | O/S                                           | O/S                    | 20                     |
| VNI par action                    | O/S                                           | O/S                    | £ 10,83                |
|                                   | Fonds MAARS Multi-Strategy Fund               |                        |                        |
| Actif net                         | \$ 38 302                                     | O/S                    | O/S                    |
| Institutions :                    |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 37 097                                     | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 3 672                                         | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                    | \$ 10,10                                      | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en CHF (couverte) :  |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | CHF 219                                       | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 22                                            | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                    | CHF 10,05                                     | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en EUR (couverte) :  |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 269                                         | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 27                                            | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                    | € 10,08                                       | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en GBP (couverte) :  |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | £ 275                                         | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 27                                            | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                    | £ 10,10                                       | O/S                    | O/S                    |
| Administrations :                 |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 10                                         | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 1                                             | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                    | \$ 9,91                                       | O/S                    | O/S                    |
| Catégorie Z en AUD (couverte) :   |                                               |                        |                        |
| Capitalisation                    | AUD 363                                       | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 36                                            | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                    | AUD 10,16                                     | O/S                    | O/S                    |

|                                  | Au<br>30 juin 2026                           | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|----------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 234 616                                   | \$ 168 821             | \$ 157 071             |
| Institutions :                   |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 18 197                                    | \$ 14 093              | \$ 14 607              |
| Actions émises en circulation    | 918                                          | 827                    | 912                    |
| VNI par action                   | \$ 19,82                                     | \$ 17,05               | \$ 16,01               |
| Distribution                     | \$ 16 276                                    | \$ 13 497              | \$ 12 533              |
| Actions émises en circulation    | 1 609                                        | 1 503                  | 1 384                  |
| VNI par action                   | \$ 10,12                                     | \$ 8,98                | \$ 9,05                |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 92 842                                     | € 64 305               | € 79 144               |
| Actions émises en circulation    | 5 885                                        | 4 700                  | 6 028                  |
| VNI par action                   | € 15,77                                      | € 13,68                | € 13,13                |
| Distribution                     | € 1 772                                      | € 2 177                | € 2 105                |
| Actions émises en circulation    | 221                                          | 303                    | 285                    |
| VNI par action                   | € 8,01                                       | € 7,19                 | € 7,40                 |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | £ 3 063                                      | £ 2 851                | £ 2 475                |
| Actions émises en circulation    | 182                                          | 197                    | 181                    |
| VNI par action                   | £ 16,85                                      | £ 14,49                | £ 13,66                |
| Catégorie E :                    |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 5 814                                     | \$ 1 072               | O/S                    |
| Actions émises en circulation    | 503                                          | 107                    | O/S                    |
| VNI par action                   | \$ 11,56                                     | \$ 9,99                | O/S                    |
| Distribution                     | \$ 82 092                                    | \$ 58 244              | \$ 42 698              |
| Actions émises en circulation    | 9 244                                        | 7 358                  | 5 296                  |
| VNI par action                   | \$ 8,88                                      | \$ 7,92                | \$ 8,06                |
|                                  | Fonds Mortgage Opportunities Fund            |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 2 936 137                                 | \$ 2 559 903           | \$ 1 791 316           |
| Institutions :                   |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 1 524 845                                 | \$ 1 188 446           | \$ 755 405             |
| Actions émises en circulation    | 113 891                                      | 90 280                 | 61 914                 |
| VNI par action                   | \$ 13,39                                     | \$ 13,16               | \$ 12,20               |
| Distribution                     | \$ 103 514                                   | \$ 104 386             | \$ 58 331              |
| Actions émises en circulation    | 11 158                                       | 11 180                 | 6 440                  |
| VNI par action                   | \$ 9,28                                      | \$ 9,34                | \$ 9,06                |
| Institutions en CAD (couverte) : |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | CAD 46 684                                   | CAD 46 263             | CAD 43 621             |
| Actions émises en circulation    | 4 206                                        | 4 206                  | 4 206                  |
| VNI par action                   | CAD 11,10                                    | CAD 11,00              | CAD 10,37              |
| Institutions en CHF (couverte) : |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | CHF 5 653                                    | CHF 1 867              | CHF 1 974              |
| Actions émises en circulation    | 562                                          | 185                    | 202                    |
| VNI par action                   | CHF 10,06                                    | CHF 10,08              | CHF 9,76               |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 784 001                                    | € 759 230              | € 657 138              |
| Actions émises en circulation    | 70 383                                       | 68 720                 | 62 836                 |
| VNI par action                   | € 11,14                                      | € 11,05                | € 10,46                |
| Distribution                     | € 7 829                                      | € 7 056                | € 7 551                |
| Actions émises en circulation    | 1 017                                        | 902                    | 974                    |
| VNI par action                   | € 7,70                                       | € 7,82                 | € 7,75                 |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                              |                        |                        |
| Capitalisation                   | £ 9 135                                      | £ 8 634                | £ 5 170                |
| Actions émises en circulation    | 730                                          | 702                    | 453                    |
| VNI par action                   | £ 12,51                                      | £ 12,30                | £ 11,41                |
| Distribution                     | £ 47 098                                     | £ 26 842               | £ 19 137               |
| Actions émises en circulation    | 5 445                                        | 3 082                  | 2 263                  |
| VNI par action                   | £ 8,65                                       | £ 8,71                 | £ 8,46                 |

|                                                | Au<br>30 juin 2026                        | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|------------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                                | Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite) |                        |                        |
| Investisseurs :                                |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | \$ 33 371                                 | \$ 33 685              | \$ 23 016              |
| Actions émises en circulation                  | 2 630                                     | 2 695                  | 1 980                  |
| VNI par action                                 | \$ 12,69                                  | \$ 12,50               | \$ 11,62               |
| Distribution                                   | \$ 6 638                                  | \$ 5 337               | \$ 5 820               |
| Actions émises en circulation                  | 716                                       | 572                    | 643                    |
| VNI par action                                 | \$ 9,27                                   | \$ 9,33                | \$ 9,06                |
| Catégorie E :                                  |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | \$ 105 310                                | \$ 103 221             | \$ 86 519              |
| Actions émises en circulation                  | 8 556                                     | 8 492                  | 7 611                  |
| VNI par action                                 | \$ 12,31                                  | \$ 12,15               | \$ 11,37               |
| Distribution                                   | \$ 11 005                                 | \$ 10 799              | \$ 16 130              |
| Actions émises en circulation                  | 1 188                                     | 1 158                  | 1 783                  |
| VNI par action                                 | \$ 9,26                                   | \$ 9,32                | \$ 9,04                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | € 13 405                                  | € 13 573               | € 13 179               |
| Actions émises en circulation                  | 1 310                                     | 1 332                  | 1 354                  |
| VNI par action                                 | € 10,23                                   | € 10,19                | € 9,74                 |
| H Institutions :                               |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | \$ 85 190                                 | \$ 83 589              | \$ 53 624              |
| Actions émises en circulation                  | 6 949                                     | 6 929                  | 4 788                  |
| VNI par action                                 | \$ 12,26                                  | \$ 12,06               | \$ 11,20               |
| Distribution                                   | \$ 1 072                                  | \$ 1 298               | \$ 518                 |
| Actions émises en circulation                  | 101                                       | 121                    | 50                     |
| VNI par action                                 | \$ 10,65                                  | \$ 10,72               | \$ 10,41               |
| Catégorie Z :                                  |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | \$ 30 018                                 | \$ 29 412              | \$ 27 071              |
| Actions émises en circulation                  | 2 402                                     | 2 402                  | 2 402                  |
| VNI par action                                 | \$ 12,50                                  | \$ 12,24               | \$ 11,27               |
| Actif net                                      | \$ 263 931                                | \$ 203 445             | \$ 178 901             |
| Institutions :                                 |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | \$ 140 243                                | \$ 120 177             | \$ 94 840              |
| Actions émises en circulation                  | 9 349                                     | 8 413                  | 7 683                  |
| VNI par action                                 | \$ 15,00                                  | \$ 14,29               | \$ 12,34               |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | € 15 549                                  | € 11 428               | € 14 359               |
| Actions émises en circulation                  | 1 310                                     | 1 010                  | 1 402                  |
| VNI par action                                 | € 11,87                                   | € 11,31                | € 10,24                |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) : |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | £ 1 149                                   | £ 1 572                | £ 1 438                |
| Actions émises en circulation                  | 77                                        | 110                    | 115                    |
| VNI par action                                 | £ 14,99                                   | £ 14,24                | £ 12,53                |
| Administrations :                              |                                           |                        |                        |
| Distribution II                                | \$ 1 195                                  | \$ 749                 | \$ 1 465               |
| Actions émises en circulation                  | 118                                       | 76                     | 166                    |
| VNI par action                                 | \$ 10,11                                  | \$ 9,85                | \$ 8,83                |
| Administrations en SGD (couverte) :            |                                           |                        |                        |
| Distribution II                                | SGD 4 613                                 | SGD 2 904              | SGD 3 067              |
| Actions émises en circulation                  | 471                                       | 302                    | 345                    |
| VNI par action                                 | SGD 9,79                                  | SGD 9,63               | SGD 8,90               |
| Catégorie E :                                  |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | \$ 34 140                                 | \$ 24 248              | \$ 23 096              |
| Actions émises en circulation                  | 2 639                                     | 1 960                  | 2 141                  |
| VNI par action                                 | \$ 12,94                                  | \$ 12,37               | \$ 10,79               |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :  |                                           |                        |                        |
| Capitalisation                                 | € 52 850                                  | € 30 544               | € 34 950               |
| Actions émises en circulation                  | 4 673                                     | 2 822                  | 3 535                  |
| VNI par action                                 | € 11,31                                   | € 10,82                | € 9,89                 |

|                                      | Au<br>30 juin 2026                    | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                      | Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund(3) |                        |                        |
| Distribution                         | € 4 426                               | € 3 921                | € 4 240                |
| Actions émises en circulation        | 452                                   | 414                    | 482                    |
| VNI par action                       | € 9,79                                | € 9,48                 | € 8,79                 |
| Actif net                            | \$ 6 531 842                          | \$ 6 170 237           | \$ 5 022 355           |
| Institutions :                       |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 4 978 144                          | \$ 4 569 465           | \$ 3 903 688           |
| Actions émises en circulation        | 51 973                                | 52 595                 | 52 923                 |
| VNI par action                       | \$ 95,78                              | \$ 86,88               | \$ 73,76               |
| Distribution                         | \$ 49 770                             | \$ 45 336              | \$ 38 395              |
| Actions émises en circulation        | 831                                   | 818                    | 782                    |
| VNI par action                       | \$ 59,92                              | \$ 55,43               | \$ 49,10               |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 208 136                             | € 174 140              | € 144 766              |
| Actions émises en circulation        | 4 116                                 | 3 756                  | 3 597                  |
| VNI par action                       | € 50,56                               | € 46,36                | € 40,24                |
| Institutions en EUR (non couverte) : |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 135 388                             | € 110 463              | € 5 318                |
| Actions émises en circulation        | 9 780                                 | 9 037                  | 452                    |
| VNI par action                       | € 13,84                               | € 12,22                | € 11,77                |
| Investisseurs :                      |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 8 112                              | \$ 6 634               | \$ 52 720              |
| Actions émises en circulation        | 93                                    | 84                     | 781                    |
| VNI par action                       | \$ 87,20                              | \$ 79,23               | \$ 67,52               |
| BE Détail :                          |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 73 532                             | \$ 63 792              | \$ 42 924              |
| Actions émises en circulation        | 4 413                                 | 4 182                  | 3 234                  |
| VNI par action                       | \$ 16,66                              | \$ 15,25               | \$ 13,27               |
| BM Détail :                          |                                       |                        |                        |
| Distribution II                      | \$ 6 332                              | \$ 34                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 564                                   | 3                      | O/S                    |
| VNI par action                       | \$ 11,23                              | \$ 10,62               | O/S                    |
| Catégorie E :                        |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 426 702                            | \$ 358 565             | \$ 305 598             |
| Actions émises en circulation        | 5 317                                 | 4 904                  | 4 878                  |
| VNI par action                       | \$ 80,25                              | \$ 73,12               | \$ 62,64               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :      |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 61 890                              | € 59 506               | € 57 554               |
| Actions émises en circulation        | 2 499                                 | 2 609                  | 2 880                  |
| VNI par action                       | € 24,77                               | € 22,81                | € 19,98                |
| H Institutions :                     |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 525 312                            | \$ 722 259             | \$ 464 021             |
| Actions émises en circulation        | 22 091                                | 33 454                 | 25 267                 |
| VNI par action                       | \$ 23,78                              | \$ 21,59               | \$ 18,36               |
| M Détail :                           |                                       |                        |                        |
| Distribution II                      | \$ 429                                | \$ 12                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 36                                    | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                       | \$ 11,76                              | \$ 11,05               | O/S                    |
| Actif net                            | \$ 13 370                             | \$ 11 905              | \$ 10 118              |
| Institutions :                       |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 13 360                             | \$ 11 905              | \$ 10 118              |
| Actions émises en circulation        | 455                                   | 445                    | 452                    |
| VNI par action                       | \$ 29,35                              | \$ 26,78               | \$ 22,40               |
| Administrations :                    |                                       |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 10                                 | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 1                                     | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                       | \$ 10,19                              | O/S                    | O/S                    |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                      | Au<br>30 juin 2026          | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|
|                                      | Fonds Strategic Income Fund |                        |                        |
| Actif net                            | \$ 2 759 447                | \$ 2 372 262           | \$ 2 318 366           |
| Institutions :                       |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 43 056                   | \$ 41 087              | \$ 36 013              |
| Actions émises en circulation        | 2 693                       | 2 702                  | 2 720                  |
| VNI par action                       | \$ 15,99                    | \$ 15,21               | \$ 13,24               |
| Distribution II                      | \$ 4 923                    | \$ 4 780               | \$ 4 376               |
| Actions émises en circulation        | 450                         | 448                    | 448                    |
| VNI par action                       | \$ 10,93                    | \$ 10,66               | \$ 9,76                |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 714 818                   | € 683 733              | € 729 868              |
| Actions émises en circulation        | 41 747                      | 41 724                 | 49 762                 |
| VNI par action                       | € 17,12                     | € 16,39                | € 14,67                |
| Institutions en EUR (non couverte) : |                             |                        |                        |
| Distribution                         | € 14 685                    | O/S                    | O/S                    |
| Actions émises en circulation        | 1 439                       | O/S                    | O/S                    |
| VNI par action                       | € 10,21                     | O/S                    | O/S                    |
| Institutions en GBP (couverte) :     |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | £ 13 117                    | £ 13 111               | £ 258 188              |
| Actions émises en circulation        | 1 090                       | 1 148                  | 25 775                 |
| VNI par action                       | £ 12,03                     | £ 11,42                | £ 10,02                |
| Distribution                         | £ 945                       | £ 1 333                | £ 1 326                |
| Actions émises en circulation        | 81                          | 118                    | 129                    |
| VNI par action                       | £ 11,62                     | £ 11,27                | £ 10,31                |
| Institutions en ILS (couverte) :     |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | ILS 21 610                  | ILS 20 877             | ILS 20 953             |
| Actions émises en circulation        | 1 816                       | 1 843                  | 2 099                  |
| VNI par action                       | ILS 11,90                   | ILS 11,33              | ILS 9,98               |
| Institutions en SGD (couverte) :     |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | SGD 104 987                 | SGD 95 947             | SGD 86 507             |
| Actions émises en circulation        | 9 080                       | 8 635                  | 8 682                  |
| VNI par action                       | SGD 11,56                   | SGD 11,11              | SGD 9,96               |
| Investisseurs en EUR (couverte) :    |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 4 701                     | € 3 652                | € 5 403                |
| Actions émises en circulation        | 406                         | 329                    | 542                    |
| VNI par action                       | € 11,57                     | € 11,10                | € 9,96                 |
| Catégorie E :                        |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 175 745                  | \$ 149 865             | \$ 123 917             |
| Actions émises en circulation        | 9 585                       | 8 555                  | 8 052                  |
| VNI par action                       | \$ 18,34                    | \$ 17,52               | \$ 15,39               |
| Distribution II                      | \$ 57 633                   | \$ 46 824              | \$ 32 371              |
| Actions émises en circulation        | 5 495                       | 4 556                  | 3 409                  |
| VNI par action                       | \$ 10,49                    | \$ 10,28               | \$ 9,50                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :      |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 1 034 009                 | € 797 260              | € 711 925              |
| Actions émises en circulation        | 67 711                      | 54 305                 | 53 703                 |
| VNI par action                       | € 15,27                     | € 14,68                | € 13,26                |
| Distribution II                      | € 156 449                   | € 104 510              | € 74 371               |
| Actions émises en circulation        | 17 996                      | 12 187                 | 9 141                  |
| VNI par action                       | € 8,69                      | € 8,58                 | € 8,14                 |
| M Détail :                           |                             |                        |                        |
| Distribution II                      | \$ 15 304                   | \$ 16 581              | \$ 19 655              |
| Actions émises en circulation        | 1 423                       | 1 574                  | 2 018                  |
| VNI par action                       | \$ 10,76                    | \$ 10,54               | \$ 9,74                |
| M Détail en SGD (couverte) :         |                             |                        |                        |
| Distribution II                      | SGD 4 596                   | SGD 4 536              | SGD 6 154              |
| Actions émises en circulation        | 443                         | 442                    | 627                    |
| VNI par action                       | SGD 10,36                   | SGD 10,26              | SGD 9,81               |
| Catégorie T en EUR (couverte) :      |                             |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 69 436                    | € 61 878               | € 62 309               |
| Actions émises en circulation        | 5 167                       | 4 780                  | 5 309                  |
| VNI par action                       | € 13,44                     | € 12,95                | € 11,74                |
| Distribution                         | € 17 955                    | € 12 660               | € 8 974                |
| Actions émises en circulation        | 1 782                       | 1 285                  | 975                    |
| VNI par action                       | € 10,08                     | € 9,85                 | € 9,20                 |

|                                      | Au<br>30 juin 2026                  | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                      | Fonds Strategic Income Fund (suite) |                        |                        |
| Catégorie Z en EUR (couverte) :      |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 45 278                            | € 46 904               | € 52 100               |
| Actions émises en circulation        | 3 794                               | 4 123                  | 5 158                  |
| VNI par action                       | € 11,93                             | € 11,38                | € 10,10                |
|                                      | Fonds Total Return Bond Fund        |                        |                        |
| Actif net                            | \$ 4 223 804                        | \$ 4 408 319           | \$ 4 003 163           |
| Institutions :                       |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 1 722 220                        | \$ 1 560 318           | \$ 1 451 787           |
| Actions émises en circulation        | 49 413                              | 45 201                 | 45 992                 |
| VNI par action                       | \$ 34,85                            | \$ 34,52               | \$ 31,57               |
| Distribution                         | \$ 367 805                          | \$ 422 868             | \$ 156 516             |
| Actions émises en circulation        | 23 633                              | 26 854                 | 10 457                 |
| VNI par action                       | \$ 15,56                            | \$ 15,75               | \$ 14,97               |
| Institutions en CAD (couverte) :     |                                     |                        |                        |
| Distribution                         | CAD 10 472                          | CAD 10 677             | CAD 13 701             |
| Actions émises en circulation        | 1 209                               | 1 207                  | 1 603                  |
| VNI par action                       | CAD 8,66                            | CAD 8,85               | CAD 8,55               |
| Institutions en CHF (couverte) :     |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | O/S                                 | O/S                    | CHF 2 644              |
| Actions émises en circulation        | O/S                                 | O/S                    | 270                    |
| VNI par action                       | O/S                                 | O/S                    | CHF 9,80               |
| Institutions en EUR (couverte) :     |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 288 020                           | € 258 993              | € 324 321              |
| Actions émises en circulation        | 13 231                              | 11 905                 | 15 969                 |
| VNI par action                       | € 21,77                             | € 21,75                | € 20,31                |
| Distribution                         | € 178 244                           | € 180 077              | € 198 569              |
| Actions émises en circulation        | 15 397                              | 15 227                 | 17 318                 |
| VNI par action                       | € 11,58                             | € 11,83                | € 11,47                |
| Institutions en EUR (non couverte) : |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 3 946                             | € 4 166                | € 5 518                |
| Actions émises en circulation        | 129                                 | 142                    | 181                    |
| VNI par action                       | € 30,48                             | € 29,39                | € 30,48                |
| Institutions en GBP (couverte) :     |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | £ 15 205                            | £ 10 541               | £ 8 630                |
| Actions émises en circulation        | 1 043                               | 730                    | 653                    |
| VNI par action                       | £ 14,58                             | £ 14,45                | £ 13,21                |
| Distribution                         | £ 7 076                             | £ 6 975                | £ 16 802               |
| Actions émises en circulation        | 828                                 | 806                    | 2 044                  |
| VNI par action                       | £ 8,54                              | £ 8,65                 | £ 8,22                 |
| Institutions en SGD (couverte) :     |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | SGD 7 753                           | SGD 7 553              | SGD 6 952              |
| Actions émises en circulation        | 567                                 | 550                    | 541                    |
| VNI par action                       | SGD 13,68                           | SGD 13,73              | SGD 12,84              |
| Investisseurs :                      |                                     |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 253 316                          | \$ 261 636             | \$ 328 398             |
| Actions émises en circulation        | 8 012                               | 8 341                  | 11 409                 |
| VNI par action                       | \$ 31,62                            | \$ 31,37               | \$ 28,78               |
| Distribution                         | \$ 24 980                           | \$ 27 251              | \$ 35 384              |
| Actions émises en circulation        | 1 582                               | 1 706                  | 2 331                  |
| VNI par action                       | \$ 15,79                            | \$ 15,97               | \$ 15,18               |

|                                      | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------|--------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Total Return Bond Fund (suite) |                    |                        |                        |
| Investisseurs en CHF (couverte) :    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | O/S                | O/S                    | CHF 1 732              |
| Actions émises en circulation        | O/S                | O/S                    | 185                    |
| VNI par action                       | O/S                | O/S                    | CHF 9,35               |
| Investisseurs en EUR (couverte) :    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 8 004            | € 9 201                | € 16 422               |
| Actions émises en circulation        | 396                | 455                    | 867                    |
| VNI par action                       | € 20,20            | € 20,22                | € 18,94                |
| Administrations :                    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 81 458          | \$ 107 317             | \$ 112 282             |
| Actions émises en circulation        | 2 623              | 3 481                  | 3 963                  |
| VNI par action                       | \$ 31,05           | \$ 30,83               | \$ 28,34               |
| Distribution                         | \$ 22 066          | \$ 23 629              | \$ 36 194              |
| Actions émises en circulation        | 2 188              | 2 316                  | 3 733                  |
| VNI par action                       | \$ 10,08           | \$ 10,20               | \$ 9,70                |
| Administrations en EUR (couverte) :  |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 1 784            | € 2 247                | € 2 452                |
| Actions émises en circulation        | 149                | 187                    | 218                    |
| VNI par action                       | € 11,98            | € 12,01                | € 11,26                |
| Catégorie E :                        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 228 092         | \$ 247 823             | \$ 367 900             |
| Actions émises en circulation        | 7 854              | 8 577                  | 13 800                 |
| VNI par action                       | \$ 29,04           | \$ 28,89               | \$ 26,66               |
| Distribution                         | \$ 116 640         | \$ 125 866             | \$ 130 807             |
| Actions émises en circulation        | 9 849              | 10 504                 | 11 486                 |
| VNI par action                       | \$ 11,84           | \$ 11,98               | \$ 11,39               |
| Catégorie E en CHF (couverte) :      |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | CHF 10 337         | CHF 11 261             | CHF 11 525             |
| Actions émises en circulation        | 1 235              | 1 325                  | 1 406                  |
| VNI par action                       | CHF 8,37           | CHF 8,50               | CHF 8,20               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :      |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 302 484          | € 329 385              | € 358 418              |
| Actions émises en circulation        | 16 663             | 18 075                 | 20 880                 |
| VNI par action                       | € 18,15            | € 18,22                | € 17,17                |
| Distribution                         | € 21 633           | € 24 360               | € 29 043               |
| Actions émises en circulation        | 2 802              | 3 090                  | 3 798                  |
| VNI par action                       | € 7,72             | € 7,88                 | € 7,65                 |
| Catégorie E en SGD (couverte) :      |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | SGD 21 336         | SGD 27 484             | SGD 30 510             |
| Actions émises en circulation        | 540                | 690                    | 812                    |
| VNI par action                       | SGD 39,51          | SGD 39,82              | SGD 37,58              |
| H Institutions :                     |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 382 471         | \$ 575 945             | \$ 297 756             |
| Actions émises en circulation        | 11 394             | 17 310                 | 9 769                  |
| VNI par action                       | \$ 33,57           | \$ 33,27               | \$ 30,48               |
| Distribution                         | \$ 12 155          | \$ 11 278              | \$ 10 300              |
| Actions émises en circulation        | 1 274              | 1 168                  | 1 123                  |
| VNI par action                       | \$ 9,54            | \$ 9,65                | \$ 9,18                |
| M Détail en HKD (non couverte) :     |                    |                        |                        |
| Distribution                         | HKD 78 747         | HKD 80 021             | HKD 77 701             |
| Actions émises en circulation        | 8 377              | 8 478                  | 8 676                  |
| VNI par action                       | HKD 9,40           | HKD 9,44               | HKD 8,96               |
| Catégorie R en EUR (couverte) :      |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 2 469            | € 2 437                | € 2 266                |
| Actions émises en circulation        | 240                | 237                    | 236                    |
| VNI par action                       | € 10,27            | € 10,28                | € 9,62                 |
| Catégorie T :                        |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | \$ 3 357           | \$ 3 474               | \$ 4 771               |
| Actions émises en circulation        | 297                | 308                    | 457                    |
| VNI par action                       | \$ 11,32           | \$ 11,28               | \$ 10,44               |
| Catégorie T en EUR (couverte) :      |                    |                        |                        |
| Capitalisation                       | € 4 178            | € 4 686                | € 4 256                |
| Actions émises en circulation        | 454                | 506                    | 487                    |
| VNI par action                       | € 9,21             | € 9,26                 | € 8,75                 |

|                                                  | Au<br>30 juin 2026 | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|--------------------------------------------------|--------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |                    |                        |                        |
| Actif net                                        | \$ 165 019         | \$ 106 020             | \$ 219 485             |
| Institutions :                                   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | \$ 73 742          | \$ 47 540              | \$ 96 840              |
| Actions émises en circulation                    | 5 741              | 3 919                  | 8 129                  |
| VNI par action                                   | \$ 12,84           | \$ 12,13               | \$ 11,91               |
| Institutions en EUR (couverte) :                 |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | € 32 842           | € 8 555                | € 25 832               |
| Actions émises en circulation                    | 3 085              | 843                    | 2 535                  |
| VNI par action                                   | € 10,65            | € 10,15                | € 10,19                |
| Institutions en GBP (couverte) :                 |                    |                        |                        |
| Distribution                                     | £ 599              | £ 422                  | £ 30 058               |
| Actions émises en circulation                    | 100                | 74                     | 3 708                  |
| VNI par action                                   | £ 5,99             | £ 5,74                 | £ 8,11                 |
| Catégorie E :                                    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | \$ 3 801           | \$ 7 104               | \$ 12 507              |
| Actions émises en circulation                    | 334                | 657                    | 1 165                  |
| VNI par action                                   | \$ 11,38           | \$ 10,81               | \$ 10,74               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :                  |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | € 4 554            | € 4 574                | € 6 435                |
| Actions émises en circulation                    | 483                | 506                    | 701                    |
| VNI par action                                   | € 9,43             | € 9,04                 | € 9,18                 |
| H Institutions :                                 |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | \$ 7 495           | \$ 4 222               | \$ 1 405               |
| Actions émises en circulation                    | 741                | 441                    | 149                    |
| VNI par action                                   | \$ 10,12           | \$ 9,57                | \$ 9,41                |
| Catégorie Z :                                    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | \$ 36 432          | \$ 31 166              | \$ 37 674              |
| Actions émises en circulation                    | 3 090              | 2 817                  | 3 516                  |
| VNI par action                                   | \$ 11,79           | \$ 11,06               | \$ 10,72               |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                     |                    |                        |                        |
| Actif net                                        | £ 226 361          | £ 222 109              | £ 213 133              |
| Institutions :                                   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | £ 27 481           | £ 28 969               | £ 34 693               |
| Actions émises en circulation                    | 1 246              | 1 327                  | 1 711                  |
| VNI par action                                   | £ 22,06            | £ 21,83                | £ 20,27                |
| Distribution                                     | £ 25 032           | £ 30 997               | £ 40 899               |
| Actions émises en circulation                    | 2 985              | 3 629                  | 4 772                  |
| VNI par action                                   | £ 8,39             | £ 8,54                 | £ 8,57                 |
| H Institutions :                                 |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | £ 122 398          | £ 111 344              | £ 90 571               |
| Actions émises en circulation                    | 12 212             | 10 950                 | 9 165                  |
| VNI par action                                   | £ 10,02            | £ 10,17                | £ 9,88                 |
| Catégorie Z :                                    |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | £ 51 450           | £ 50 799               | £ 46 970               |
| Actions émises en circulation                    | 4 924              | 4 924                  | 4 924                  |
| VNI par action                                   | £ 10,45            | £ 10,32                | £ 9,54                 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund           |                    |                        |                        |
| Actif net                                        | £ 24 727           | £ 25 844               | £ 114 440              |
| Institutions :                                   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | £ 23 558           | £ 24 654               | £ 84 533               |
| Actions émises en circulation                    | 1 034              | 1 083                  | 4 040                  |
| VNI par action                                   | £ 22,79            | £ 22,76                | £ 20,92                |
| Distribution                                     | £ 1 169            | £ 1 190                | £ 29 907               |
| Actions émises en circulation                    | 106                | 105                    | 2 733                  |
| VNI par action                                   | £ 10,99            | £ 11,30                | £ 10,95                |
| Fonds US High Yield Bond Fund                    |                    |                        |                        |
| Actif net                                        | \$ 1 523 774       | \$ 1 735 681           | \$ 1 714 223           |
| Institutions :                                   |                    |                        |                        |
| Capitalisation                                   | \$ 465 618         | \$ 685 805             | \$ 651 744             |
| Actions émises en circulation                    | 9 674              | 14 418                 | 14 918                 |
| VNI par action                                   | \$ 48,13           | \$ 47,57               | \$ 43,69               |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

|                                   | Au<br>30 juin 2026                       | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|-----------------------------------|------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                   | Fonds US High Yield<br>Bond Fund (suite) |                        |                        |
| Distribution                      | \$ 53 938                                | \$ 59 114              | \$ 146 993             |
| Actions émises en circulation     | 5 976                                    | 6 411                  | 16 251                 |
| VNI par action                    | \$ 9,03                                  | \$ 9,22                | \$ 9,05                |
| Institutions en EUR (couverte) :  |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 292 489                                | € 277 428              | € 246 494              |
| Actions émises en circulation     | 8 545                                    | 8 126                  | 7 701                  |
| VNI par action                    | € 34,23                                  | € 34,14                | € 32,01                |
| Distribution                      | € 91 508                                 | € 3 830                | € 4 120                |
| Actions émises en circulation     | 9 520                                    | 386                    | 415                    |
| VNI par action                    | € 9,61                                   | € 9,92                 | € 9,92                 |
| Institutions en GBP (couverte) :  |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | £ 14 249                                 | £ 11 873               | £ 13 635               |
| Actions émises en circulation     | 511                                      | 431                    | 538                    |
| VNI par action                    | £ 27,86                                  | £ 27,56                | £ 25,33                |
| Distribution                      | £ 2 501                                  | £ 2 869                | £ 2 934                |
| Actions émises en circulation     | 293                                      | 329                    | 342                    |
| VNI par action                    | £ 8,52                                   | £ 8,73                 | £ 8,57                 |
| Investisseurs :                   |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 196 583                               | \$ 225 777             | \$ 230 775             |
| Actions émises en circulation     | 4 631                                    | 5 373                  | 5 959                  |
| VNI par action                    | \$ 42,45                                 | \$ 42,02               | \$ 38,73               |
| Distribution                      | \$ 9 533                                 | \$ 10 142              | \$ 11 084              |
| Actions émises en circulation     | 1 306                                    | 1 359                  | 1 514                  |
| VNI par action                    | \$ 7,30                                  | \$ 7,46                | \$ 7,32                |
| Investisseurs en EUR (couverte) : |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 11 402                                 | € 11 389               | € 11 090               |
| Actions émises en circulation     | 374                                      | 374                    | 387                    |
| VNI par action                    | € 30,50                                  | € 30,47                | € 28,67                |
| BM Détail :                       |                                          |                        |                        |
| Décumulation                      | \$ 21                                    | \$ 10                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 2                                        | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                    | \$ 9,41                                  | \$ 9,89                | O/S                    |
| Catégorie E :                     |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 145 395                               | \$ 143 975             | \$ 131 905             |
| Actions émises en circulation     | 3 622                                    | 3 613                  | 3 572                  |
| VNI par action                    | \$ 40,14                                 | \$ 39,85               | \$ 36,93               |
| Distribution                      | \$ 55 273                                | \$ 60 132              | \$ 51 251              |
| Actions émises en circulation     | 5 741                                    | 6 113                  | 5 310                  |
| VNI par action                    | \$ 9,63                                  | \$ 9,84                | \$ 9,65                |
| Catégorie E en EUR (couverte) :   |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | € 43 720                                 | € 47 383               | € 47 953               |
| Actions émises en circulation     | 1 533                                    | 1 659                  | 1 775                  |
| VNI par action                    | € 28,52                                  | € 28,56                | € 27,02                |
| H Institutions :                  |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 45 135                                | \$ 97 117              | \$ 116 900             |
| Actions émises en circulation     | 975                                      | 2 122                  | 2 776                  |
| VNI par action                    | \$ 46,28                                 | \$ 45,78               | \$ 42,12               |
| Distribution                      | \$ 13 393                                | \$ 20 838              | \$ 8 968               |
| Actions émises en circulation     | 1 501                                    | 2 285                  | 1 003                  |
| VNI par action                    | \$ 8,92                                  | \$ 9,12                | \$ 8,95                |
| M Détail :                        |                                          |                        |                        |
| Décumulation                      | \$ 11                                    | \$ 10                  | O/S                    |
| Actions émises en circulation     | 1                                        | 1                      | O/S                    |
| VNI par action                    | \$ 9,49                                  | \$ 9,92                | O/S                    |
| Distribution                      | \$ 3 835                                 | \$ 3 078               | \$ 3 658               |
| Actions émises en circulation     | 393                                      | 309                    | 374                    |
| VNI par action                    | \$ 9,75                                  | \$ 9,96                | \$ 9,77                |
| Catégorie R :                     |                                          |                        |                        |
| Capitalisation                    | \$ 1 137                                 | \$ 1 020               | \$ 3 465               |
| Actions émises en circulation     | 60                                       | 55                     | 201                    |
| VNI par action                    | \$ 18,87                                 | \$ 18,68               | \$ 17,20               |

|                                  | Au<br>30 juin 2026                               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|--------------------------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds US High Yield Bond Fund<br>(suite)         |                        |                        |
| Catégorie Z :                    |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 9 626                                         | \$ 9 487               | \$ 16 079              |
| Actions émises en circulation    | 544                                              | 544                    | 1 010                  |
| VNI par action                   | \$ 17,69                                         | \$ 17,43               | \$ 15,92               |
|                                  | Fonds US Investment Grade Corporate<br>Bond Fund |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 445 509                                       | \$ 393 292             | \$ 493 892             |
| Institutions :                   |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 184 966                                       | \$ 191 849             | \$ 206 607             |
| Actions émises en circulation    | 14 269                                           | 14 917                 | 17 450                 |
| VNI par action                   | \$ 12,96                                         | \$ 12,86               | \$ 11,84               |
| Distribution                     | \$ 29 200                                        | \$ 23 452              | \$ 56 595              |
| Actions émises en circulation    | 3 244                                            | 2 566                  | 6 429                  |
| VNI par action                   | \$ 9,00                                          | \$ 9,14                | \$ 8,80                |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 97 571                                         | € 63 698               | € 126 670              |
| Actions émises en circulation    | 9 242                                            | 6 028                  | 12 751                 |
| VNI par action                   | € 10,56                                          | € 10,57                | € 9,93                 |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                                  |                        |                        |
| Distribution II                  | £ 28 791                                         | £ 20 953               | £ 19 008               |
| Actions émises en circulation    | 3 701                                            | 2 643                  | 2 479                  |
| VNI par action                   | £ 7,78                                           | £ 7,93                 | £ 7,67                 |
| Catégorie E :                    |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 64 943                                        | \$ 59 625              | \$ 62 235              |
| Actions émises en circulation    | 6 255                                            | 5 763                  | 6 475                  |
| VNI par action                   | \$ 10,38                                         | \$ 10,35               | \$ 9,61                |
| Distribution                     | \$ 12 492                                        | \$ 11 413              | \$ 9 033               |
| Actions émises en circulation    | 1 367                                            | 1 230                  | 1 011                  |
| VNI par action                   | \$ 9,14                                          | \$ 9,28                | \$ 8,94                |
| H Institutions :                 |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 4 142                                         | \$ 3 958               | \$ 4 449               |
| Actions émises en circulation    | 349                                              | 336                    | 409                    |
| VNI par action                   | \$ 11,87                                         | \$ 11,79               | \$ 10,87               |
|                                  | Fonds US Short-Term Fund                         |                        |                        |
| Actif net                        | \$ 3 535 840                                     | \$ 2 701 425           | \$ 2 330 264           |
| Institutions :                   |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 1 158 388                                     | \$ 989 615             | \$ 832 805             |
| Actions émises en circulation    | 84 699                                           | 74 022                 | 65 309                 |
| VNI par action                   | \$ 13,68                                         | \$ 13,37               | \$ 12,75               |
| Distribution                     | \$ 20 755                                        | \$ 33 980              | \$ 108 351             |
| Actions émises en circulation    | 2 031                                            | 3 336                  | 10 672                 |
| VNI par action                   | \$ 10,22                                         | \$ 10,18               | \$ 10,15               |
| Institutions en AUD (couverte) : |                                                  |                        |                        |
| Distribution                     | AUD 989 337                                      | AUD 62 703             | AUD 182 601            |
| Actions émises en circulation    | 98 544                                           | 6 272                  | 18 256                 |
| VNI par action                   | AUD 10,04                                        | AUD 10,00              | AUD 10,00              |
| Institutions en EUR (couverte) : |                                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 111 628                                        | € 118 072              | € 64 127               |
| Actions émises en circulation    | 9 975                                            | 10 703                 | 5 970                  |
| VNI par action                   | € 11,19                                          | € 11,03                | € 10,74                |



|                                  | Au<br>30 juin 2026               | Au<br>31 décembre 2025 | Au<br>31 décembre 2024 |
|----------------------------------|----------------------------------|------------------------|------------------------|
|                                  | Fonds US Short-Term Fund (suite) |                        |                        |
| Institutions en GBP (couverte) : |                                  |                        |                        |
| Distribution                     | £ 241                            | £ 721                  | £ 12 889               |
| Actions émises en circulation    | 24                               | 71                     | 1 270                  |
| VNI par action                   | £ 10,22                          | £ 10,18                | £ 10,15                |
| Investisseurs :                  |                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 49 707                        | \$ 8 622               | \$ 8 024               |
| Actions émises en circulation    | 3 789                            | 671                    | 653                    |
| VNI par action                   | \$ 13,12                         | \$ 12,84               | \$ 12,29               |
| Catégorie E :                    |                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 683 731                       | \$ 631 921             | \$ 492 046             |
| Actions émises en circulation    | 52 395                           | 49 441                 | 40 200                 |
| VNI par action                   | \$ 13,05                         | \$ 12,78               | \$ 12,24               |
| Catégorie E en EUR (couverte) :  |                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | € 45 791                         | € 42 837               | € 20 113               |
| Actions émises en circulation    | 4 306                            | 4 078                  | 1 958                  |
| VNI par action                   | € 10,63                          | € 10,50                | € 10,27                |
| H Institutions :                 |                                  |                        |                        |
| Capitalisation                   | \$ 40 091                        | \$ 40 420              | \$ 28 161              |
| Actions émises en circulation    | 3 213                            | 3 312                  | 2 415                  |
| VNI par action                   | \$ 12,48                         | \$ 12,21               | \$ 11,66               |
| Catégorie Z :                    |                                  |                        |                        |
| Distribution                     | \$ 717 457                       | \$ 765 102             | \$ 644 446             |
| Actions émises en circulation    | 69 837                           | 74 721                 | 63 135                 |
| VNI par action                   | \$ 10,27                         | \$ 10,24               | \$ 10,21               |

## 17. RÉMUNÉRATION

Le Gestionnaire applique une politique de rémunération conforme aux exigences relatives aux OPCVM et qui est résumée dans le Prospectus.

Les détails de la rémunération et des divulgations financières associées de la Société seront communiqués dans les états financiers annuels audités relatifs à l'exercice clos le 31 décembre 2026.

## 18. QUESTIONS RÉGLEMENTAIRES ET LITIGES

La Société n'est citée comme défendeur dans aucun litige ou procédure d'arbitrage important(e) et n'a connaissance d'aucun litige ou d'aucune réclamation important(e) effectué(e) ou n'en est pas menacée.

Ce qui précède ne s'applique qu'au 30 juin 2026.

## 19. FACILITÉ DE CRÉDIT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc, agissant pour le compte de chacun des Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Global High Yield Bond Fund et US High Yield Bond Fund (les « Fonds », individuellement un « Fonds ») a contracté une cinquième facilité de crédit modifiée et mise à jour en date du 15 août 2025 (le « Contrat de crédit ») entre, notamment, les Fonds, certains prêteurs dont MUFG Bank Ltd. (« MUFG ») (en qualité de prêteur) et MUFG en qualité d'agent et de chef de file.

Chaque Fonds est autorisé à utiliser la facilité à titre temporaire conformément aux politiques d'investissement du Fonds concerné.

Sous réserve des conditions du Contrat de crédit, l'engagement total disponible et pouvant être utilisé par les Fonds est de 180 000 000 \$.

Les sous-limites de chaque Fonds sont les suivantes : Fonds Global High Yield Bond Fund : 85 000 000 \$ ; Fonds US High Yield Bond Fund : 50 000 000 \$ et Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund : 45 000 000 \$. Le montant total disponible pour les Fonds, ainsi que pour les autres emprunteurs (collectivement, les « Emprunteurs ») est, sous réserve des conditions du Contrat de crédit, de 195 000 000 \$ (le « Montant total engagé »). Les Emprunteurs peuvent, sous réserve des termes du Contrat de crédit, demander une augmentation du Montant total engagé allant jusqu'à 299 500 000 USD. Le montant total des engagements, après toute augmentation, ne doit pas dépasser 600 millions de dollars. Cet engagement supplémentaire serait disponible pour être utilisé par les Emprunteurs conformément aux termes du Contrat de crédit.

Le Contrat de crédit prévoit deux taux d'intérêt. Chaque Fonds, lorsqu'il utilise un prêt, choisira le taux d'intérêt qui s'appliquera à tout ou partie du prêt concerné, le taux applicable étant déterminé par référence au (i) Taux de base de substitution ou au (ii) SOFR simple quotidien ajusté.

Le Taux de base de substitution est, pour chaque jour donné, le taux le plus élevé entre (i) le taux directeur (tel que défini dans le Contrat de crédit) ou (ii) le Taux de financement bancaire au jour le jour (tel que défini dans le Contrat de crédit), en vigueur à cette date. Chaque prêt portant intérêt calculé par référence au Taux de base de substitution portera intérêt sur le principal en circulation pour la période commençant à la date à laquelle ce prêt est contracté jusqu'à la date à laquelle ce prêt est intégralement remboursé, sans tenir compte de la date à laquelle ce prêt est remboursé, à un taux annuel égal au Taux de base de substitution plus la Marge applicable (soit 1,125 %).

Le SOFR quotidien correspond, pour chaque jour (appelé « jour de taux SOFR »), à un taux annuel égal au plus élevé des deux éléments suivants : (a) le SOFR (tel que défini dans l'accord de crédit) pour le jour en question (appelé « jour de détermination du SOFR »), qui correspond à trois jours ouvrables pour les titres d'État américains (tels que définis dans l'accord de crédit) avant (i) la date en question, si ce jour de taux SOFR est un jour ouvrable pour les titres d'État américains ; a) le jour du taux SOFR en question ou, si ce jour n'est pas un jour ouvrable pour les titres d'État américains, le jour ouvrable pour les titres d'État américains qui le précède immédiatement, dans chaque cas, tel que ce taux SOFR est publié par l'administrateur du SOFR (tel que défini dans l'accord de crédit) sur son site web (tel que défini dans l'accord de crédit) ; et b) un taux d'intérêt de 0 %. Si, à 17 heures (heure de New York) le deuxième jour ouvrable suivant une journée de détermination du SOFR, le taux SOFR relatif à cette journée n'a pas été publié sur le site web de l'administrateur du SOFR et qu'une date de remplacement du taux de référence pour le SOFR quotidien simple n'a pas été établie, alors : Dans ce cas, le taux SOFR applicable pour une journée de détermination donnée sera celui publié pour le premier jour ouvrable précédent des titres d'État américains pour lequel ce taux a été publié sur le site web de l'administrateur du SOFR. Cependant, tout taux SOFR déterminé conformément à cette disposition ne pourra être utilisé pour le calcul du taux SOFR quotidien simple (tel que défini dans l'accord de crédit) que pendant une période maximale de trois jours ouvrables consécutifs. Tout changement du taux SOFR quotidien simple résultant d'une modification du SOFR prendra effet à compter de la date d'entrée en vigueur de cette modification du SOFR, sans notification préalable au débiteur.

Chaque prêt portant intérêt calculé par référence au SOFR simple quotidien ajusté portera intérêt sur le principal en circulation, pour la période commençant à la date à laquelle ce prêt est contracté ou repris jusqu'à la date à laquelle ce prêt est intégralement remboursé, en tenant compte de la date à laquelle ce prêt est remboursé, à un taux annuel égal au SOFR simple quotidien ajusté plus la Marge applicable (soit 1,125 %).

Sous réserve des conditions du Contrat de crédit, un prêt est remboursable à la première des deux dates suivantes : 60 jours après son tirage ou le 14 août 2026, à moins qu'il ne soit remboursable plus tôt conformément aux conditions du Contrat de crédit.

Tous les prêts sont accordés sans exigence de garantie. Le recours des prêteurs à un fonds est limité aux actifs de ce dernier.

Au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025, aucun des Fonds n'avait effectué d'emprunt aux termes du Contrat de crédit.

## 20. RÉGLEMENTATION RELATIVE AUX OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES

La Réglementation relative aux opérations de financement sur titres (« ROFT ») introduit des obligations de reporting et de communication sur les Opérations de financement sur titres (« OFT ») et les swaps de rendement total. Les OFT sont définies en particulier par l'Article 3(11) de la ROFT comme suit :

- un contrat de mise/prise en pension,
- le prêt/emprunt de titres ou de matières premières,
- une opération d'achat et revente ou de vente et rachat dos-à-dos ; ou
- une opération de prêt avec appel de marge.

### (a) Données mondiales et concentration des contreparties OFT

Au 30 juin 2026, les Fonds détenaient des swaps de rendement total et les types d'OFT suivants :

- Contrats de mise en pension
- Contrats de prise en pension
- Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos

## Notes relatives aux États financiers (suite)

La juste valeur des actifs/(passifs) de tous les OFT et les swaps de rendement total au 30 juin 2026, groupés par type(s) d'OFT et les dix plus importantes contreparties sont les suivantes (si le nombre de contreparties est inférieur à dix, toutes les contreparties sont identifiées).

| Fonds                                              | 30 juin 2026                  |                     |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                    | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>       |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BOS                                                | \$ (300)                      | (0,03)              |
| BPS                                                | (540)                         | (0,06)              |
| JPS                                                | (9 598)                       | (1,02)              |
| MYI                                                | (34 482)                      | (3,69)              |
| SCX                                                | (3 642)                       | (0,39)              |
| <b>Total</b>                                       | <b>(48 562)</b>               | <b>(5,19)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                        |                               |                     |
| BPS                                                | \$ 178 300                    | 1,09                |
| Swaps de rendement total                           |                               |                     |
| BOA                                                | 91                            | 0,00                |
| BRC                                                | 1 727                         | 0,01                |
| FAR                                                | (243)                         | 0,00                |
| MBC                                                | (721)                         | 0,00                |
| MEI                                                | (4 395)                       | (0,03)              |
| MYI                                                | (4 526)                       | (0,03)              |
| <b>Total</b>                                       | <b>(8 067)</b>                | <b>(0,05)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO Capital Securities Fund</b>         |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BOS                                                | \$ (41 592)                   | (0,73)              |
| BRC                                                | (64 534)                      | (1,12)              |
| BYR                                                | (21 751)                      | (0,38)              |
| CDC                                                | (40 629)                      | (0,72)              |
| IND                                                | (36 359)                      | (0,64)              |
| JML                                                | (8 553)                       | (0,15)              |
| MBC                                                | (8 630)                       | (0,15)              |
| MYI                                                | (8 430)                       | (0,15)              |
| RCE                                                | (607)                         | (0,01)              |
| SOG                                                | (7 295)                       | (0,12)              |
| <b>Total</b>                                       | <b>(238 380)</b>              | <b>(4,17)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO Climate Bond Fund</b>               |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                        |                               |                     |
| BOS                                                | \$ 15 100                     | 3,72                |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BOS                                                | (507)                         | (0,12)              |
| MYI                                                | (1 200)                       | (0,30)              |
| SCX                                                | (527)                         | (0,13)              |
| <b>Total</b>                                       | <b>(2 234)</b>                | <b>(0,55)</b>       |
| <b>Fonds Commodity Real Return Fund</b>            |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                        |                               |                     |
| DEU                                                | \$ 1 016                      | 0,09                |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BSN                                                | (130 264)                     | (11,26)             |
| CIB                                                | (96 497)                      | (8,34)              |
| DEU                                                | (22 438)                      | (1,95)              |
| JPS                                                | (68 100)                      | (5,88)              |
| STR                                                | (102 147)                     | (8,83)              |
| <b>Total</b>                                       | <b>(419 446)</b>              | <b>(36,26)</b>      |
| Swaps de rendement total                           |                               |                     |
| BPS                                                | (11 488)                      | (0,99)              |
| CBK                                                | (14 803)                      | (1,28)              |
| GST                                                | (5 907)                       | (0,51)              |
| JPM                                                | (8 522)                       | (0,74)              |
| MAC                                                | (2 808)                       | (0,24)              |
| MEI                                                | (4 102)                       | (0,36)              |
| SOG                                                | (2 513)                       | (0,22)              |
| <b>Total</b>                                       | <b>(50 143)</b>               | <b>(4,34)</b>       |

### Fonds

#### Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

|                              |  |
|------------------------------|--|
| Contrats de mise en pension  |  |
| BPS                          |  |
| Contrats de prise en pension |  |
| BRC                          |  |
| Swaps de rendement total     |  |
| BPS                          |  |
| FAR                          |  |
| MYC                          |  |
| <b>Total</b>                 |  |

#### Fonds Diversified Income Fund

|                             |  |
|-----------------------------|--|
| Contrats de mise en pension |  |
| BOS                         |  |
| CEW                         |  |
| FICC                        |  |
| <b>Total</b>                |  |

#### Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

|                              |  |
|------------------------------|--|
| Contrats de prise en pension |  |
| BPS                          |  |
| BRC                          |  |
| MSC                          |  |
| MYI                          |  |
| NOM                          |  |
| <b>Total</b>                 |  |

#### Fonds Diversified Income ESG Fund

|                              |  |
|------------------------------|--|
| Contrats de prise en pension |  |
| BPS                          |  |
| BRC                          |  |
| MYI                          |  |
| RCE                          |  |
| <b>Total</b>                 |  |

#### Fonds Diversified Income ESG Fund

|                              |  |
|------------------------------|--|
| Contrats de prise en pension |  |
| MYI                          |  |

#### Fonds Dynamic Bond Fund

|                             |  |
|-----------------------------|--|
| Contrats de mise en pension |  |
| BOM                         |  |
| BPS                         |  |
| BRC                         |  |
| CEW                         |  |
| FICC                        |  |
| TOR                         |  |
| <b>Total</b>                |  |

#### Fonds Emerging Local Bond Fund

|                              |  |
|------------------------------|--|
| Contrats de prise en pension |  |
| BPS                          |  |
| Swaps de rendement total     |  |
| BPS                          |  |

#### Fonds Emerging Local Bond Fund

|                              |  |
|------------------------------|--|
| Contrats de prise en pension |  |
| BOS                          |  |
| BPS                          |  |
| BRC                          |  |
| DEU                          |  |
| JML                          |  |
| JPS                          |  |
| MBC                          |  |
| MEI                          |  |
| <b>Total</b>                 |  |

#### Fonds Emerging Local Bond Fund

|                          |  |
|--------------------------|--|
| Swaps de rendement total |  |
| MBC                      |  |
| SCX                      |  |
| <b>Total</b>             |  |

| 30 juin 2026                                         |                               |                     |
|------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                      | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>    |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BPS                                                  | \$ 12 700                     | 5,17                |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BRC                                                  | (101)                         | (0,04)              |
| Swaps de rendement total                             |                               |                     |
| BPS                                                  | (236)                         | (0,10)              |
| FAR                                                  | (31)                          | (0,01)              |
| MYC                                                  | (232)                         | (0,09)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(499)</b>                  | <b>(0,20)</b>       |
| <b>Fonds Diversified Income Fund</b>                 |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BOS                                                  | \$ 73 800                     | 0,77                |
| CEW                                                  | 63 436                        | 0,67                |
| FICC                                                 | 8 300                         | 0,09                |
| <b>Total</b>                                         | <b>145 536</b>                | <b>1,53</b>         |
| <b>Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BPS                                                  | (2 104)                       | (0,02)              |
| BRC                                                  | (34 950)                      | (0,37)              |
| MSC                                                  | (3 707)                       | (0,04)              |
| MYI                                                  | (46 603)                      | (0,50)              |
| NOM                                                  | (4 275)                       | (0,04)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(91 639)</b>               | <b>(0,97)</b>       |
| <b>Fonds Diversified Income ESG Fund</b>             |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BPS                                                  | \$ (234)                      | (0,06)              |
| BRC                                                  | (554)                         | (0,13)              |
| MYI                                                  | (2 070)                       | (0,49)              |
| RCE                                                  | (303)                         | (0,07)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(3 161)</b>                | <b>(0,75)</b>       |
| <b>Fonds Diversified Income ESG Fund</b>             |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| MYI                                                  | \$ (358)                      | (0,77)              |
| <b>Fonds Dynamic Bond Fund</b>                       |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BOM                                                  | \$ 303 084                    | 6,57                |
| BPS                                                  | 22 300                        | 0,48                |
| BRC                                                  | 71 500                        | 1,55                |
| CEW                                                  | 56 388                        | 1,23                |
| FICC                                                 | 7 600                         | 0,16                |
| TOR                                                  | 98 678                        | 2,13                |
| <b>Total</b>                                         | <b>559 550</b>                | <b>12,12</b>        |
| <b>Fonds Emerging Local Bond Fund</b>                |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BPS                                                  | (935)                         | (0,02)              |
| Swaps de rendement total                             |                               |                     |
| BPS                                                  | (3 753)                       | (0,08)              |
| <b>Fonds Emerging Local Bond Fund</b>                |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BOS                                                  | \$ (2 159)                    | (0,03)              |
| BPS                                                  | (52 223)                      | (0,79)              |
| BRC                                                  | (38 302)                      | (0,58)              |
| DEU                                                  | (1 384)                       | (0,02)              |
| JML                                                  | (116 701)                     | (1,77)              |
| JPS                                                  | (20 862)                      | (0,32)              |
| MBC                                                  | (416 833)                     | (6,35)              |
| MEI                                                  | (26 428)                      | (0,40)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(674 892)</b>              | <b>(10,26)</b>      |
| <b>Fonds Emerging Local Bond Fund</b>                |                               |                     |
| Swaps de rendement total                             |                               |                     |
| MBC                                                  | 859                           | 0,01                |
| SCX                                                  | 3 084                         | 0,05                |
| <b>Total</b>                                         | <b>3 943</b>                  | <b>0,06</b>         |

| Fonds                                                        | 30 juin 2026                  |                     |
|--------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                              | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Emerging Local Bond ESG Fund</b>                    |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                          | \$ 7 800                      | 3,49                |
| Contrats de prise en pension                                 |                               |                     |
| BRC                                                          | (4 216)                       | (1,89)              |
| MBC                                                          | (14 563)                      | (6,52)              |
| MEI                                                          | (3 789)                       | (1,69)              |
| <b>Total</b>                                                 | <b>(22 568)</b>               | <b>(10,10)</b>      |
| Swaps de rendement total                                     |                               |                     |
| MBC                                                          | 28                            | 0,01                |
| SCX                                                          | 39                            | 0,02                |
| <b>Total</b>                                                 | <b>67</b>                     | <b>0,03</b>         |
| <b>Fonds Emerging Markets Bond Fund</b>                      |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                 |                               |                     |
| BPS                                                          | \$ (75 176)                   | (1,12)              |
| BRC                                                          | (102 338)                     | (1,51)              |
| JML                                                          | (4 868)                       | (0,07)              |
| MBC                                                          | (35 456)                      | (0,52)              |
| MEI                                                          | (111 388)                     | (1,65)              |
| MYI                                                          | (52 250)                      | (0,76)              |
| NOM                                                          | (67 349)                      | (1,00)              |
| SCX                                                          | (63 014)                      | (0,92)              |
| <b>Total</b>                                                 | <b>(511 839)</b>              | <b>(7,55)</b>       |
| <b>Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                 |                               |                     |
| BPS                                                          | \$ (9 878)                    | (0,28)              |
| BRC                                                          | (90 368)                      | (2,61)              |
| DEU                                                          | (2 944)                       | (0,08)              |
| MBC                                                          | (48 993)                      | (1,41)              |
| MEI                                                          | (2 546)                       | (0,07)              |
| MYI                                                          | (42 543)                      | (1,24)              |
| NOM                                                          | (35 051)                      | (1,01)              |
| RDR                                                          | (19 617)                      | (0,57)              |
| SCX                                                          | (43 487)                      | (1,25)              |
| STR                                                          | (4 004)                       | (0,12)              |
| TDM                                                          | (54 822)                      | (1,58)              |
| <b>Total</b>                                                 | <b>(354 253)</b>              | <b>(10,22)</b>      |
| <b>Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>            |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                 |                               |                     |
| BPS                                                          | \$ (502)                      | (0,31)              |
| SCX                                                          | (1 041)                       | (0,65)              |
| <b>Total</b>                                                 | <b>(1 543)</b>                | <b>(0,96)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>       |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                          | \$ 137 200                    | 7,70                |
| BPS                                                          | 23 900                        | 1,34                |
| <b>Total</b>                                                 | <b>161 100</b>                | <b>9,04</b>         |
| Contrats de prise en pension                                 |                               |                     |
| BPS                                                          | (22 130)                      | (1,24)              |
| BRC                                                          | (13 534)                      | (0,76)              |
| MBC                                                          | (2 801)                       | (0,16)              |
| MEI                                                          | (984)                         | (0,06)              |
| MYI                                                          | (2 854)                       | (0,16)              |
| SOG                                                          | (4 796)                       | (0,27)              |
| TDM                                                          | (1 646)                       | (0,09)              |
| <b>Total</b>                                                 | <b>(48 745)</b>               | <b>(2,74)</b>       |
| <b>Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b> |                               |                     |
| Swaps de rendement total                                     |                               |                     |
| MBC                                                          | \$ 3                          | 0,01                |
| <b>Fonds PIMCO ESG Income Fund</b>                           |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                  |                               |                     |
| BPS                                                          | \$ 125 100                    | 19,28               |
| Contrats de prise en pension                                 |                               |                     |
| MSC                                                          | (803)                         | (0,12)              |
| SCX                                                          | (389)                         | (0,06)              |
| <b>Total</b>                                                 | <b>(1 192)</b>                | <b>(0,18)</b>       |
| Swaps de rendement total                                     |                               |                     |
| FAR                                                          | (25)                          | 0,00                |

| Fonds                                                     | 30 juin 2026                  |                     |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                           | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Euro Bond Fund</b>                               |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 7 000                       | 0,44                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | (27 931)                      | (1,77)              |
| BRC                                                       | (72 598)                      | (4,60)              |
| COM                                                       | (27 845)                      | (1,76)              |
| JML                                                       | (73 971)                      | (4,70)              |
| MEI                                                       | (9 037)                       | (0,57)              |
| <b>Total</b>                                              | <b>(211 382)</b>              | <b>(13,40)</b>      |
| <b>Fonds Euro Income Bond Fund</b>                        |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 226 700                     | 7,94                |
| Swaps de rendement total                                  |                               |                     |
| FAR                                                       | (112)                         | 0,00                |
| <b>Fonds Euro Long Average Duration Fund</b>              |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 6 100                       | 0,47                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | (86 945)                      | (6,68)              |
| BRC                                                       | (74 632)                      | (5,74)              |
| COM                                                       | (26 421)                      | (2,03)              |
| JML                                                       | (241 568)                     | (18,58)             |
| <b>Total</b>                                              | <b>(429 566)</b>              | <b>(33,03)</b>      |
| <b>Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund</b>          |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | € (2 669)                     | (0,45)              |
| MYI                                                       | (9 643)                       | (1,61)              |
| <b>Total</b>                                              | <b>(12 312)</b>               | <b>(2,06)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 52 100                      | 4,24                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | (112 141)                     | (9,13)              |
| BRC                                                       | (22 815)                      | (1,86)              |
| COM                                                       | (66 813)                      | (5,44)              |
| MEI                                                       | (3 476)                       | (0,28)              |
| MYI                                                       | (2 012)                       | (0,16)              |
| SBI                                                       | (25 483)                      | (2,07)              |
| <b>Total</b>                                              | <b>(232 740)</b>              | <b>(18,94)</b>      |
| <b>Fonds Global Advantage Fund</b>                        |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BRC                                                       | \$ (678)                      | (0,15)              |
| BSN                                                       | (811)                         | (0,19)              |
| CIB                                                       | (55 444)                      | (12,85)             |
| DEU                                                       | (1 444)                       | (0,33)              |
| JPS                                                       | (542)                         | (0,13)              |
| MYI                                                       | (207)                         | (0,05)              |
| <b>Total</b>                                              | <b>(59 126)</b>               | <b>(13,70)</b>      |
| Swaps de rendement total                                  |                               |                     |
| CBK                                                       | 1                             | 0,00                |
| <b>Fonds Global Bond Fund</b>                             |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BRC                                                       | \$ (9 203)                    | (0,05)              |
| CIB                                                       | (113 800)                     | (0,65)              |
| DEU                                                       | (26 858)                      | (0,15)              |
| FAR                                                       | (66 633)                      | (0,38)              |
| JPS                                                       | (221 296)                     | (1,26)              |
| MYI                                                       | (4 961)                       | (0,03)              |
| NOM                                                       | (58 234)                      | (0,33)              |
| SCX                                                       | (10 987)                      | (0,06)              |
| SGY                                                       | (104 290)                     | (0,59)              |
| STR                                                       | (459 216)                     | (2,61)              |
| <b>Total</b>                                              | <b>(1 075 478)</b>            | <b>(6,11)</b>       |
| Swaps de rendement total                                  |                               |                     |
| CBK                                                       | 25                            | 0,00                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds                                                   | 30 juin 2026                  |                     |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                         | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Global Bond ESG Fund</b>                       |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| FICC                                                    | \$ 2 300                      | 0,06                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | (10 150)                      | (0,27)              |
| BRC                                                     | (19 066)                      | (0,49)              |
| BSN                                                     | (3 092)                       | (0,08)              |
| FAR                                                     | (89 400)                      | (2,30)              |
| MYI                                                     | (1 286)                       | (0,03)              |
| SCX                                                     | (2 487)                       | (0,06)              |
| STR                                                     | (240 057)                     | (6,18)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(365 538)</b>              | <b>(9,41)</b>       |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BCY                                                     | (5 918)                       | (0,15)              |
| BPS                                                     | (12 791)                      | (0,33)              |
| MSC                                                     | (20 969)                      | (0,54)              |
| TDM                                                     | (48 283)                      | (1,24)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(87 961)</b>               | <b>(2,26)</b>       |
| <b>Fonds Global Bond Ex-US Fund</b>                     |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| CIB                                                     | \$ (10 290)                   | (0,97)              |
| DEU                                                     | (18 861)                      | (1,78)              |
| JPS                                                     | (16 658)                      | (1,56)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(45 809)</b>               | <b>(4,31)</b>       |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BPS                                                     | (289)                         | (0,03)              |
| CBK                                                     | 1                             | 0,00                |
| <b>Total</b>                                            | <b>(288)</b>                  | <b>(0,03)</b>       |
| <b>Fonds Global Bond Opportunities Fund</b>             |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ 5 300                      | 35,57               |
| <b>Fonds Global High Yield Bond Fund</b>                |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ 72 800                     | 3,01                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | (2 998)                       | (0,12)              |
| BPS                                                     | (3 274)                       | (0,14)              |
| BRC                                                     | (5 007)                       | (0,21)              |
| JML                                                     | (1 114)                       | (0,05)              |
| MYI                                                     | (3 032)                       | (0,12)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(15 425)</b>               | <b>(0,64)</b>       |
| <b>Fonds Global Investment Grade Credit Fund</b>        |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (8 961)                    | (0,12)              |
| BPS                                                     | (51 855)                      | (0,70)              |
| BRC                                                     | (20 787)                      | (0,27)              |
| CIB                                                     | (10 620)                      | (0,14)              |
| DEU                                                     | (19 769)                      | (0,28)              |
| JML                                                     | (4 427)                       | (0,06)              |
| JPS                                                     | (138 099)                     | (1,87)              |
| MEI                                                     | (1 472)                       | (0,02)              |
| NOM                                                     | (48 293)                      | (0,65)              |
| NXN                                                     | (156 950)                     | (2,12)              |
| SCX                                                     | (8 858)                       | (0,12)              |
| STR                                                     | (190 385)                     | (2,58)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(660 476)</b>              | <b>(8,93)</b>       |
| <b>Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>    |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (3 516)                    | (0,16)              |
| BRC                                                     | (7 511)                       | (0,33)              |
| JML                                                     | (3 013)                       | (0,13)              |
| JPS                                                     | (52 536)                      | (2,31)              |
| MYI                                                     | (609)                         | (0,02)              |
| STR                                                     | (10 178)                      | (0,45)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(77 363)</b>               | <b>(3,40)</b>       |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BPS                                                     | (14 241)                      | (0,63)              |

| Fonds                                                         | 30 juin 2026                  |                     |
|---------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                               | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Global Low Duration Real Return Fund</b>             |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOM                                                           | \$ (230 600)                  | (10,83)             |
| BRC                                                           | (563)                         | (0,03)              |
| CIB                                                           | (128 377)                     | (6,03)              |
| DEU                                                           | (14 171)                      | (0,66)              |
| JPS                                                           | (21 063)                      | (0,99)              |
| SOG                                                           | (4 250)                       | (0,20)              |
| STR                                                           | (324 019)                     | (15,21)             |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(723 043)</b>              | <b>(33,95)</b>      |
| <b>Fonds Global Real Return Fund</b>                          |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BPS                                                           | \$ (50 022)                   | (1,97)              |
| BSN                                                           | (448 252)                     | (17,64)             |
| CIB                                                           | (177 693)                     | (6,99)              |
| DEU                                                           | (12 094)                      | (0,48)              |
| JPS                                                           | (11 967)                      | (0,47)              |
| NOM                                                           | (35 682)                      | (1,40)              |
| STR                                                           | (335 327)                     | (13,20)             |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(1 071 037)</b>            | <b>(42,15)</b>      |
| <b>Fonds Income Fund</b>                                      |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| BAR                                                           | \$ 190 459                    | 0,15                |
| BOM                                                           | 1 409 691                     | 1,13                |
| BPS                                                           | 415 519                       | 0,33                |
| BUS                                                           | 2 015 859                     | 1,62                |
| CEW                                                           | 655 508                       | 0,52                |
| RBC                                                           | 458 150                       | 0,37                |
| <b>Total</b>                                                  | <b>5 145 186</b>              | <b>4,12</b>         |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BAR                                                           | (297 559)                     | (0,24)              |
| BRC                                                           | (636)                         | 0,00                |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(298 195)</b>              | <b>(0,24)</b>       |
| Swaps de rendement total                                      |                               |                     |
| BOA                                                           | 4 689                         | 0,00                |
| BPS                                                           | 14                            | 0,00                |
| JPM                                                           | 35                            | 0,00                |
| MYC                                                           | (541)                         | 0,00                |
| SOG                                                           | 8 868                         | 0,01                |
| <b>Total</b>                                                  | <b>13 065</b>                 | <b>0,01</b>         |
| <b>Fonds Income Fund II</b>                                   |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | \$ (22 760)                   | (3,16)              |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos       |                               |                     |
| BPS                                                           | (2 155)                       | (0,30)              |
| MSC                                                           | (2 843)                       | (0,39)              |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(4 998)</b>                | <b>(0,69)</b>       |
| Swaps de rendement total                                      |                               |                     |
| FAR                                                           | (28)                          | 0,00                |
| <b>Fonds Low Average Duration Fund</b>                        |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| BPS                                                           | \$ 21 800                     | 4,17                |
| <b>Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| FICC                                                          | \$ 4 800                      | 0,70                |
| <b>Fonds Low Duration Income Fund</b>                         |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| BOS                                                           | \$ 1 487 100                  | 17,48               |
| CEW                                                           | 951 542                       | 11,18               |
| <b>Total</b>                                                  | <b>2 438 642</b>              | <b>28,66</b>        |
| Swaps de rendement total                                      |                               |                     |
| FAR                                                           | (18)                          | 0,00                |
| <b>Fonds Low Duration Opportunities Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| FICC                                                          | \$ 124 300                    | 11,66               |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BPS                                                           | (201)                         | (0,02)              |
| Swaps de rendement total                                      |                               |                     |
| BPS                                                           | (730)                         | (0,07)              |

| Fonds                                                   | 30 juin 2026                  |                     |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                         | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund</b>        |                               |                     |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ (592)                      | (11,03)             |
| <b>Fonds MAARS Multi-Strategy Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ 13 400                     | 34,99               |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BOA                                                     | 21                            | 0,05                |
| JPM                                                     | (176)                         | (0,46)              |
| MEI                                                     | (23)                          | (0,06)              |
| <b>Total</b>                                            | (178)                         | (0,47)              |
| <b>Fonds PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b> |                               |                     |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BOA                                                     | \$ (85)                       | (0,05)              |
| CBK                                                     | (11)                          | 0,00                |
| GST                                                     | 1 218                         | 0,52                |
| JPM                                                     | (146)                         | (0,06)              |
| MYI                                                     | 144                           | 0,07                |
| <b>Total</b>                                            | 1 120                         | 0,48                |
| <b>Fonds Mortgage Opportunities Fund</b>                |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ 3 300                      | 0,11                |
| FICC                                                    | 86 400                        | 2,95                |
| <b>Total</b>                                            | 89 700                        | 3,06                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | (87 191)                      | (2,97)              |
| SBI                                                     | (492 545)                     | (16,78)             |
| WFS                                                     | (196 836)                     | (6,70)              |
| <b>Total</b>                                            | (776 572)                     | (26,45)             |
| <b>Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund</b>               |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| DEU                                                     | \$ (27 185)                   | (10,30)             |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BOA                                                     | (51)                          | (0,02)              |
| GST                                                     | (2)                           | 0,00                |
| JPM                                                     | (685)                         | (0,26)              |
| MAC                                                     | (1 360)                       | (0,51)              |
| MYI                                                     | 0                             | 0,00                |
| RBC                                                     | (3)                           | 0,00                |
| ULO                                                     | 109                           | 0,04                |
| <b>Total</b>                                            | (1 992)                       | (0,75)              |
| <b>Fonds StocksPLUS™ Fund</b>                           |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (29 376)                   | (0,45)              |
| JPS                                                     | (83 902)                      | (1,28)              |
| <b>Total</b>                                            | (113 278)                     | (1,73)              |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| CIB                                                     | 4 525                         | 0,07                |
| FAR                                                     | (10 224)                      | (0,15)              |
| RBC                                                     | (8 350)                       | (0,13)              |
| <b>Total</b>                                            | (14 049)                      | (0,21)              |
| <b>Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ 3 300                      | 24,68               |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| FAR                                                     | (15)                          | (0,11)              |
| MBC                                                     | (1)                           | (0,01)              |
| <b>Total</b>                                            | (16)                          | (0,12)              |
| <b>Fonds Strategic Income Fund</b>                      |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ 29 200                     | 1,06                |
| BRC                                                     | 82 000                        | 2,96                |
| FICC                                                    | 4 000                         | 0,15                |
| <b>Total</b>                                            | 115 200                       | 4,17                |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| FAR                                                     | (76)                          | 0,00                |
| <b>Fonds Total Return Bond Fund</b>                     |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BRC                                                     | \$ (8 614)                    | (0,20)              |
| CIB                                                     | (43 417)                      | (1,03)              |
| JPS                                                     | (22 724)                      | (0,54)              |
| MEI                                                     | (1 288)                       | (0,03)              |
| <b>Total</b>                                            | (76 043)                      | (1,80)              |

| Fonds                                                   | 30 juin 2026                  |                     |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                         | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (1 104)                    | (0,67)              |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BOA                                                     | 87                            | 0,05                |
| MEI                                                     | 125                           | 0,08                |
| <b>Total</b>                                            | 212                           | 0,13                |
| <b>Fonds UK Corporate Bond Fund</b>                     |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BPS                                                     | £ 100                         | 0,04                |
| CEW                                                     | 2 200                         | 0,98                |
| SCX                                                     | 100                           | 0,04                |
| <b>Total</b>                                            | 2 400                         | 1,06                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BRC                                                     | (810)                         | (0,36)              |
| <b>Fonds US High Yield Bond Fund</b>                    |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BRC                                                     | \$ 68 500                     | 4,49                |
| FICC                                                    | 10 300                        | 0,68                |
| <b>Total</b>                                            | 78 800                        | 5,17                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BRC                                                     | (2 728)                       | (0,18)              |
| MYI                                                     | (5 804)                       | (0,38)              |
| <b>Total</b>                                            | (8 532)                       | (0,56)              |
| <b>Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>    |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (937)                      | (0,21)              |
| SCX                                                     | (988)                         | (0,22)              |
| <b>Total</b>                                            | (1 925)                       | (0,43)              |
| <b>Fonds US Short-Term Fund</b>                         |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (59 937)                   | (1,70)              |
| BPS                                                     | (13 192)                      | (0,37)              |
| <b>Total</b>                                            | (73 129)                      | (2,07)              |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BCY                                                     | (7 568)                       | (0,21)              |

Au 31 décembre 2025, les Fonds détenaient des swaps de rendement total et les types d'OFT suivants :

- Contrats de mise en pension
- Contrats de prise en pension
- Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de tous les OFT et les swaps de rendement total au 31 décembre 2025, groupés par type(s) d'OFT et les dix plus importantes contreparties sont les suivantes (si le nombre de contreparties est inférieur à dix, toutes les contreparties sont identifiées).

| Fonds                                              | 31 décembre 2025              |                     |
|----------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                    | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>       |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BPS                                                | \$ (532)                      | (0,05)              |
| JML                                                | (2 411)                       | (0,23)              |
| MYI                                                | (7 091)                       | (0,66)              |
| <b>Total</b>                                       | (10 034)                      | (0,94)              |
| <b>Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund</b>     |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BOS                                                | \$ (205)                      | (0,07)              |
| BPS                                                | (1 003)                       | (0,35)              |
| <b>Total</b>                                       | (1 208)                       | (0,42)              |
| <b>Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                        |                               |                     |
| BPS                                                | \$ 64 000                     | 1,11                |
| Contrats de prise en pension                       |                               |                     |
| BOS                                                | (4 918)                       | (0,09)              |
| Swaps de rendement total                           |                               |                     |
| BPS                                                | (37)                          | 0,00                |
| BRC                                                | (52)                          | 0,00                |
| MBC                                                | (287)                         | 0,00                |
| MEI                                                | (307)                         | 0,00                |
| MYI                                                | (839)                         | (0,03)              |
| <b>Total</b>                                       | (1 522)                       | (0,03)              |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds                                                | 31 décembre 2025              |                     |
|------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                      | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds PIMCO Capital Securities Fund</b>           |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BOS                                                  | \$ (79 884)                   | (1,34)              |
| BRC                                                  | (68 413)                      | (1,16)              |
| BYR                                                  | (52 334)                      | (0,88)              |
| CDC                                                  | (45 785)                      | (0,78)              |
| IND                                                  | (36 904)                      | (0,62)              |
| JML                                                  | (3 202)                       | (0,06)              |
| MYI                                                  | (6 549)                       | (0,11)              |
| SOG                                                  | (7 537)                       | (0,12)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(300 608)</b>              | <b>(5,07)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO Climate Bond Fund</b>                 |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BOS                                                  | \$ 4 800                      | 1,29                |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BOS                                                  | (539)                         | (0,15)              |
| <b>Fonds Commodity Real Return Fund</b>              |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BOS                                                  | \$ 10 500                     | 1,25                |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BPS                                                  | (170 159)                     | (20,34)             |
| BSN                                                  | (16 292)                      | (1,95)              |
| STR                                                  | (14 672)                      | (1,75)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(201 123)</b>              | <b>(24,04)</b>      |
| Swaps de rendement total                             |                               |                     |
| BPS                                                  | 1 524                         | 0,19                |
| CBK                                                  | 2 544                         | 0,30                |
| GST                                                  | 955                           | 0,11                |
| JPM                                                  | 1 400                         | 0,16                |
| MAC                                                  | 845                           | 0,11                |
| MEI                                                  | 223                           | 0,03                |
| SOG                                                  | 694                           | 0,08                |
| <b>Total</b>                                         | <b>8 185</b>                  | <b>0,98</b>         |
| <b>Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>    |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BPS                                                  | \$ 35 000                     | 13,10               |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BRC                                                  | (337)                         | (0,13)              |
| <b>Fonds Diversified Income Fund</b>                 |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BOS                                                  | \$ 5 100                      | 0,05                |
| CEW                                                  | 14 591                        | 0,14                |
| FICC                                                 | 80 900                        | 0,80                |
| <b>Total</b>                                         | <b>100 591</b>                | <b>0,99</b>         |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BPS                                                  | (638)                         | (0,01)              |
| BRC                                                  | (44 728)                      | (0,44)              |
| JML                                                  | (183)                         | 0,00                |
| MSC                                                  | (5 016)                       | (0,05)              |
| MYI                                                  | (33 798)                      | (0,33)              |
| NOM                                                  | (4 202)                       | (0,04)              |
| NSL                                                  | (816)                         | (0,01)              |
| SCX                                                  | (4 460)                       | (0,04)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(93 841)</b>               | <b>(0,92)</b>       |
| <b>Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| BRC                                                  | \$ (1 273)                    | (0,33)              |
| MYI                                                  | (852)                         | (0,23)              |
| <b>Total</b>                                         | <b>(2 125)</b>                | <b>(0,56)</b>       |
| <b>Fonds Diversified Income ESG Fund</b>             |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                         |                               |                     |
| MYI                                                  | \$ (373)                      | (0,74)              |
| <b>Fonds Dynamic Bond Fund</b>                       |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                          |                               |                     |
| BOM                                                  | \$ 401 240                    | 8,81                |
| BOS                                                  | 493 300                       | 10,84               |
| BRC                                                  | 58 100                        | 1,27                |
| BUS                                                  | 145 906                       | 3,20                |
| CEW                                                  | 218 858                       | 4,80                |
| TOR                                                  | 94 839                        | 2,08                |
| <b>Total</b>                                         | <b>1 412 243</b>              | <b>31,00</b>        |

| Fonds                                                  | 31 décembre 2025              |                     |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                        | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BOS                                                    | \$ (1 692)                    | (0,04)              |
| BRC                                                    | (2 859)                       | (0,06)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(4 551)</b>                | <b>(0,10)</b>       |
| <b>Fonds Emerging Local Bond Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BPS                                                    | \$ (94 897)                   | (1,48)              |
| BRC                                                    | (100 776)                     | (1,55)              |
| MBC                                                    | (206 904)                     | (3,22)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(402 577)</b>              | <b>(6,25)</b>       |
| Swaps de rendement total                               |                               |                     |
| SCX                                                    | 1 000                         | 0,02                |
| <b>Fonds Emerging Local Bond ESG Fund</b>              |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                    | \$ 4 500                      | 3,17                |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BPS                                                    | (1 442)                       | (1,02)              |
| MBC                                                    | (15 493)                      | (10,92)             |
| <b>Total</b>                                           | <b>(16 935)</b>               | <b>(11,94)</b>      |
| Swaps de rendement total                               |                               |                     |
| SCX                                                    | 4                             | 0,00                |
| <b>Fonds Emerging Markets Bond Fund</b>                |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BPS                                                    | \$ (2 954)                    | (0,05)              |
| BRC                                                    | (55 171)                      | (0,82)              |
| MBC                                                    | (2 012)                       | (0,03)              |
| MEI                                                    | (5 131)                       | (0,07)              |
| MYI                                                    | (46 513)                      | (0,69)              |
| NOM                                                    | (59 712)                      | (0,89)              |
| SCX                                                    | (35 763)                      | (0,54)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(207 256)</b>              | <b>(3,09)</b>       |
| <b>Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund</b>            |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BPS                                                    | \$ (2 839)                    | (0,08)              |
| BRC                                                    | (85 887)                      | (2,48)              |
| JML                                                    | (16 365)                      | (0,47)              |
| MBC                                                    | (46 696)                      | (1,35)              |
| MEI                                                    | (2 709)                       | (0,08)              |
| MYI                                                    | (56 263)                      | (1,61)              |
| NOM                                                    | (31 945)                      | (0,91)              |
| RDR                                                    | (19 230)                      | (0,55)              |
| SCX                                                    | (37 161)                      | (1,07)              |
| TDM                                                    | (64 559)                      | (1,87)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(363 654)</b>              | <b>(10,47)</b>      |
| <b>Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>      |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BPS                                                    | \$ (723)                      | (0,43)              |
| SCX                                                    | (268)                         | (0,16)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(991)</b>                  | <b>(0,59)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BRC                                                    | \$ (5 385)                    | (0,72)              |
| TDM                                                    | (1 654)                       | (0,22)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(7 039)</b>                | <b>(0,94)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO ESG Income Fund</b>                     |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                            |                               |                     |
| BPS                                                    | \$ 81 300                     | 15,49               |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BOS                                                    | (2 552)                       | (0,49)              |
| MSC                                                    | (790)                         | (0,15)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(3 342)</b>                | <b>(0,64)</b>       |
| <b>Fonds Euro Bond Fund</b>                            |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                            |                               |                     |
| COM                                                    | € 18 500                      | 1,13                |
| Contrats de prise en pension                           |                               |                     |
| BPS                                                    | (413)                         | (0,02)              |
| BRC                                                    | (65 056)                      | (3,98)              |
| COM                                                    | (79 607)                      | (4,88)              |
| MEI                                                    | (48 199)                      | (2,95)              |
| <b>Total</b>                                           | <b>(193 275)</b>              | <b>(11,83)</b>      |



| Fonds                                                     | 31 décembre 2025              |                     |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                           | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Euro Credit Fund</b>                             |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| BPS                                                       | € 7 800                       | 1,41                |
| <b>Fonds Euro Income Bond Fund</b>                        |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 257 900                     | 9,82                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | (5 997)                       | (0,23)              |
| JML                                                       | (2 750)                       | (0,10)              |
| <b>Total</b>                                              | (8 747)                       | (0,33)              |
| <b>Fonds Euro Long Average Duration Fund</b>              |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 4 600                       | 0,39                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | (143 249)                     | (12,15)             |
| CDI                                                       | (69 620)                      | (5,91)              |
| COM                                                       | (211 213)                     | (17,92)             |
| MBC                                                       | (50 079)                      | (4,25)              |
| MEI                                                       | (19 396)                      | (1,65)              |
| MYI                                                       | (5 941)                       | (0,50)              |
| SCX                                                       | (7 266)                       | (0,62)              |
| <b>Total</b>                                              | (506 764)                     | (43,00)             |
| <b>Fonds Euro Short-Term Fund</b>                         |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| BPS                                                       | € 14 300                      | 3,06                |
| <b>Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund</b>          |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| BPS                                                       | € 7 200                       | 1,37                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | (4 598)                       | (0,88)              |
| MYI                                                       | (12 028)                      | (2,29)              |
| <b>Total</b>                                              | (16 626)                      | (3,17)              |
| <b>Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| COM                                                       | € 50 300                      | 4,04                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| SOG                                                       | (1 021)                       | (0,08)              |
| <b>Fonds Global Advantage Fund</b>                        |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BPS                                                       | \$ (15 075)                   | (3,41)              |
| BRC                                                       | (324)                         | (0,07)              |
| BSN                                                       | (17 280)                      | (3,91)              |
| CIB                                                       | (19 951)                      | (4,52)              |
| COM                                                       | (3 094)                       | (0,70)              |
| MBC                                                       | (2 221)                       | (0,50)              |
| MYI                                                       | (636)                         | (0,15)              |
| <b>Total</b>                                              | (58 581)                      | (13,26)             |
| <b>Fonds Global Bond Fund</b>                             |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BOM                                                       | \$ (7 153)                    | (0,04)              |
| BOS                                                       | (10 480)                      | (0,06)              |
| BRC                                                       | (24 106)                      | (0,14)              |
| BSN                                                       | (44 130)                      | (0,25)              |
| DEU                                                       | (9 494)                       | (0,06)              |
| FAR                                                       | (976 737)                     | (5,56)              |
| JML                                                       | (330)                         | 0,00                |
| MBC                                                       | (677)                         | 0,00                |
| SGY                                                       | (10 897)                      | (0,06)              |
| <b>Total</b>                                              | (1 084 004)                   | (6,17)              |
| <b>Fonds Global Bond ESG Fund</b>                         |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                               |                               |                     |
| FICC                                                      | \$ 5 700                      | 0,14                |
| Contrats de prise en pension                              |                               |                     |
| BOS                                                       | (10 385)                      | (0,25)              |
| BPS                                                       | (334 222)                     | (8,10)              |
| BRC                                                       | (5 592)                       | (0,14)              |
| BSN                                                       | (45 444)                      | (1,10)              |
| MEI                                                       | (52 217)                      | (1,27)              |
| MYI                                                       | (2 079)                       | (0,05)              |
| <b>Total</b>                                              | (449 939)                     | (10,91)             |

| Fonds                                                   | 31 décembre 2025              |                     |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                         | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds Global Bond Ex-US Fund</b>                     |                               |                     |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ (1 137)                    | (0,03)              |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BPS                                                     | (11 491)                      | (1,12)              |
| BRC                                                     | (630)                         | (0,06)              |
| BSN                                                     | (23 971)                      | (2,33)              |
| CIB                                                     | (41 317)                      | (4,02)              |
| MBC                                                     | (4 026)                       | (0,39)              |
| <b>Total</b>                                            | (81 435)                      | (7,92)              |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BPS                                                     | (56)                          | (0,01)              |
| <b>Fonds Global High Yield Bond Fund</b>                |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| FICC                                                    | \$ 107 000                    | 3,73                |
| SGY                                                     | 150 000                       | 5,23                |
| <b>Total</b>                                            | 257 000                       | 8,96                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | (10 748)                      | (0,38)              |
| BPS                                                     | (1 961)                       | (0,07)              |
| BRC                                                     | (10 705)                      | (0,36)              |
| JML                                                     | (14 645)                      | (0,52)              |
| MYI                                                     | (5 937)                       | (0,20)              |
| <b>Total</b>                                            | (43 996)                      | (1,53)              |
| <b>Fonds Global Investment Grade Credit Fund</b>        |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (12 118)                   | (0,15)              |
| BPS                                                     | (1 594)                       | (0,02)              |
| BRC                                                     | (3 312)                       | (0,04)              |
| JML                                                     | (5 566)                       | (0,08)              |
| SOG                                                     | (925)                         | (0,01)              |
| <b>Total</b>                                            | (23 515)                      | (0,30)              |
| <b>Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>    |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ (5 506)                    | (0,22)              |
| BPS                                                     | (1 429)                       | (0,06)              |
| BRC                                                     | (716)                         | (0,03)              |
| BSN                                                     | (19 852)                      | (0,79)              |
| JML                                                     | (4 044)                       | (0,16)              |
| MYI                                                     | (3 070)                       | (0,12)              |
| <b>Total</b>                                            | (34 617)                      | (1,38)              |
| <b>Fonds Global Low Duration Real Return Fund</b>       |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOM                                                     | \$ (63 659)                   | (3,74)              |
| BPS                                                     | (479 866)                     | (28,19)             |
| CIB                                                     | (366 783)                     | (21,55)             |
| SOG                                                     | (4 198)                       | (0,25)              |
| STR                                                     | (194 163)                     | (11,40)             |
| <b>Total</b>                                            | (1 108 669)                   | (65,13)             |
| <b>Fonds Global Real Return Fund</b>                    |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOM                                                     | \$ (384 136)                  | (20,61)             |
| BPS                                                     | (240 063)                     | (12,88)             |
| BSN                                                     | (868 397)                     | (46,58)             |
| CIB                                                     | (53 940)                      | (2,90)              |
| MYI                                                     | (4 530)                       | (0,24)              |
| NOM                                                     | (65 086)                      | (3,49)              |
| STR                                                     | (2 007)                       | (0,11)              |
| <b>Total</b>                                            | (1 618 159)                   | (86,81)             |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BPS                                                     | (4 611)                       | (0,25)              |
| <b>Fonds Income Fund</b>                                |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BAR                                                     | \$ 284 484                    | 0,23                |
| BOM                                                     | 4 450 118                     | 3,65                |
| BPS                                                     | 100 333                       | 0,08                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds                                                         | 31 décembre 2025              |                     |
|---------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                               | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| BRC                                                           | \$ 1 000 000                  | 0,82                |
| BUS                                                           | 4 304 214                     | 3,53                |
| CEW                                                           | 9 826 737                     | 8,09                |
| RBC                                                           | 3 392 303                     | 2,79                |
| SGY                                                           | 1 600 000                     | 1,31                |
| TOR                                                           | 1 459 056                     | 1,20                |
| <b>Total</b>                                                  | <b>26 417 245</b>             | <b>21,70</b>        |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BRC                                                           | (296 457)                     | (0,24)              |
| Swaps de rendement total                                      |                               |                     |
| BPS                                                           | (202)                         | 0,00                |
| JPM                                                           | (79)                          | 0,00                |
| MYC                                                           | (509)                         | 0,00                |
| SOG                                                           | 795                           | 0,00                |
| <b>Total</b>                                                  | <b>5</b>                      | <b>0,00</b>         |
| <b>Fonds Income Fund II</b>                                   |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | \$ (2 336)                    | (0,39)              |
| <b>Fonds Low Average Duration Fund</b>                        |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | \$ (1 471)                    | (0,26)              |
| STR                                                           | (124 148)                     | (21,54)             |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(125 619)</b>              | <b>(21,80)</b>      |
| <b>Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b> |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| FICC                                                          | \$ 31 700                     | 2,38                |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | (335)                         | (0,03)              |
| <b>Fonds Low Duration Income Fund</b>                         |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| BOS                                                           | \$ 166 200                    | 3,19                |
| BPS                                                           | 100                           | 0,00                |
| BRC                                                           | 452 800                       | 8,69                |
| CEW                                                           | 955 681                       | 18,36               |
| <b>Total</b>                                                  | <b>1 574 781</b>              | <b>30,24</b>        |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BPS                                                           | (2 763)                       | (0,05)              |
| JML                                                           | (182)                         | (0,01)              |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(2 945)</b>                | <b>(0,06)</b>       |
| <b>Fonds Low Duration Opportunities Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| BPS                                                           | \$ 225 700                    | 25,45               |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | (828)                         | (0,09)              |
| BPS                                                           | (213)                         | (0,03)              |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(1 041)</b>                | <b>(0,12)</b>       |
| <b>Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund</b>              |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | \$ (842)                      | (15,90)             |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos       |                               |                     |
| TDL                                                           | (252)                         | (4,76)              |
| <b>Fonds PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>       |                               |                     |
| Swaps de rendement total                                      |                               |                     |
| BOA                                                           | \$ (87)                       | (0,05)              |
| CBK                                                           | (4)                           | 0,00                |
| GST                                                           | (90)                          | (0,05)              |
| JPM                                                           | (99)                          | (0,06)              |
| MYI                                                           | (92)                          | (0,06)              |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(372)</b>                  | <b>(0,22)</b>       |
| <b>Fonds Mortgage Opportunities Fund</b>                      |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                                   |                               |                     |
| FICC                                                          | \$ 5 600                      | 0,22                |
| Contrats de prise en pension                                  |                               |                     |
| BOS                                                           | (2 427)                       | (0,09)              |
| SBI                                                           | (284 903)                     | (11,13)             |
| WFS                                                           | (285 362)                     | (11,15)             |
| <b>Total</b>                                                  | <b>(572 692)</b>              | <b>(22,37)</b>      |

| Fonds                                                   | 31 décembre 2025              |                     |
|---------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------|
|                                                         | Juste valeur<br>(en milliers) | En % de l'actif net |
| <b>Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund</b>               |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| DEU                                                     | \$ (4 471)                    | (2,20)              |
| JPS                                                     | (5 798)                       | (2,85)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(10 269)</b>               | <b>(5,05)</b>       |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BOA                                                     | 0                             | 0,00                |
| BPS                                                     | 1                             | 0,00                |
| CBK                                                     | 1                             | 0,00                |
| JPM                                                     | 189                           | 0,09                |
| MAC                                                     | 282                           | 0,13                |
| MYI                                                     | (7)                           | 0,00                |
| RBC                                                     | 0                             | 0,00                |
| ULO                                                     | (28)                          | (0,01)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>438</b>                    | <b>0,21</b>         |
| <b>Fonds StocksPLUS™ Fund</b>                           |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ 85 000                     | 1,38                |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| FAR                                                     | (15 006)                      | (0,25)              |
| GST                                                     | (854)                         | (0,01)              |
| JPM                                                     | (6 063)                       | (0,10)              |
| RBC                                                     | (8 973)                       | (0,14)              |
| TOR                                                     | (5 073)                       | (0,08)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(35 969)</b>               | <b>(0,58)</b>       |
| <b>Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>                  |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BPS                                                     | \$ 4 400                      | 36,96               |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| BRC                                                     | (6)                           | (0,05)              |
| CIB                                                     | (19)                          | (0,16)              |
| FAR                                                     | (31)                          | (0,26)              |
| RBC                                                     | (4)                           | (0,04)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(60)</b>                   | <b>(0,51)</b>       |
| <b>Fonds Strategic Income Fund</b>                      |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| FICC                                                    | \$ 3 800                      | 0,16                |
| <b>Fonds Total Return Bond Fund</b>                     |                               |                     |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| SOG                                                     | \$ (505)                      | (0,01)              |
| <b>Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b> |                               |                     |
| Swaps de rendement total                                |                               |                     |
| MEI                                                     | \$ 34                         | 0,03                |
| <b>Fonds US High Yield Bond Fund</b>                    |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BRC                                                     | \$ 154 300                    | 8,89                |
| FICC                                                    | 21 600                        | 1,24                |
| <b>Total</b>                                            | <b>175 900</b>                | <b>10,13</b>        |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | (10 356)                      | (0,60)              |
| BPS                                                     | (775)                         | (0,04)              |
| BRC                                                     | (3 303)                       | (0,19)              |
| MSC                                                     | (1 977)                       | (0,11)              |
| MYI                                                     | (693)                         | (0,04)              |
| NOM                                                     | (1 838)                       | (0,11)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(18 942)</b>               | <b>(1,09)</b>       |
| <b>Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>    |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| FICC                                                    | \$ 29 400                     | 7,48                |
| Contrats de prise en pension                            |                               |                     |
| BOS                                                     | (1 830)                       | (0,47)              |
| MEI                                                     | (840)                         | (0,21)              |
| <b>Total</b>                                            | <b>(2 670)</b>                | <b>(0,68)</b>       |
| <b>Fonds US Short-Term Fund</b>                         |                               |                     |
| Contrats de mise en pension                             |                               |                     |
| BOS                                                     | \$ 2 600                      | 0,10                |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                               |                     |
| BPS                                                     | (109 412)                     | (4,05)              |

**(b) Garantie****(i) Garde des garanties reçues :**

Les garanties reçues au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 étaient détenues au sein du réseau de dépositaires international de State Street Bank and Trust Co.

**(ii) Données sur la concentration :**

Les dix premiers émetteurs de titres reçus en garantie, toutes OFT confondues au 30 juin 2026, sont les suivants (si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous).

| Fonds                                              | Au 30 juin 2026             |                               |
|----------------------------------------------------|-----------------------------|-------------------------------|
|                                                    | Émetteur de garantie        | Juste valeur<br>(en milliers) |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund        | Ginnie Mae                  | \$ 93 202                     |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis | 89 569                        |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                | Gouvernement des États-Unis | 341                           |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                      | Gouvernement des États-Unis | 15 411                        |
| Fonds Commodity Real Return Fund                   | Gouvernement des États-Unis | 1 023                         |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund         | Ginnie Mae                  | 13 833                        |
| Fonds Diversified Income Fund                      | Gouvernement du Canada      | 65 009                        |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis | 83 791                        |
| Fonds Dynamic Bond Fund                            | Gouvernement du Canada      | 474 251                       |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis | 103 202                       |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                     | Gouvernement du Royaume-Uni | 12                            |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                 | Gouvernement des États-Unis | 7 954                         |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                   | Gouvernement du Royaume-Uni | 1 498                         |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund               | Gouvernement du Royaume-Uni | 16                            |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund    | Gouvernement des États-Unis | 164 030                       |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                        | Ginnie Mae                  | 88 858                        |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis | 39 809                        |
| Fonds Euro Bond Fund                               | Bpifrance SACA              | € 7 288                       |
|                                                    | Gouvernement français       | 883                           |
| Fonds Euro Income Bond Fund                        | Bpifrance SACA              | 31 715                        |
|                                                    | UNEDIC                      | 201 559                       |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund              | Bpifrance SACA              | 6 304                         |
|                                                    | Gouvernement français       | 3 811                         |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Bpifrance SACA              | 53 105                        |
| Fonds Global Advantage Fund                        | Gouvernement des États-Unis | \$ 384                        |
| Fonds Global Bond Fund                             | Gouvernement des États-Unis | 4 327                         |
| Fonds Global Bond ESG Fund                         | Gouvernement des États-Unis | 2 445                         |
| Fonds Global Bond Opportunities Fund               | Ginnie Mae                  | 3 050                         |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis | 2 539                         |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                  | Gouvernement des États-Unis | 74 304                        |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund          | Gouvernement des États-Unis | 4 909                         |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund         | Gouvernement des États-Unis | 1 183                         |
| Fonds Global Real Return Fund                      | Gouvernement des États-Unis | 580                           |

| Fonds                                                  | Au 30 juin 2026                 |                               |
|--------------------------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|
|                                                        | Émetteur de garantie            | Juste valeur<br>(en milliers) |
| Fonds Income Fund                                      | Advanced Micro Devices, Inc.    | \$ 11 129                     |
|                                                        | AerCap Ireland Capital DAC      | 9 282                         |
|                                                        | Amazon.com, Inc.                | 18 090                        |
|                                                        | Apple, Inc.                     | 5 319                         |
|                                                        | Bank of America Corp.           | 26 145                        |
|                                                        | Barclays Bank PLC               | 190 380                       |
|                                                        | Broadcom, Inc.                  | 14 767                        |
|                                                        | Gouvernement du Canada          | 4 665 965                     |
|                                                        | Cigna Group                     | 26 706                        |
|                                                        | Citibank N.A.                   | 14 032                        |
|                                                        | Citigroup, Inc.                 | 35 460                        |
|                                                        | Constellation Brands, Inc.      | 29 445                        |
|                                                        | Enbridge, Inc.                  | 9 499                         |
|                                                        | ENEL Finance International NV   | 24 747                        |
|                                                        | Fifth Third Bancorp             | 37 122                        |
|                                                        | Goldman Sachs Group, Inc.       | 35 934                        |
|                                                        | Intercontinental Exchange, Inc. | 32 879                        |
|                                                        | JPMorgan Chase & Co.            | 27 192                        |
|                                                        | Shell International Finance BV  | 13 960                        |
|                                                        | Siemens                         |                               |
|                                                        | Financieringsmaatschappij NV    | 17 325                        |
|                                                        | UBS AG                          | 15 388                        |
|                                                        | Walmart, Inc.                   | 10 145                        |
|                                                        | Westpac Banking Corp.           | 11 022                        |
|                                                        | Gouvernement des États-Unis     | 22 073                        |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | Gouvernement des États-Unis     | 4 896                         |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Gouvernement du Canada          | 979 418                       |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | Gouvernement des États-Unis     | 1 516 628                     |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Gouvernement des États-Unis     | 126 786                       |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                        | Ginnie Mae                      | 7 842                         |
|                                                        | Gouvernement des États-Unis     | 6 296                         |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | Gouvernement des États-Unis     | 91 881                        |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Ginnie Mae                      | 2 723                         |
|                                                        | Gouvernement des États-Unis     | 812                           |
| Fonds Strategic Income Fund                            | Gouvernement des États-Unis     | 117 454                       |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | Gouvernement des États-Unis     | 1 199                         |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                           | Gouvernement du Royaume-Uni     | £ 2 442                       |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | Gouvernement des États-Unis     | \$ 80 320                     |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

Les dix premiers émetteurs de titres reçus en garantie, toutes OFT confondues au 31 décembre 2025, sont les suivants (si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous).

| Fonds                                              | Au 31 décembre 2025                                   |                            | Fonds                                                  | Au 31 décembre 2025          |                            |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------|----------------------------|
|                                                    | Émetteur de garantie                                  | Juste valeur (en milliers) |                                                        | Émetteur de garantie         | Juste valeur (en milliers) |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund        | Ginnie Mae                                            | \$ 34 512                  | Fonds Global Bond ESG Fund                             | Gouvernement des États-Unis  | \$ 5 814                   |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis                           | 32 657                     | Fonds Global High Yield Bond Fund                      | Gouvernement des États-Unis  | 262 090                    |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                | Gouvernement des États-Unis                           | 365                        | Fonds Global Real Return Fund                          | Gouvernement des États-Unis  | 584                        |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                      | Gouvernement des États-Unis                           | 4 900                      | Fonds Income Fund                                      | Advanced Micro Devices, Inc. | 11 166                     |
| Fonds Commodity Real Return Fund                   | Gouvernement des États-Unis                           | 10 710                     |                                                        | AerCap Ireland Capital DAC   | 9 388                      |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund         | Gouvernement des États-Unis                           | \$ 35 718                  |                                                        | Barclays Bank PLC            | 284 216                    |
| Fonds Diversified Income Fund                      | Gouvernement du Canada                                | 14 829                     |                                                        | Broadcom Corp.               | 14 115                     |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis                           | 87 728                     |                                                        | Broadcom, Inc.               | 15 037                     |
| Fonds Dynamic Bond Fund                            | Gouvernement du Canada                                | 880 036                    |                                                        | Gouvernement canadien        | 23 097 068                 |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis                           | 562 767                    |                                                        | Constellation Brands, Inc.   | 29 631                     |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                 | Gouvernement des États-Unis                           | 4 594                      |                                                        | Hydro Quebec                 | 818 046                    |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund               | Gouvernement français                                 | 320                        |                                                        | JPMorgan Chase & Co.         | 27 611                     |
|                                                    | Gouvernement des États-Unis                           | 260                        |                                                        | Gouvernement des États-Unis  | 2 655 965                  |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                        | Ginnie Mae                                            | 84 187                     | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Gouvernement des États-Unis  | 32 334                     |
| Fonds Euro Bond Fund                               | LFA Foerderbank Bayern                                | € 19 091                   | Fonds Low Duration Income Fund                         | Gouvernement canadien        | 978 935                    |
| Fonds Euro Credit Fund                             | Gouvernement de Belgique                              | 7 871                      | Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Gouvernement des États-Unis  | 631 850                    |
| Fonds Euro Income Bond Fund                        | Banque d'investissement de Berlin                     | 16 688                     | Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | Ginnie Mae                   | 170 375                    |
|                                                    | Banque d'investissement du Land de Brandebourg        | 73 784                     |                                                        | Gouvernement des États-Unis  | 58 272                     |
|                                                    | Land Schleswig-Holstein                               | 72 274                     | Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | Gouvernement des États-Unis  | 5 712                      |
|                                                    | LFA Foerderbank Bayern                                | 41 097                     | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Gouvernement des États-Unis  | 86 744                     |
|                                                    | NRW Bank                                              | 60 625                     | Fonds Strategic Income Fund                            | Ginnie Mae                   | 2 278                      |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund              | Banque d'investissement et de financement de Hambourg | 4 693                      | Fonds US High Yield Bond Fund                          | Gouvernement des États-Unis  | 2 245                      |
| Fonds Euro Short-Term Fund                         | Communauté flamande                                   | 14 408                     |                                                        | Gouvernement des États-Unis  | 3 876                      |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund          | Gouvernement de Belgique                              | 7 266                      | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | Gouvernement des États-Unis  | 179 364                    |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Banque de développement asiatique                     | 21 724                     | Fonds US Short-Term Fund                               | Gouvernement des États-Unis  | 29 988                     |
|                                                    | BNG Bank NV                                           | 7 350                      |                                                        | Gouvernement des États-Unis  | 2 652                      |
|                                                    | NRW Bank                                              | 22 502                     |                                                        |                              |                            |

### (iii) Données agrégées sur les opérations :

Les données agrégées sur les opérations correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues tous OTF et swaps de rendement total confondus au 30 juin 2026 sont telles que suit :

| Fonds                                       | Type de titre                | Description de la garantie                             | Type de garantie   | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance enureur de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|---------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------------|----------------------------|---------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund       | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | \$ 1                       | S/O     | S/O                             | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Contrats de mise en pension  | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | 93 202                     | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                             |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 89 569                     | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund         | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 340                        | S/O     | S/O                             | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                             |                              | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor      | 341                        | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund               | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 15 411                     | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds Commodity Real Return Fund            | Contrats de mise en pension  | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 1 023                      | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund  | Contrats de mise en pension  | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | 13 833                     | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                             | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 980                        | S/O     | S/O                             | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 470                        | S/O     | S/O                             | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds Diversified Income Fund               | Contrats de mise en pension  | Province de l'Ontario                                  | Bon du Trésor      | 65 009                     | AA-     | Plus d'un an                    | CAD                   | États-Unis                              | EUROCLEAR, bilatéral      |
|                                             |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 83 791                     | AA+     | Plus d'un an                    | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                             | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 459                        | S/O     | S/O                             | CAD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |

| Fonds                                              | Type de titre               | Description de la garantie                             | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance Teneur de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation     |
|----------------------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------------------|------------------|----------------------------|---------|--------------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|
| Fonds Dynamic Bond Fund                            | Contrats de mise en pension | Hydro Quebec                                           | Bon du Trésor    | \$ 15 541                  | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                                    |                             | Province de l'Ontario                                  | Bon du Trésor    | 299 474                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                    |                             | Province de l'Ontario                                  | Bon du Trésor    | 45 508                     | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                    |                             | Province du Québec                                     | Bon du Trésor    | 101 568                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                                    |                             | Province du Québec                                     | Bon du Trésor    | 12 160                     | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                                    |                             | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor    | 22 579                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                     | Contrats de mise en pension | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor    | 72 871                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor    | 7 752                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 1 088                      | S/O     | S/O                            | CAD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 7 425                      | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Bon du Trésor britannique                              | Bon du Trésor    | 12                         | AA-     | Plus d'un an                   | GBP                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 850                        | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                 | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor    | 7 954                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 40                         | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                   | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 288                        | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 3 910                      | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund               | Contrats de mise en pension | Bon du Trésor britannique                              | Bon du Trésor    | 1 498                      | AA-     | Plus d'un an                   | GBP                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 374                        | S/O     | S/O                            | EUR                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 890                        | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 770                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund    | Contrats de mise en pension | Bon du Trésor britannique                              | Bon du Trésor    | 16                         | AA-     | Plus d'un an                   | GBP                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor    | 24 199                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                        | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor    | 139 831                    | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Mortgage Pass Thru                                     |                  |                            |         |                                |                       |                                         |                               |
|                                                    |                             | Ginnie Mae                                             |                  | 88 858                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor    | 39 809                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Euro Bond Fund                               | Contrats de mise en pension | Bpifrance SACA                                         | Bon du Trésor    | € 7 288                    | A+      | 3 mois - 1 an                  | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 204                        | S/O     | S/O                            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 87                         | S/O     | S/O                            | USD                   | Allemagne                               | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 506                        | S/O     | S/O                            | EUR                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Obligation internationale du gouvernement français     | Bon du Trésor    | 883                        | A+      | Plus d'un an                   | EUR                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Bpifrance SACA                                         | Bon du Trésor    | 31 715                     | A+      | 3 mois - 1 an                  | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
| Fonds Euro Income Bond Fund                        | Contrats de mise en pension | UNEDIC                                                 | Bon du Trésor    | 201 559                    | A+      | Plus d'un an                   | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Bpifrance SACA                                         | Bon du Trésor    | 6 304                      | A+      | 3 mois - 1 an                  | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund              | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 516                        | S/O     | S/O                            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 505                        | S/O     | S/O                            | USD                   | Allemagne                               | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 1 627                      | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Obligation internationale du gouvernement français     | Bon du Trésor    | 3 811                      | A+      | Plus d'un an                   | EUR                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral          |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Bpifrance SACA                                         | Bon du Trésor    | 3 546                      | A+      | 3 mois - 1 an                  | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Bpifrance SACA                                         | Bon du Trésor    | 49 559                     | A+      | Plus d'un an                   | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 805                        | S/O     | S/O                            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 462                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Advantage Fund                        | Contrats de mise en pension | STRIPS du Trésor américain                             | Bon du Trésor    | \$ 384                     | AA+     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 310                        | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Bond Fund                             | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 3 098                      | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor    | 1 648                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | STRIPS du Trésor américain                             | Bon du Trésor    | 2 679                      | AA+     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor    | 2 346                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Bond ESG Fund                         | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 765                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor    | 99                         | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | Canada                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                       | Contrats de swap            | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 560                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités       | 560                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Bond Opportunities Fund               | Contrats de mise en pension | Mortgage Pass Thru                                     |                  |                            |         |                                |                       |                                         |                               |
|                                                    |                             | Ginnie Mae                                             |                  | 3 050                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                  | Contrats de mise en pension | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor    | 2 539                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                    |                             | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor    | 74 304                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds                                                  | Type de titre                | Description de la garantie            | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance Teneur de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation     |
|--------------------------------------------------------|------------------------------|---------------------------------------|------------------|----------------------------|---------|--------------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | \$ 50                      | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 1 272                      | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Obligations du Trésor américain       | Bon du Trésor    | 4 856                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | STRIPS du Trésor américain            | Bon du Trésor    | 53                         | AA+     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 853                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 90                         | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Real Return Fund                          | Contrats de prise en pension | Billets du Trésor américain           | Bon du Trésor    | 1 183                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | Canada                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Income Fund                                      | Contrats de prise en pension | Billets du Trésor américain           | Bon du Trésor    | 580                        | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | Canada                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Income Fund                                      | Contrats de mise en pension  | Advanced Micro Devices, Inc.          | Bon du Trésor    | 11 129                     | A       | 1 à 3 mois                     | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | AerCap Ireland Capital DAC            | Bon du Trésor    | 9 282                      | BBB-    | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Amazon.com, Inc.                      | Bon du Trésor    | 18 090                     | AA-     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Apple, Inc.                           | Bon du Trésor    | 5 319                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Bank Of America Corp.                 | Bon du Trésor    | 26 145                     | AA-     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Barclays Bank PLC                     | Bon du Trésor    | 190 380                    | AA-     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | Royaume-Uni                             | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Broadcom Corp.                        | Bon du Trésor    | 14 044                     | A-      | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Broadcom, Inc.                        | Bon du Trésor    | 14 767                     | A-      | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Cigna Group                           | Bon du Trésor    | 26 706                     | BBB+    | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Citibank N.A.                         | Bon du Trésor    | 14 032                     | AA-     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Citigroup, Inc.                       | Bon du Trésor    | 35 460                     | A       | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Constellation Brands, Inc.            | Bon du Trésor    | 29 445                     | BBB-    | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Enbridge, Inc.                        | Bon du Trésor    | 9 499                      | BBB+    | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | ENEL Finance International NV         | Bon du Trésor    | 24 747                     | BBB+    | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Fifth Third Bancorp                   | Bon du Trésor    | 37 122                     | A-      | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Goldman Sachs Group, Inc.             | Bon du Trésor    | 35 934                     | A       | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Hydro Quebec                          | Bon du Trésor    | 245 605                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Intercontinental Exchange, Inc.       | Bon du Trésor    | 32 879                     | A-      | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | JPMorgan Chase & Co.                  | Bon du Trésor    | 27 192                     | AA-     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Province de Colombie Britannique      | Bon du Trésor    | 23 266                     | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                        |                              | Province du Manitoba                  | Bon du Trésor    | 20 426                     | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                        |                              | Province du Nouveau-Brunswick         | Bon du Trésor    | 110 297                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                        |                              | Province de l'Ontario                 | Bon du Trésor    | 1 930 002                  | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                        |                              | Province de l'Ontario                 | Bon du Trésor    | 267 322                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Province du Québec                    | Bon du Trésor    | 1 665 705                  | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                        |                              | Province du Québec                    | Bon du Trésor    | 403 342                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Shell International Finance BV        | Bon du Trésor    | 13 960                     | AA-     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Siemens Financieringsmaatschap pij NV | Bon du Trésor    | 17 325                     | AA-     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | UBS AG                                | Bon du Trésor    | 15 388                     | AA      | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Walmart, Inc.                         | Bon du Trésor    | 10 145                     | AA      | 1 à 3 mois                     | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        |                              | Westpac Banking Corp.                 | Bon du Trésor    | 11 022                     | AA-     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | DTCC, bilatéral               |
|                                                        | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 2 179                      | S/O     | S/O                            | CAD                   | Canada                                  | FED, bilatéral                |
|                                                        | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 64 890                     | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Income Fund II                                   | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 40                         | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | Contrats de mise en pension  | Obligations du Trésor américain       | Bon du Trésor    | 22 073                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain           | Bon du Trésor    | 4 896                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | Contrats de mise en pension  | Province de l'Ontario                 | Bon du Trésor    | 605 521                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Province du Québec                    | Bon du Trésor    | 373 897                    | AA-     | Plus d'un an                   | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain           | Bon du Trésor    | 1 516 628                  | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                        | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                 | Liquidités       | 890                        | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |



| Fonds                                            | Type de titre                | Description de la garantie                             | Type de garantie   | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance Teneur de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|--------------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------------|----------------------------|---------|--------------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|---------------------------|
| Fonds Low Duration Opportunities Fund            | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | \$ 126 786                 | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                  | Contrats de mise en pension  | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | 7 842                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 6 296                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              |                                                        |                    |                            |         |                                |                       |                                         |                           |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund     | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 1 490                      | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 91 496                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                                  | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 3 843                      | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 1 450                      | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor      | 385                        | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund               | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 50                         | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                           | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 2 590                      | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                  | Contrats de mise en pension  | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | 2 723                      | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 812                        | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | France                                  | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              |                                                        |                    |                            |         |                                |                       |                                         |                           |
| Fonds Strategic Income Fund                      | Contrats de mise en pension  | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 83 572                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 33 882                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 1 690                      | S/O     | S/O                            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
| Fonds Total Return Bond Fund                     | Contrats de prise en pension | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 259                        | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | STRIPS du Trésor américain                             | Bon du Trésor      | 940                        | AA+     | 3 mois - 1 an                  | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              |                                                        |                    |                            |         |                                |                       |                                         |                           |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 320                        | S/O     | S/O                            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                     | Contrats de mise en pension  | Bon du Trésor britannique                              | Bon du Trésor      | £ 102                      | AA-     | Plus d'un an                   | GBP                   | France                                  | EUROCLEAR, bilatéral      |
|                                                  |                              | Bon du Trésor britannique                              | Bon du Trésor      | 2 238                      | AA-     | Plus d'un an                   | GBP                   | États-Unis                              | EUROCLEAR, bilatéral      |
|                                                  |                              | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation       | Bon du Trésor      | 102                        | AA-     | Plus d'un an                   | GBP                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral      |
| Fonds US High Yield Bond Fund                    | Contrats de mise en pension  | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | \$ 69 814                  | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 10 506                     | AA+     | Plus d'un an                   | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral            |
|                                                  |                              |                                                        |                    |                            |         |                                |                       |                                         |                           |

Les données agrégées sur les opérations correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues tous OTF et swaps de rendement total confondus au 31 décembre 2025 sont telles que suit :

| Fonds                                       | Type de titre                | Description de la garantie                             | Type de garantie   | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation     |
|---------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Contrats de mise en pension  | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | \$ 34 512                  | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 32 657                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 14 470                     | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund         | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 191                        | S/O     | S/O                     | USD                   | Canada                                  | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 110                        | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 436                        | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor      | 365                        | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund               | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 4 900                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Commodity Real Return Fund            | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 10 710                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 1 370                      | S/O     | S/O                     | USD                   | Australie                               | FED, bilatéral                |
|                                             | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 7 440                      | S/O     | S/O                     | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 4 110                      | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 12 100                     | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund  | Contrats de mise en pension  | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 35 718                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Diversified Income Fund               | Contrats de mise en pension  | Province du Québec                                     | Bon du Trésor      | 14 829                     | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                             |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 87 720                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 268                        | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                             | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 1                          | S/O     | S/O                     | CAD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                             |                              | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor      | 8                          | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds                                              | Type de titre                | Description de la garantie                                  | Type de garantie   | Juste valeur (en milliers) | Qualité      | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation     |
|----------------------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------------------------------|--------------------|----------------------------|--------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|
| Fonds Dynamic Bond Fund                            | Contrats de mise en pension  | Obligation du gouvernement canadien vendue avant l'émission | Bon du Trésor      | \$ 74 218                  | AA+          | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                    |                              | Province de Colombie Britannique                            | Bon du Trésor      | 124 028                    | AA+          | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                                    |                              | Bon du Trésor                                               | 232 308            | AA-                        | Plus d'un an | CAD                     | Canada                | Canada, relations bilatérales           |                               |
|                                                    |                              | Province de l'Ontario                                       | Bon du Trésor      | 107 616                    | AA-          | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                    |                              | Province du Québec                                          | Bon du Trésor      | 198 503                    | AA-          | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                                    |                              | Province du Québec                                          | Bon du Trésor      | 115 670                    | AA-          | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                                    |                              | Province de la Saskatchewan                                 | Bon du Trésor      | 25 430                     | AA           | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                                    |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation      | Bon du Trésor      | 59 277                     | AA+          | Plus d'un an            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Billets du Trésor américain                                 | Bon du Trésor      | 503 490                    | AA+          | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Contrats de prise en pension                                | Bon du Trésor      |                            |              |                         |                       |                                         | Canada, relations bilatérales |
|                                                    | Province de l'Ontario        | Bon du Trésor                                               | 2 263              | AA-                        | Plus d'un an | CAD                     | Canada                |                                         |                               |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                     | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 700                        | S/O          | S/O                     | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                 | Contrats de mise en pension  | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 7 056                      | S/O          | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Billets du Trésor américain                                 | Bon du Trésor      | 4 594                      | AA+          | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                   | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 130                        | S/O          | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 1 909                      | S/O          | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund               | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 1 630                      | S/O          | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 2 187                      | S/O          | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 310                        | S/O          | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Obligation internationale du gouvernement français          | Bon du Trésor      | 320                        | A+           | Plus d'un an            | EUR                   | Royaume-Uni                             | EUROCLEAR, bilatéral          |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                        | Contrats de mise en pension  | Obligations du Trésor américain                             | Bon du Trésor      | 260                        | AA+          | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              | Ginnie Mae                                                  | Mortgage Pass Thru | 84 187                     | AA+          | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Euro Bond Fund                               | Contrats de mise en pension  | LFA Foerderbank Bayern                                      | Bon du Trésor      | € 19 091                   | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | Allemagne, bilatéral          |
| Fonds Euro Credit Fund                             | Contrats de mise en pension  | Obligation internationale du gouvernement belge             | Bon du Trésor      | 7 871                      | A+           | Plus d'un an            | EUR                   | France                                  | EUROCLEAR, bilatéral          |
| Fonds Euro Income Bond Fund                        | Contrats de mise en pension  | Banque d'investissement                                     |                    |                            |              |                         |                       |                                         |                               |
|                                                    |                              | Berlin                                                      | Bon du Trésor      | 16 688                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | ALLEMAGNE, bilatéral          |
|                                                    |                              | Banque d'investissement du Land de Brandebourg              | Bon du Trésor      | 73 784                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | Allemagne, bilatéral          |
|                                                    |                              | Land Schleswig-Holstein                                     | Bon du Trésor      | 72 274                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | Allemagne, bilatéral          |
|                                                    |                              | LFA Foerderbank Bayern                                      | Bon du Trésor      | 41 097                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                              | NRW Bank                                                    | Bon du Trésor      | 60 625                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | Allemagne, bilatéral          |
|                                                    |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 221                        | S/O          | S/O                     | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                    |                              |                                                             |                    |                            |              |                         |                       |                                         |                               |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund              | Contrats de mise en pension  | Banque hambourgeoise d'investissement et de financement     | Bon du Trésor      | 4 693                      | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | Allemagne, bilatéral          |
| Fonds Euro Short-Term Fund                         | Contrats de mise en pension  | Communauté flamande                                         | Bon du Trésor      | 14 408                     | AA-          | Plus d'un an            | EUR                   | France                                  | EUROCLEAR, bilatéral          |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund          | Contrats de mise en pension  | Obligation internationale du gouvernement belge             | Bon du Trésor      | 7 266                      | A+           | Plus d'un an            | EUR                   | France                                  | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités         | 25                         | S/O          | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Contrats de mise en pension  | Banque de développement asiatique                           | Bon du Trésor      | 21 724                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                              | BNG Bank NV                                                 | Bon du Trésor      | 7 350                      | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | EUROCLEAR, bilatéral          |
|                                                    |                              | NRW Bank                                                    | Bon du Trésor      | 22 502                     | AAA          | Plus d'un an            | EUR                   | Allemagne                               | Allemagne, bilatéral          |
|                                                    |                              |                                                             |                    |                            |              |                         |                       |                                         |                               |

| Fonds                                      | Type de titre                | Description de la garantie                                  | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation     |
|--------------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------------------------------|------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|
| Fonds Global Bond Fund                     | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | \$ 3 181                   | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Bond ESG Fund                 | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                                 | Bon du Trésor    | 5 814                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global High Yield Bond Fund          | Contrats de mise en pension  | Billets du Trésor américain                                 | Bon du Trésor    | 261 630                    | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                            | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | 72                         | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                            |                              | Billets du Trésor américain                                 | Bon du Trésor    | 460                        | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Contrats de prise en pension |                                                             |                  |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                            |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | 390                        | S/O     | S/O                     | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Global Real Return Fund              | Contrats de prise en pension | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation      | Bon du Trésor    | 584                        | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | Canada                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Income Fund                          | Contrats de mise en pension  | Advanced Micro Devices Inc.                                 | Bon du Trésor    | 11 166                     | A       | 3 mois - 1 an           | USD                   | France                                  | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | AerCap Ireland Capital DAC                                  | Bon du Trésor    | 9 388                      | BBB+    | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | Barclays Bank PLC                                           | Bon du Trésor    | 284 216                    | A       | 3 mois - 1 an           | USD                   | Royaume-Uni                             | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | Broadcom Corp.                                              | Bon du Trésor    | 14 115                     | BBB+    | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | Broadcom, Inc.                                              | Bon du Trésor    | 15 037                     | BBB+    | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | Obligation à rendement réel du gouvernement canadien        | Bon du Trésor    | 153 371                    | AA+     | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Obligation du gouvernement canadien vendue avant l'émission | Bon du Trésor    | 1 292 622                  | AA+     | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Constellation Brands, Inc.                                  | Bon du Trésor    | 29 631                     | BBB-    | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | Gouvernement de Terre-Neuve-et-Labrador Canada              | Bon du Trésor    | 288 861                    | A       | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                            |                              | Hydro Quebec                                                | Bon du Trésor    | 164 769                    | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Hydro Quebec                                                | Bon du Trésor    | 653 277                    | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | JPMorgan Chase & Co.                                        | Bon du Trésor    | 27 611                     | AA-     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | DTC, bilatéral                |
|                                            |                              | Province d'Alberta                                          | Bon du Trésor    | 861 699                    | AA      | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province d'Alberta                                          | Bon du Trésor    | 1 086 663                  | AA      | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province de Colombie Britannique                            | Bon du Trésor    | 265 075                    | AA+     | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province de Colombie Britannique                            | Bon du Trésor    | 2 769 532                  | AA+     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                            |                              | Province du Manitoba                                        | Bon du Trésor    | 440 518                    | A+      | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province du Manitoba                                        | Bon du Trésor    | 146 608                    | A+      | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                            |                              | Province du Nouveau-Brunswick                               | Bon du Trésor    | 29 790                     | A+      | 3 mois - 1 an           | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province du Nouveau-Brunswick                               | Bon du Trésor    | 220 313                    | A+      | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Bank of Nova Scotia                                         | Bon du Trésor    | 194 496                    | A+      | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, bilatéral             |
|                                            |                              | Bank of Nova Scotia                                         | Bon du Trésor    | 155 891                    | A+      | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                            |                              | Province de l'Ontario                                       | Bon du Trésor    | 2 898 660                  | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province de l'Ontario                                       | Bon du Trésor    | 5 469 056                  | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province du Québec                                          | Bon du Trésor    | 3 168 614                  | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Province du Québec                                          | Bon du Trésor    | 3 194 704                  | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                            |                              | Province de la Saskatchewan                                 | Bon du Trésor    | 460 595                    | AA      | Plus d'un an            | CAD                   | Canada                                  | Canada, relations bilatérales |
|                                            |                              | Obligations du Trésor américain                             | Bon du Trésor    | 102 113                    | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                            |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation      | Bon du Trésor    | 1 021 076                  | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                            |                              | Billets du Trésor américain                                 | Bon du Trésor    | 1 532 776                  | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                            | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | 1 654                      | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                            |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | 17 442                     | S/O     | S/O                     | CAD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                            | Contrats de swap             | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | 176 740                    | S/O     | S/O                     | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                            |                              | Garantie en numéraire                                       | Liquidités       | 24 340                     | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds                                                  | Type de titre                | Description de la garantie                             | Type de garantie   | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation     |
|--------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | \$ 32 334                  | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | Contrats de mise en pension  | Gouvernement de Terre-Neuve-et-Labrador                | Bon du Trésor      | 28 171                     | A       | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Province de Colombie Britannique                       | Bon du Trésor      | 34 669                     | AA+     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, bilatéral             |
|                                                        |                              | Province de l'Ontario                                  | Bon du Trésor      | 794 451                    | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Province du Québec                                     | Bon du Trésor      | 121 644                    | AA-     | Plus d'un an            | CAD                   | États-Unis                              | Canada, relations bilatérales |
|                                                        |                              | Obligations du Trésor américain                        | Bon du Trésor      | 102                        | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 462 192                    | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 169 556                    | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | 170 375                    | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 58 272                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | Contrats de swap             |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 40                         | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 5 712                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
|                                                        | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 1 614                      | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 2 160                      | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund                     | Contrats de swap             |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 360                        | S/O     | S/O                     | USD                   | Australie                               | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 50                         | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 370                        | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 86 744                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 840                        | S/O     | S/O                     | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Garantie en numéraire                                  | Liquidités         | 14 090                     | S/O     | S/O                     | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Ginnie Mae                                             | Mortgage Pass Thru | 2 278                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 2 245                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | France                                  | FED, bilatéral                |
| Fonds Strategic Income Fund                            | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 3 876                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Bon du Trésor      | 157 332                    | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | Royaume-Uni                             | FED, bilatéral                |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 22 032                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 29 988                     | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |
| Fonds US Short-Term Fund                               | Contrats de mise en pension  |                                                        |                    |                            |         |                         |                       |                                         |                               |
|                                                        |                              | Billets du Trésor américain                            | Bon du Trésor      | 2 652                      | AA+     | Plus d'un an            | USD                   | États-Unis                              | FED, bilatéral                |

La juste valeur de la garantie correspondant aux Contrats de mise en pension comprend les intérêts courus.

Les Contrats cadres de transactions à terme couvrent une combinaison d'opérations par achat et revente dos-à-dos, d'opérations par vente et rachat dos-à-dos et d'autres opérations de financement non incluses plus haut. Le montant total des garanties reçues au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 pour toutes les opérations effectuées dans le cadre de ces Contrats est indiqué plus haut. Il n'est pas possible d'analyser séparément la garantie correspondant à chaque OFT.

Les Contrats ISDA couvrent une combinaison d'accords de swap et le montant total des garanties pour ces contrats est indiqué ci-dessus.

Une partie des garanties indiquées se rapporte à des produits dérivés qui ne relèvent pas du champ de la ROFT.

#### (iv) Données de la réutilisation des garanties :

Les titres reçus à titre de garantie ne sont pas réutilisés au 30 juin 2026 ou au 31 décembre 2025.

Les garanties reçues au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 étaient détenues au sein du réseau de dépositaires de State Street Bank and Trust.

#### (v) Garde des garanties données :

Les garanties nanties par les Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 sont détenues par les contreparties sur des comptes autres que des comptes regroupés ou séparés.

**(c) Rendement/Frais**

Les tableaux qui suivent présentent en détail les données sur les rendements et les frais pour chaque type d'OFT et de swap de rendement total pour les périodes closes le 30 juin 2026 et le 30 juin 2025. Les montants sont indiqués dans la devise de référence des Fonds.

| Fonds                                                  | 30 juin 2026                |                        |                              |                        |                                                          |                        |                                                         |                        |
|--------------------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|------------------------------|------------------------|----------------------------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------------------|------------------------|
|                                                        | Contrats de mise en pension |                        | Contrats de prise en pension |                        | Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos |                        | Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos |                        |
|                                                        | Rendement<br>(en milliers)  | Frais<br>(en milliers) | Rendement<br>(en milliers)   | Frais<br>(en milliers) | Rendement<br>(en milliers)                               | Frais<br>(en milliers) | Rendement<br>(en milliers)                              | Frais<br>(en milliers) |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 0                        | \$ 0                   | \$ 3                         | \$ (224)               | \$ 0                                                     | \$ 0                   | \$ 0                                                    | \$ (24)                |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund                | 6                           | 0                      | 0                            | (4)                    | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 3 041                       | 0                      | 0                            | (64)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                    | 22                          | (5)                    | 26                           | (4 626)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                          | 142                         | 0                      | 0                            | (18)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Commodity Real Return Fund                       | 257                         | 0                      | 0                            | (4 353)                | 0                                                        | (2)                    | 0                                                       | (79)                   |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 212                         | 0                      | 0                            | (5)                    | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Diversified Income Fund                          | 621                         | 0                      | 10                           | (1 321)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | 0                           | (3)                    | 0                            | (36)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | 0                           | 0                      | 0                            | (4)                    | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | 10 208                      | 0                      | 0                            | (68)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | 0                           | (238)                  | 942                          | (16 522)               | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                     | 234                         | 0                      | 0                            | (529)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | 0                           | 0                      | 0                            | (5 963)                | 52                                                       | 0                      | 0                                                       | (29)                   |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 558                         | 0                      | 0                            | (5 103)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 0                           | 0                      | 0                            | (15)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 311                         | 0                      | 0                            | (540)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 18                          | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                            | 3 371                       | 0                      | 0                            | (33)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Euro Bond Fund                                   | € 87                        | € 0                    | € 0                          | € (2 987)              | € 0                                                      | € 0                    | € 0                                                     | € 0                    |
| Fonds Euro Credit Fund                                 | 13                          | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | 2 291                       | 0                      | 0                            | (24)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund                  | 48                          | 0                      | 0                            | (6 040)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Euro Short-Term Fund                             | 55                          | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund              | 212                         | 0                      | 26                           | (101)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 108                         | 0                      | 0                            | (1 568)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Global Advantage Fund                            | \$ 0                        | \$ 0                   | \$ 0                         | \$ (1 028)             | \$ 0                                                     | \$ 0                   | \$ 0                                                    | \$ (5)                 |
| Fonds Global Bond Fund                                 | 10                          | 0                      | 0                            | (17 385)               | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (105)                  |
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 135                         | 0                      | 11                           | (9 050)                | 0                                                        | (2)                    | 0                                                       | (773)                  |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | 0                           | (811)                  | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (23)                   |
| Fonds Global Bond Opportunities Fund                   | 4                           | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 3 106                       | 0                      | 0                            | (304)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 30                          | 0                      | 3                            | (7 825)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (40)                   |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 167                         | 0                      | 0                            | (979)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (206)                  |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 0                           | 0                      | 0                            | (18 284)               | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (44)                   |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 12                          | 0                      | 0                            | (19 486)               | 0                                                        | (33)                   | 0                                                       | (377)                  |
| Fonds Income Fund                                      | 169 916                     | 0                      | 789                          | (1 003)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (1)                    |
| Fonds Income Fund II                                   | 1                           | 0                      | 0                            | (98)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (65)                   |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 521                         | 0                      | 0                            | (32)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 1 472                       | 0                      | 0                            | (2)                    | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 21 171                      | 0                      | 30                           | (45)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | 4 565                       | 0                      | 0                            | (3)                    | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund              | 0                           | 0                      | 0                            | (11)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (8)                    |
| Fonds MAARS Multi-Strategy Fund                        | 42                          | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | 1 239                       | 0                      | 0                            | (13 556)               | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (10)                   |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund                     | 0                           | 0                      | 0                            | (254)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (29)                   |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | 427                         | 0                      | 0                            | (2 922)                | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (17)                   |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 79                          | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Strategic Income Fund                            | 1 953                       | 0                      | 0                            | 0                      | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | 137                         | 0                      | 0                            | (694)                  | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | (7)                    |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 35                          | 0                      | 0                            | (1)                    | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                           | £ 15                        | £ 0                    | £ 0                          | £ (4)                  | £ 0                                                      | £ 0                    | £ 0                                                     | £ 0                    |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | \$ 2 406                    | \$ 0                   | \$ 0                         | \$ (178)               | \$ 0                                                     | \$ 0                   | \$ 0                                                    | \$ 0                   |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 227                         | 0                      | 0                            | (25)                   | 0                                                        | 0                      | 0                                                       | 0                      |
| Fonds US Short-Term Fund                               | 49                          | 0                      | 0                            | (285)                  | 0                                                        | (2)                    | 0                                                       | (1 002)                |

## Notes relatives aux États financiers (suite)

30 juin 2025

| Fonds                                                  | Contrats de mise en pension |                     | Contrats de prise en pension |                     | Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos |                     | Transactions de financement par vente et rachat dos-à-dos |                     |
|--------------------------------------------------------|-----------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|----------------------------------------------------------|---------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------|
|                                                        | Rendement (en milliers)     | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers)      | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers)                                  | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers)                                   | Frais (en milliers) |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 167                      | \$ 0                | \$ 0                         | \$ (388)            | \$ 0                                                     | \$ 0                | \$ 0                                                      | \$ 0                |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund                | 50                          | 0                   | 0                            | (3)                 | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 951                         | 0                   | 0                            | (49)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund                    | 252                         | 0                   | 0                            | (6 302)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund                          | 45                          | 0                   | 0                            | (12)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Commodity Real Return Fund                       | 232                         | 0                   | 0                            | (5 431)             | 0                                                        | (13)                | 0                                                         | (160)               |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 1 159                       | 0                   | 0                            | (23)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Diversified Income Fund                          | 7 242                       | 0                   | 34                           | (1 413)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund          | 51                          | 0                   | 0                            | (15)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Diversified Income ESG Fund                      | 0                           | 0                   | 0                            | (3)                 | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Dynamic Bond Fund                                | 14 840                      | 0                   | 0                            | (86)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Emerging Local Bond Fund                         | 647                         | 0                   | 301                          | (9 085)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund                     | 131                         | 0                   | 0                            | (325)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund                       | 1                           | 0                   | 0                            | (6 961)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 808                         | 0                   | 0                            | (6 095)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (5)                 |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 0                           | 0                   | 0                            | (73)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 101                         | 0                   | 0                            | (809)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 26                          | 0                   | 0                            | (8)                 | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund                            | 1 486                       | 0                   | 0                            | (46)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (2)                 |
| Fonds Euro Bond Fund                                   | € 155                       | € 0                 | € 0                          | € (23)              | € 0                                                      | € 0                 | € 0                                                       | € 0                 |
| Fonds Euro Credit Fund                                 | 75                          | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Euro Income Bond Fund                            | 2 045                       | 0                   | 0                            | (74)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund                  | 61                          | 0                   | 0                            | (3 911)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Euro Short-Term Fund                             | 177                         | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund              | 171                         | 0                   | 0                            | (30)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 342                         | 0                   | 0                            | (8)                 | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Global Advantage Fund                            | \$ 0                        | \$ 0                | \$ 0                         | \$ (488)            | \$ 0                                                     | \$ (1)              | \$ 0                                                      | \$ (299)            |
| Fonds Global Bond Fund                                 | 261                         | 0                   | 3                            | (3 270)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (698)               |
| Fonds Global Bond ESG Fund                             | 386                         | 0                   | 0                            | (3 166)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (3 772)             |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund                           | 0                           | 0                   | 0                            | (268)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (453)               |
| Fonds Global High Yield Bond Fund                      | 335                         | 0                   | 0                            | (1 966)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (11)                |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund              | 3 158                       | 0                   | 0                            | (505)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (216)               |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 548                         | 0                   | 0                            | (848)               | 0                                                        | (29)                | 0                                                         | (573)               |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund             | 1                           | 0                   | 0                            | (14 020)            | 0                                                        | (54)                | 0                                                         | (517)               |
| Fonds Global Real Return Fund                          | 7                           | 0                   | 0                            | (23 610)            | 0                                                        | (7)                 | 0                                                         | (367)               |
| Fonds Income Fund                                      | 78 006                      | 0                   | 0                            | (466)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Income Fund II                                   | 1                           | 0                   | 0                            | (60)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (57)                |
| Fonds Low Average Duration Fund                        | 579                         | 0                   | 0                            | (1 079)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (79)                |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 2 276                       | 0                   | 0                            | (161)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Low Duration Income Fund                         | 1 990                       | 0                   | 0                            | (81)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund                  | 2 005                       | 0                   | 0                            | (6)                 | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund              | 0                           | 0                   | 0                            | (7)                 | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (12)                |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund                      | 914                         | 0                   | 0                            | (4 698)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (5)                 |
| Fonds PIMCO Real Asset Growth Fund                     | 0                           | 0                   | 0                            | (299)               | 0                                                        | (17)                | 0                                                         | (399)               |
| Fonds StocksPLUS™ Fund                                 | 13 825                      | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 50                          | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds Strategic Income Fund                            | 151                         | 0                   | 0                            | (1 420)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (485)               |
| Fonds Total Return Bond Fund                           | 0                           | 0                   | 0                            | (2 847)             | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (409)               |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 105                         | 0                   | 0                            | (80)                | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds UK Corporate Bond Fund                           | £ 39                        | £ 0                 | £ 0                          | £ (6)               | £ 0                                                      | £ 0                 | £ 0                                                       | £ 0                 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 14                          | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | 0                   |
| Fonds US High Yield Bond Fund                          | \$ 1 218                    | \$ 0                | \$ 2                         | \$ (846)            | \$ 0                                                     | \$ 0                | \$ 0                                                      | \$ 0                |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 351                         | 0                   | 0                            | (290)               | 0                                                        | 0                   | 0                                                         | (2)                 |
| Fonds US Short-Term Fund                               | 979                         | 0                   | 0                            | 0                   | 0                                                        | (6)                 | 0                                                         | (22)                |



Tous les rendements des opérations sur instruments financiers dérivés OFT sont acquis au Fonds et ne font l'objet d'aucun accord de partage des rendements avec le Gestionnaire de la Société ni aucun autre tiers.

En ce qui concerne les swaps de rendement total, les frais de transaction ne peuvent être identifiés séparément. Pour ces investissements, les frais de transaction sont inclus dans le prix d'achat et de vente et font partie de la performance d'investissement brut de chaque Fonds. Les rendements sont identifiés comme les plus-values réalisées et la variation des plus-values latentes sur le contrat de swap au cours de l'exercice, qui sont incluses dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés et la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés au Compte de résultat.

## 21. ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS

En février 2022, la Russie a lancé une invasion de l'Ukraine. Par conséquent, la Russie, ainsi que d'autres pays, personnes et entités ayant apporté une aide matérielle à l'agression menée par la Russie contre l'Ukraine, ont fait l'objet de sanctions économiques, ainsi que de restrictions à l'importation et à l'exportation imposées par de nombreux pays à travers le monde, y compris les États-Unis. De telles mesures, notamment l'application par les États-Unis de sanctions ou d'autres dispositifs similaires à l'encontre de divers organismes et citoyens russes, ainsi que la réponse du gouvernement russe, ont eu (et pourraient continuer d'avoir) un effet défavorable sur les titres, les instruments et les économies de la Russie, de la Biélorussie et d'autres pays, ce qui pourrait, en retour, avoir un impact négatif sur les Fonds. L'ampleur, la durée et l'impact de l'intervention militaire de la Russie en Ukraine, des sanctions et des mesures de représailles qui en découlent sont difficiles à déterminer, mais ils pourraient être importants et avoir des effets négatifs graves sur la région, notamment sur les économies régionales, européennes et mondiales et sur les marchés pour certains titres et matières premières, tels que le pétrole et le gaz naturel, ainsi que d'autres secteurs. Par ailleurs, les Fonds peuvent détenir des titres et instruments économiquement liés à la région, qui ont pu être affectés négativement par les sanctions et contre-sanctions imposées par la Russie, notamment par une baisse de leur valeur et une diminution de leur liquidité. Les sanctions peuvent obliger les Fonds à vendre des participations en portefeuille à un moment ou à un prix désavantageux ou à continuer à détenir des investissements que les Fonds pourraient ne plus vouloir détenir.

Depuis octobre 2023, les Israéliens et les Palestiniens s'affrontent en Israël et dans la Bande de Gaza. En avril 2024, l'Iran et Israël se sont lancés dans des offensives militaires réciproques. Depuis février 2026, le Moyen-Orient élargi est le théâtre d'un conflit armé qui affecte le détroit d'Ormuz. Les Fonds peuvent avoir investi dans des titres et instruments qui sont économiquement liés à ces zones de conflits. Ces investissements peuvent avoir été affectés négativement par les éventuelles sanctions et contre-sanctions, engendrant notamment une baisse de valeur et de liquidité. La réduction de la liquidité des investissements peut obliger les Fonds à vendre des participations en portefeuille à un moment ou à un prix désavantageux. En outre, le conflit au Moyen-Orient a provoqué, et pourrait continuer de provoquer, d'importantes perturbations sur le marché ainsi qu'une forte volatilité. PIMCO continuera à gérer activement ces positions dans le meilleur intérêt des Fonds et de leurs actionnaires.

L'application par les États-Unis de restrictions sur les investissements américains dans certains émetteurs et de droits de douane sur les marchandises provenant de certains autres pays a contribué et pourrait continuer de contribuer aux tensions commerciales internationales et pourrait avoir une incidence sur les titres en portefeuille. En avril 2025, le gouvernement américain a indiqué son intention de modifier son

approche de la politique commerciale internationale, y compris, dans certains cas, en renégociant, en modifiant ou en résiliant certains accords commerciaux bilatéraux ou multilatéraux conclus avec des pays étrangers, et a indiqué son intention de prendre, et/ou a déjà pris, des mesures en ce sens, notamment l'application ou l'annonce de l'application potentielle d'un large éventail de droits de douane. L'imposition de droits de douane, de restrictions commerciales, de restrictions monétaires ou d'autres mesures similaires (ou les mesures de rétorsion prises en réponse) pourrait entraîner, par exemple, une volatilité des prix, une baisse de la confiance des marchés et une évolution des anticipations en matière d'inflation. Ces événements géopolitiques, parmi d'autres, peuvent contribuer à une instabilité accrue des économies et des marchés, tant aux États-Unis qu'à l'échelle mondiale, ce qui pourrait avoir un effet défavorable sur la performance des Fonds et de leurs investissements.

Le 19 février 2026, la société a obtenu l'agrément de la FCA dans le cadre du régime applicable aux fonds étrangers.

Le 14 avril 2026, la fréquence de distribution des parts des catégories Revenu et Revenu II du Fonds de Revenu Stratégique est passée d'un versement trimestriel à un versement mensuel.

Le 21 avril 2026, la fréquence de distribution des parts des catégories Revenu et Revenu II du fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund est passée d'un rythme trimestriel à un rythme mensuel.

Le Fonds MAARS Emerging Multi-Asset Fund a été liquidé le 12 mai 2026.

À la même date, une renonciation aux Frais de gestion de 30 points de base a été introduit pour la Catégorie d'actions H Institutions du Fonds UK Corporate Bond Fund pour une durée d'un an, jusqu'au 13 mai 2027.

Le 10 juin 2026, le fonds Global Bond Opportunities a été lancé.

Le 30 juin 2026, la renonciation aux Frais de gestion pour la Catégorie H Institutions du Fonds UK Corporate Bond Fund a été prolongée d'un an, jusqu'au 30 juin 2027.

Aucun autre événement important n'est intervenu au cours de la période.

## 22. ÉVÉNEMENTS POSTÉRIEURS

Le 31 juillet 2026, le Fonds Global Multi-Asset Fund a été renommé de manière à devenir PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. À la même date, l'indice de référence du Fonds a été modifié comme suit : 30 % de l'indice S&P Global Infrastructure Net Total Return, 10 % de l'indice FTSE EPRA NAREIT Developed, 10 % de l'indice Alerian MLP Total Return (non couvert en USD), 10 % de l'indice S&P Global Natural Resources Net Total Return, 20 % de l'indice Bloomberg Commodity Total Return, 10 % de l'indice BCOM Gold Subindex Total Return et 10 % de l'indice Bloomberg World Govt ILB 1-5 ans Total Return (couvert en USD).

Aucun autre événement important n'a eu lieu après la clôture de la période en dehors de ceux susmentionnés.

## 23. APPROBATION DES ÉTATS FINANCIERS

Les états financiers ont été approuvés le 25 août 2026 par le Conseil d'administration.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                          | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                  |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 46 811 768 \$                    | 466 852               |
|                                                                                 | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>3,625 % éch. 31/12/2030                          | \$ 13 700                        | 13 646                |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT<br>7,150 % éch. 22/10/2031                 | 12 500                           | 12 500                |
| PCPD Capital Ltd.<br>7,500 % éch. 15/05/2029                                    | 11 200                           | 10 969                |
| San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,375 % éch. 20/10/2030               | 10 800                           | 10 854                |
| Billets du Trésor américain<br>3,750 % éch. 31/01/2031                          | 10 800                           | 10 831                |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                       | COP 37 705 600                   | 9 484                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,000 % éch. 15/11/2035                          | \$ 9 500                         | 9 391                 |
| Muthoot Finance Ltd.<br>5,750 % éch. 04/08/2030                                 | 8 800                            | 8 767                 |
| Cas Capital Ltd.<br>6,250 % éch. 13/01/2031                                     | 8 700                            | 8 697                 |
| West China Cement Ltd.<br>10,500 % éch. 11/11/2029                              | 7 900                            | 7 865                 |
| Wynn Macau Ltd.<br>5,500 % éch. 01/10/2027                                      | 7 400                            | 7 390                 |
| Melco Resorts Finance Ltd.<br>5,375 % éch. 04/12/2029                           | 7 500                            | 7 283                 |
| SJM International Ltd.<br>6,500 % éch. 15/01/2031                               | 7 150                            | 7 108                 |
| Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.<br>6,500 % éch. 02/02/2031                         | 7 100                            | 7 100                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | 7 092                            | 6 978                 |
| Shui On Development Holding Ltd.<br>9,750 % éch. 26/01/2029                     | 6 000                            | 5 905                 |
| Yuexiu REIT MTN Co. Ltd.<br>6,500 % éch. 12/02/2029                             | 5 900                            | 5 900                 |
| Wynn Macau Ltd.<br>5,125 % éch. 15/12/2029                                      | 6 000                            | 5 801                 |
| Treasury Corp. of Victoria<br>2,000 % éch. 20/11/2037                           | AUD 12 100                       | 5 780                 |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                          | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                  |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 48 637 107 \$                    | 485 060                   |
|                                                                                 | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement philippin<br>6,250 % éch. 28/02/2029  | PHP 1 991 150                    | 33 429                    |
| Standard Chartered PLC<br>7,750 % éch. 15/08/2027                               | \$ 17 200                        | 17 719                    |
| Melco Resorts Finance Ltd.<br>6,500 % éch. 24/09/2033                           | 10 100                           | 9 872                     |
| San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,125 % éch. 02/12/2029               | 9 300                            | 9 316                     |
| Wynn Macau Ltd.<br>6,750 % éch. 15/02/2034                                      | 9 300                            | 9 240                     |
| City of Ulaanbaatar Mongolia<br>7,750 % éch. 21/08/2027                         | 8 100                            | 8 302                     |
| Shriram Finance Ltd.<br>6,625 % éch. 22/04/2027                                 | 7 053                            | 7 171                     |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.<br>7,110 % éch. 11/03/2032                   | 6 300                            | 6 549                     |
| Franshion Brilliant Ltd.<br>4,250 % éch. 23/07/2029                             | 6 900                            | 6 401                     |
| UPL Corp. Ltd.<br>4,625 % éch. 16/06/2030                                       | 6 300                            | 5 737                     |
| QNB Finance Ltd.<br>4,679 % éch. 27/04/2029                                     | 5 500                            | 5 509                     |
| GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % éch. 20/05/2028                                        | 6 600                            | 5 464                     |
| Wynn Macau Ltd.<br>5,125 % éch. 15/12/2029                                      | 5 409                            | 5 333                     |
| Meituan<br>5,125 % éch. 05/11/2035                                              | 5 400                            | 5 327                     |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % éch. 14/01/2032                 | 4 900                            | 5 279                     |
| Standard Chartered PLC<br>7,000 % éch. 14/11/2035                               | 5 200                            | 5 244                     |
| Medco Maple Tree Pte Ltd.<br>8,960 % éch. 27/04/2029                            | 5 000                            | 5 209                     |
| Nomura Holdings, Inc.<br>7,000 % éch. 15/07/2030                                | 5 000                            | 5 177                     |
|                                                                                 | ACTIONS                          |                           |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (a)          | 324 886                          | 5 000                     |

(a) Le Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                          | ACTIONS                          | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |                                  |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 6 128 007                        | \$ 61 112             |
|                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>3,750 % éch. 31/01/2031                               | \$ 7 900                         | 7 919                 |
| Singapore Airlines Ltd.<br>3,000 % éch. 20/07/2026                                   | 4 300                            | 4 295                 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,726 % éch. 31/03/2026       | MYR 14 959                       | 3 805                 |
| PCPD Capital Ltd.<br>7,500 % éch. 15/05/2029                                         | \$ 3 200                         | 3 134                 |
| San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,375 % éch. 20/10/2030                    | 2 900                            | 2 915                 |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                            | COP 10 455 200                   | 2 630                 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>3,900 % éch. 30/11/2026       | MYR 8 910                        | 2 306                 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT<br>7,150 % éch. 22/10/2031                      | \$ 2 300                         | 2 300                 |
| Melco Resorts Finance Ltd.<br>5,625 % éch. 17/07/2027                                | 2 090                            | 2 083                 |
| Bank of East Asia Ltd.<br>5,375 % éch. 13/05/2032                                    | 1 750                            | 1 748                 |
| Yuexiu REIT MTN Co. Ltd.<br>6,500 % éch. 12/02/2029                                  | 1 700                            | 1 700                 |
| Advanced Info Service PCL<br>4,894 % éch. 04/03/2036                                 | 1 700                            | 1 700                 |
| Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.<br>6,500 % éch. 02/02/2031                              | 1 600                            | 1 600                 |
| Axis Bank Ltd.<br>4,100 % éch. 08/09/2026                                            | 1 600                            | 1 591                 |
| Fubon Life Singapore Pte. Ltd.<br>5,450 % éch. 10/12/2035                            | 1 600                            | 1 577                 |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % éch. 27/09/2028                      | 1 500                            | 1 534                 |
| Treasury Corp. of Victoria<br>2,000 % éch. 20/11/2037                                | AUD 3 200                        | 1 529                 |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara<br>5,450 % éch. 03/02/2036 | \$ 1 500                         | 1 496                 |
| HDFC Bank Ltd.<br>5,067 % éch. 24/06/2031                                            | 1 400                            | 1 400                 |

| DESCRIPTION                                                                          | ACTIONS                          | PRODUITS<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |                                  |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 7 370 040                        | \$ 73 500                 |
|                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement philippin<br>6,250 % éch. 28/02/2029       | PHP 300 000                      | 4 961                     |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,726 % éch. 31/03/2026       | MYR 14 013                       | 3 601                     |
| GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % éch. 20/05/2028                                             | \$ 2 200                         | 1 830                     |
| Obligation internationale du gouvernement philippin<br>8,000 % éch. 19/07/2031       | PHP 93 300                       | 1 696                     |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara<br>4,000 % éch. 30/06/2050 | \$ 2 300                         | 1 657                     |
| BDO Unibank, Inc.<br>4,375 % éch. 03/12/2030                                         | 1 400                            | 1 402                     |
| San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>8,375 % éch. 20/10/2030                    | 1 400                            | 1 398                     |
| PRIO Luxembourg Holding SARL<br>6,750 % éch. 15/10/2030                              | 1 400                            | 1 376                     |
| Turk Telekomunikasyon A/S<br>6,950 % éch. 07/10/2032                                 | 1 300                            | 1 327                     |
| PCPD Capital Ltd.<br>7,500 % éch. 15/05/2029                                         | 1 300                            | 1 297                     |
| CTF Services Ltd.<br>0,750 % éch. 03/10/2028                                         | HKD 10 000                       | 1 291                     |
| Pertamina Hulu Energi PT<br>5,250 % éch. 21/05/2030                                  | \$ 1 200                         | 1 204                     |
| Obligation internationale du gouvernement philippin<br>6,500 % éch. 19/05/2029       | PHP 62 950                       | 1 079                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                               | \$ 1 020                         | 1 001                     |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>3,550 % éch. 31/03/2032      | 1 000                            | 942                       |
| Shriram Finance Ltd.<br>6,625 % éch. 22/04/2027                                      | 900                              | 913                       |
| Greentown China Holdings Ltd.<br>8,450 % éch. 24/02/2028                             | 900                              | 913                       |
| Standard Chartered PLC<br>7,000 % éch. 14/11/2035                                    | 900                              | 907                       |
| Wynn Macau Ltd.<br>5,125 % éch. 15/12/2029                                           | 900                              | 893                       |

(a) Le Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund

| DESCRIPTION                                                                          | ACTIONS                          | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                          | ACTIONS                          | PRODUITS<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |                                  |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |                                  |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 555 497 527                      | \$ 5 540 057          | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 476 090 471                      | \$ 4 748 125              |
| NVIDIA Corp.                                                                         | 1 341 312                        | 260 085               |                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
|                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                      |                                  |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,875 % éch. 15/07/2035 (b)   | \$ 207 693                       | 205 365               | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,500 % éch. 01/01/2056 | \$ 129 794                       | 130 646                   |
|                                                                                      | ACTIONS                          |                       |                                                                                      | ACTIONS                          |                           |
| Apple, Inc.                                                                          | 708 556                          | 196 709               | QUALCOMM, Inc.                                                                       | 545 281                          | 125 395                   |
| Microsoft Corp.                                                                      | 415 094                          | 172 460               | Verizon Communications, Inc.                                                         | 1 945 867                        | 93 038                    |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.                                          | 2 240 000                        | 138 385               | Micron Technology, Inc.                                                              | 107 222                          | 78 912                    |
| Meta Platforms, Inc. « A »                                                           | 224 408                          | 135 391               | Procter & Gamble Co.                                                                 | 516 878                          | 74 337                    |
| Texas Instruments, Inc.                                                              | 476 140                          | 134 628               |                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
|                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                      |                                  |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,000 % éch. 01/05/2056 | \$ 133 219                       | 131 049               | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                               | \$ 73 190                        | 71 841                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,500 % éch. 01/01/2056 | 129 794                          | 130 362               | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,500 % éch. 01/08/2054 | 57 529                           | 59 804                    |
|                                                                                      | ACTIONS                          |                       |                                                                                      | ACTIONS                          |                           |
| Amgen, Inc.                                                                          | 366 318                          | 124 534               | Murata Manufacturing Co. Ltd.                                                        | 892 000                          | 58 021                    |
| ASML Holding NV                                                                      | 87 024                           | 124 032               | Johnson & Johnson                                                                    | 234 676                          | 55 547                    |
| AbbVie, Inc.                                                                         | 552 908                          | 122 984               | Intesa Sanpaolo SpA                                                                  | 8 092 810                        | 54 700                    |
| Charles Schwab Corp.                                                                 | 1 238 945                        | 113 192               | SK Hynix, Inc.                                                                       | 50 233                           | 53 653                    |
|                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Philip Morris International, Inc.                                                    | 288 261                          | 50 238                    |
|                                                                                      |                                  |                       |                                                                                      | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,000 % éch. 01/07/2055 | \$ 104 506                       | 107 396               | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,500 % éch. 01/02/2054 | \$ 46 196                        | 48 022                    |
|                                                                                      | ACTIONS                          |                       |                                                                                      | ACTIONS                          |                           |
| AT&T, Inc.                                                                           | 4 142 747                        | 107 352               | Newmont Corp.                                                                        | 399 021                          | 46 337                    |
| TJX Cos., Inc.                                                                       | 672 349                          | 105 213               | Lam Research Corp.                                                                   | 126 912                          | 43 727                    |
| Progressive Corp.                                                                    | 442 270                          | 91 728                | Goldman Sachs Group, Inc.                                                            | 34 976                           | 35 827                    |
| Amazon.com, Inc.                                                                     | 353 525                          | 90 663                | ConocoPhillips Co.                                                                   | 299 760                          | 35 708                    |
| Tokyo Electron Ltd.                                                                  | 310 200                          | 90 065                | Corteva, Inc.                                                                        | 427 901                          | 34 881                    |
|                                                                                      |                                  |                       | Applied Materials, Inc.                                                              | 58 776                           | 34 655                    |

(a) Le Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO Capital Securities Fund

| DESCRIPTION                                                   | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |        | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                              | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |    | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------|----------------------------------|--------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----|---------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026                                  |                                  |        |                       | VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026                                             |                                  |    |                           |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>3,509 % éch. 17/08/2033          | €                                | 56 800 | \$ 64 595             | Intesa Sanpaolo SpA<br>7,778 % éch. 20/06/2054                           | \$ 39 600                        | \$ | 47 103                    |
| Coöperatieve Rabobank UA<br>5,500 % éch. 01/08/2033           |                                  | 53 400 | 63 060                | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                   | 30 350                           |    | 29 790                    |
| UBS Group AG<br>6,875 % éch. 05/06/2032                       | \$                               | 44 200 | 44 200                | Goldman Sachs Group, Inc.<br>3,984 % éch. 18/12/2036                     | € 23 700                         |    | 27 080                    |
| BNP Paribas Cardif S.A.<br>6,125 % éch. 19/12/2033            | €                                | 35 100 | 40 549                | UBS Group AG<br>4,875 % éch. 12/02/2027                                  | \$ 25 700                        |    | 25 610                    |
| Morgan Stanley<br>4,555 % éch. 10/04/2030                     | \$                               | 30 200 | 30 261                | Deutsche Bank AG<br>6,750 % éch. 30/10/2034                              | € 21 000                         |    | 25 160                    |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036        |                                  | 30 350 | 30 046                | UBS Group AG<br>4,875 % éch. 12/02/2027                                  | \$ 25 000                        |    | 24 938                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,516 % éch. 21/01/2032          |                                  | 29 700 | 29 700                | Goldman Sachs Group, Inc.<br>1,000 % éch. 17/02/2039                     | € 20 000                         |    | 22 777                    |
| Banco Santander S.A.<br>7,250 % éch. 03/12/2035               |                                  | 28 800 | 28 800                | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>6,600 % éch. 05/06/2034         | \$ 20 800                        |    | 21 472                    |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045     |                                  | 29 700 | 28 133                | Intesa Sanpaolo SpA<br>8,248 % éch. 21/11/2033                           | 17 000                           |    | 20 259                    |
| BNP Paribas S.A.<br>5,625 % éch. 16/02/2033                   | €                                | 22 200 | 26 446                | Lloyds Banking Group PLC<br>6,625 % éch. 27/09/2035                      | 20 000                           |    | 19 936                    |
| Erste Group Bank AG<br>5,875 % éch. 15/04/2033                |                                  | 21 800 | 24 951                | Crédit Agricole S.A.<br>4,125 % éch. 17/12/2036                          | € 16 700                         |    | 19 410                    |
| Deutsche Bank AG<br>6,750 % éch. 30/10/2035                   |                                  | 21 000 | 24 732                | AXA S.A.<br>4,125 % éch. 24/07/2056                                      | 14 000                           |    | 16 316                    |
| Stellantis NV<br>6,875 % éch. 16/12/2033                      |                                  | 21 400 | 24 575                | Svenska Handelsbanken AB<br>4,750 % éch. 01/03/2031                      | \$ 17 000                        |    | 16 129                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>1,000 % éch. 17/02/2039          |                                  | 20 000 | 23 834                | Prudential Financial, Inc.<br>6,500 % éch. 15/03/2054                    | 15 100                           |    | 15 802                    |
| Banco Nacional de Mexico S.A.<br>6,697 % éch. 07/08/2036      | \$                               | 20 500 | 20 500                | Lloyds Banking Group PLC<br>8,500 % éch. 27/09/2027                      | £ 10 700                         |    | 14 998                    |
| Aviva PLC<br>4,750 % éch. 28/11/2057                          | €                                | 17 500 | 20 119                | PNC Financial Services Group, Inc.<br>1,000 % éch. 26/01/2029            | \$ 15 000                        |    | 14 963                    |
| Crédit Agricole S.A.<br>4,125 % éch. 17/12/2036               |                                  | 16 700 | 19 264                | HSBC Holdings PLC<br>1,000 % éch. 31/12/2099                             | 14 700                           |    | 14 834                    |
| UBS Group AG<br>7,000 % éch. 10/02/2030                       | \$                               | 17 800 | 18 211                | CCF Holding S.A.S.<br>5,000 % éch. 27/05/2035                            | € 12 500                         |    | 14 668                    |
| Nippon Life Insurance Co.<br>4,114 % éch. 23/01/2055          | €                                | 14 000 | 16 328                | Charles Schwab Corp.<br>4,343 % éch. 14/11/2031                          | \$ 14 500                        |    | 14 424                    |
| Lloyds Banking Group PLC<br>7,875 % éch. 27/06/2029           | £                                | 11 000 | 15 470                | BPCE S.A.<br>2,125 % éch. 13/10/2046                                     | € 14 000                         |    | 14 417                    |
| PNC Financial Services Group, Inc.<br>1,000 % éch. 26/01/2029 | \$                               | 15 000 | 15 000                | Legal & General Group PLC<br>5,250 % éch. 21/03/2047                     | \$ 14 400                        |    | 14 404                    |
| American Express Co.<br>4,456 % éch. 10/02/2032               |                                  | 14 900 | 14 900                | Intesa Sanpaolo SpA<br>1,000 % éch. 31/12/2099                           | € 12 000                         |    | 14 174                    |
| HSBC Holdings PLC<br>1,000 % éch. 31/12/2099                  |                                  | 14 700 | 14 700                | Banco Santander S.A.<br>8,000 % éch. 01/02/2034                          | \$ 13 200                        |    | 14 170                    |
| HSBC Holdings PLC<br>6,750 % éch. 18/11/2032                  |                                  | 14 700 | 14 700                | Standard Chartered PLC<br>7,000 % éch. 14/11/2035                        | 14 000                           |    | 14 132                    |
| Bank of Ireland Group PLC<br>6,375 % éch. 10/03/2030          | €                                | 12 000 | 14 573                | ELO SACA<br>3,250 % éch. 23/07/2027                                      | € 11 900                         |    | 13 928                    |
| BNP Paribas Cardif S.A.<br>4,414 % éch. 27/05/2041            |                                  | 12 400 | 14 380                | BNP Paribas S.A.<br>5,625 % éch. 16/02/2033                              | 12 000                           |    | 13 655                    |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>1,000 % éch. 31/12/2099                |                                  | 12 000 | 14 297                | Mutuelle Assurance Travailleur Mutualiste SAM<br>4,625 % éch. 23/02/2036 | 10 900                           |    | 13 216                    |
| Engie S.A.<br>6,125 % éch. 16/01/2032                         | £                                | 10 400 | 14 084                | ASR Nederland NV<br>7,000 % éch. 07/12/2043                              | 9 100                            |    | 12 813                    |
| Athora Holding Ltd.<br>5,375 % éch. 16/12/2037                | €                                | 12 300 | 13 976                | Eni SpA<br>4,875 % éch. 21/01/2034                                       | 10 000                           |    | 12 144                    |
| BNP Paribas S.A.<br>7,200 % éch. 17/04/2036                   | \$                               | 13 200 | 13 200                | Verizon Communications, Inc.<br>3,996 % éch. 15/06/2056                  | 10 750                           |    | 12 142                    |
| Société Générale S.A.<br>10,000 % éch. 14/11/2028             |                                  | 11 200 | 12 477                | Ocado Group PLC<br>11,000 % éch. 15/06/2030                              | £ 8 500                          |    | 11 810                    |
| BNP Paribas Cardif S.A.<br>4,875 % éch. 27/11/2046            | €                                | 10 600 | 12 292                | ABN AMRO Bank NV<br>6,375 % éch. 22/09/2034                              | € 8 600                          |    | 10 506                    |
| Marex Group PLC<br>7,700 % éch. 09/06/2032                    | \$                               | 11 500 | 11 500                | ABN AMRO Bank NV<br>6,875 % éch. 22/09/2031                              | 8 400                            |    | 10 471                    |
|                                                               |                                  |        |                       | DNB Bank ASA<br>7,375 % éch. 30/05/2029                                  | \$ 10 000                        |    | 10 363                    |
|                                                               |                                  |        |                       | Groupe des Assurances du Crédit Mutuel SADIR<br>5,000 % éch. 30/10/2044  | € 8 700                          |    | 10 306                    |
|                                                               |                                  |        |                       | Goldman Sachs Group, Inc.<br>5,851 % éch. 25/04/2035                     | \$ 9 900                         |    | 10 281                    |
|                                                               |                                  |        |                       | Bank of Nova Scotia<br>7,350 % éch. 27/04/2085                           | 9 500                            |    | 9 842                     |

| DESCRIPTION                                                   | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers) |        |    | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------|----------------------------------|--------|----|---------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026 (suite)                          |                                  |        |    |                           |
| Nationwide Building Society<br>7,500 % éch. 20/12/2030        | £                                | 7 300  | \$ | 9 837                     |
| Ubisoft Entertainment S.A.<br>2,375 % éch. 15/11/2028         | €                                | 8 500  |    | 9 613                     |
| Swedbank AB<br>7,750 % éch. 17/03/2030                        | \$                               | 8 800  |    | 9 295                     |
| Scotiabank Capital Trust<br>5,650 % éch. 31/12/2056           | CAD                              | 12 000 |    | 9 132                     |
| Stichting AK Rabobank Certificaten<br>6,500 % éch. 29/12/2049 | €                                | 6 800  |    | 9 096                     |
| Generali<br>4,126 % éch. 14/01/2036                           |                                  | 7 600  |    | 9 085                     |
| ING Groep NV<br>4,250 % éch. 16/05/2031                       | \$                               | 10 300 |    | 8 961                     |
| Nationwide Building Society<br>3,770 % éch. 27/01/2036        | €                                | 7 300  |    | 8 689                     |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO Climate Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                            |                                     |                           |
| T-Mobile USA, Inc.<br>5,750 % éch. 15/01/2034                                | \$ 3 000                            | \$ 3 150              | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>1,375 % éch. 07/06/2032                     | € 8 500                             | \$ 8 935                  |
| BNP Paribas S.A.<br>3,739 % éch. 20/04/2034                                  | € 2 300                             | 2 680                 | Landwirtschaftliche Rentenbank<br>2,625 % éch. 08/07/2032                      | 2 335                               | 2 730                     |
| Royal Bank of Canada<br>3,375 % éch. 15/06/2030                              | 2 300                               | 2 659                 | Kerry Group Financial Services Unlimited Co.<br>3,375 % éch. 05/03/2033        | 2 100                               | 2 424                     |
| Comunidad Autonoma de Canarias<br>3,500 % éch. 30/04/2036                    | 2 000                               | 2 321                 | Coöperatieve Rabobank UA<br>4,875 % éch. 01/11/2030                            | £ 1 600                             | 2 130                     |
| SR-Boligkredit A/S<br>2,750 % éch. 27/02/2033                                | 1 900                               | 2 240                 | Banque européenne d'investissement<br>2,500 % éch. 17/02/2031                  | € 1 600                             | 1 848                     |
| Orsted A/S<br>5,125 % éch. 13/09/2034                                        | £ 1 700                             | 2 137                 | Volkswagen Financial Services AG<br>3,875 % éch. 10/09/2030                    | 1 550                               | 1 802                     |
| Kingspan Securities Ireland DAC<br>3,500 % éch. 31/10/2031                   | € 1 700                             | 1 964                 | Lloyds Banking Group PLC<br>3,875 % éch. 14/05/2032                            | 1 300                               | 1 531                     |
| NTT Finance Corp.<br>3,325 % éch. 01/11/2029                                 | 1 600                               | 1 815                 | Schneider Electric SE<br>3,624 % éch. 02/09/2037                               | 1 200                               | 1 389                     |
| Lloyds Banking Group PLC<br>2,864 % éch. 12/02/2030                          | 1 500                               | 1 769                 | Bank of America Corp.<br>6,204 % éch. 10/11/2028                               | \$ 1 300                            | 1 335                     |
| Dhahrah Pw2 Energy Co. LLC<br>5,794 % éch. 30/06/2053                        | \$ 1 700                            | 1 700                 | ETSA Utilities Finance Pty. Ltd.<br>5,681 % éch. 27/03/2035                    | AUD 1 770                           | 1 238                     |
| Korea Ocean Business Corp.<br>4,279 % éch. 27/04/2029                        | 1 700                               | 1 700                 | Compass Group PLC<br>4,375 % éch. 08/09/2032                                   | £ 900                               | 1 146                     |
| CPI Property Group S.A.<br>6,875 % éch. 05/02/2033                           | £ 1 300                             | 1 696                 | Terna - Rete Elettrica Nazionale<br>3,000 % éch. 22/07/2031                    | € 1 000                             | 1 133                     |
| Stedin Holding NV<br>4,250 % éch. 21/10/2035                                 | € 1 400                             | 1 595                 | Symrise AG<br>3,250 % éch. 24/09/2032                                          | 1 000                               | 1 132                     |
| Clearway Energy Operating LLC<br>5,750 % éch. 15/01/2034                     | \$ 1 500                            | 1 500                 | Derwent London PLC<br>1,875 % éch. 17/11/2031                                  | £ 1 000                             | 1 093                     |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.<br>4,250 % éch. 03/05/2030               | € 1 200                             | 1 447                 | Verbund AG<br>3,250 % éch. 17/05/2031                                          | € 900                               | 1 040                     |
| Xylem, Inc.<br>5,450 % éch. 01/06/2036                                       | \$ 1 400                            | 1 400                 | Crédit Agricole S.A.<br>4,375 % éch. 27/11/2033                                | 800                                 | 966                       |
| Astrazeneca Finance LLC<br>4,900 % éch. 03/03/2030                           | 1 300                               | 1 334                 | Société Nationale SNCF S.A.<br>3,250 % éch. 02/09/2032                         | 800                                 | 956                       |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>4,195 % éch. 13/01/2029                            | 1 300                               | 1 300                 | Aptiv Swiss Holdings Ltd.<br>4,250 % éch. 11/06/2036                           | 800                                 | 953                       |
| ING Bank NV<br>3,625 % éch. 12/05/2033                                       | € 1 100                             | 1 282                 | Queensland Treasury Corp.<br>5,000 % éch. 10/03/2036                           | AUD 1 400                           | 948                       |
| Novonesis Novozymes<br>4,000 % éch. 19/03/2037                               | 1 100                               | 1 256                 | Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>3,250 % éch. 17/06/2033                       | € 800                               | 940                       |
| Nova Securitisation SARL<br>6,500 % éch. 03/02/2036                          | \$ 1 200                            | 1 189                 | Autoliv, Inc.<br>3,000 % éch. 29/10/2030                                       | 800                                 | 905                       |
| Treasury Corp. of Victoria<br>2,000 % éch. 17/09/2035                        | AUD 2 300                           | 1 184                 | Obligation internationale du gouvernement brésilien<br>5,500 % éch. 04/02/2033 | \$ 900                              | 886                       |
| IHO Verwaltungs GmbH<br>5,625 % éch. 15/05/2031                              | € 1 000                             | 1 177                 | TenneT Holding BV<br>4,500 % éch. 28/10/2034                                   | € 700                               | 855                       |
| SPIE S.A.<br>3,875 % éch. 18/05/2031                                         | 1 000                               | 1 172                 | Pandora A/S<br>3,875 % éch. 31/05/2030                                         | 700                                 | 830                       |
| Oesterreichische Kontrollbank AG<br>2,875 % éch. 29/04/2031                  | 1 000                               | 1 171                 | CPI Property Group S.A.<br>6,875 % éch. 05/02/2033                             | £ 650                               | 807                       |
| Obligation internationale du gouvernement chilien<br>3,875 % éch. 14/04/2036 | 1 000                               | 1 164                 | Électricité de France S.A.<br>4,750 % éch. 17/06/2044                          | € 700                               | 799                       |
| E.ON International Finance BV<br>4,053 % éch. 27/05/2036                     | 1 000                               | 1 162                 | Moody's Corp.<br>2,000 % éch. 19/08/2031                                       | \$ 900                              | 797                       |
| First Abu Dhabi Bank PJSC<br>3,530 % éch. 24/12/2029                         | 1 000                               | 1 149                 | Interstate Power & Light Co.<br>4,100 % éch. 26/09/2028                        | 800                                 | 796                       |
| Obligation du gouvernement australien<br>5,000 % éch. 21/06/2036             | AUD 1 600                           | 1 128                 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>2,800 % éch. 10/03/2027                     | 800                                 | 792                       |
| Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.<br>5,000 % éch. 24/06/2033    | \$ 1 100                            | 1 097                 | Alexandria Real Estate Equities, Inc.<br>2,000 % éch. 18/05/2032               | 900                                 | 755                       |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>4,050 % éch. 30/10/2037                 | € 900                               | 1 076                 | Vesteda Finance BV<br>4,000 % éch. 07/05/2032                                  | € 600                               | 724                       |
| Île-de-France Mobilités<br>4,200 % éch. 03/02/2046                           | 900                                 | 1 072                 | British Telecommunications PLC<br>3,875 % éch. 20/01/2034                      | 600                                 | 710                       |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.<br>3,500 % éch. 07/07/2033           | 900                                 | 1 021                 | KION Group AG<br>4,125 % éch. 24/03/2031                                       | 600                                 | 690                       |
|                                                                              |                                     |                       | CGI, Inc.<br>2,300 % éch. 14/09/2031                                           | \$ 800                              | 689                       |
|                                                                              |                                     |                       | CPI Property Group S.A.<br>4,750 % éch. 22/07/2030                             | € 600                               | 687                       |

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026 (suite)</b> |                                     |                           |
| Boston Properties LP                        |                                     |                           |
| 4,500 % éch. 01/12/2028                     | \$ 600                              | \$ 598                    |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Commodity Real Return Fund

| DESCRIPTION                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                     |                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,250 % éch. 15/04/2031 (a) | \$ 45 136                           | \$ 44 957             |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,250 % éch. 15/04/2028 (a) | 44 587                              | 44 645                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 2,125 % éch. 15/04/2029 (a) | 36 567                              | 37 615                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (a) | 40 282                              | 37 216                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033                          | € 29 868                            | 32 509                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/07/2028 (a) | \$ 31 254                           | 31 201                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,500 % éch. 15/02/2031                          | € 25 800                            | 30 805                |
| Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2028                                  | £ 17 541                            | 23 393                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2030 (a) | \$ 24 049                           | 22 947                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030                          | € 20 014                            | 22 808                |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 01/03/2029         | 19 068                              | 21 776                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/10/2030 (a) | \$ 20 448                           | 20 307                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/04/2030 (a) | 18 782                              | 18 958                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (a) | 17 669                              | 17 544                |
| Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 22/10/2031                                  | £ 12 800                            | 17 362                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (a) | \$ 16 119                           | 16 021                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2031 (a) | 15 817                              | 14 990                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 2,375 % éch. 15/10/2028 (a) | 14 232                              | 14 726                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/07/2029 (a) | 11 423                              | 11 157                |
| Freddie Mac 4,628 % éch. 25/03/2055                                                | 10 800                              | 10 798                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,800 % éch. 15/05/2036                          | € 8 752                             | 10 445                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (a) | \$ 9 963                            | 9 956                 |
| Freddie Mac 4,778 % éch. 25/04/2055                                                | 7 428                               | 7 455                 |
| Freddie Mac 4,578 % éch. 25/06/2056                                                | 7 200                               | 7 198                 |
| Bain Capital Euro CLO DAC 3,449 % éch. 15/01/2037                                  | € 6 000                             | 7 025                 |
| Freddie Mac 5,128 % éch. 25/07/2055                                                | \$ 6 900                            | 6 898                 |
| Fannie Mae 4,728 % éch. 25/07/2055                                                 | 6 540                               | 6 573                 |

| DESCRIPTION                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                          |                                     |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,250 % éch. 15/04/2028 (a)           | \$ 27 147                           | \$ 26 991                 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (a)           | 26 866                              | 26 736                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,250 % éch. 15/04/2031 (a)           | 17 323                              | 17 038                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,875 % éch. 15/07/2035 (a)           | 12 575                              | 12 322                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/04/2030 (a)           | 6 654                               | 6 622                     |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/02/2036                                          | 5 620                               | 5 516                     |
| Ginnie Mae 3,500 % éch. 20/07/2055                                                           | 5 403                               | 5 013                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (a)           | 4 895                               | 4 448                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/07/2029 (a)           | 2 789                               | 2 718                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 2,375 % éch. 15/02/2056 (a)           | 2 855                               | 2 650                     |
| RD Michigan Property Owner LLC 7,500 % éch. 30/03/2045                                       | 1 100                               | 1 101                     |
| Ginnie Mae 3,500 % éch. 20/06/2052                                                           | 1 002                               | 915                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2026 (a)           | 285                                 | 284                       |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029                   | PEN 400                             | 124                       |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,398 % éch. 25/10/2034 | \$ 99                               | 97                        |
| IndyMac Mortgage Loan Trust 5,093 % éch. 25/07/2045                                          | 2                                   | 2                         |

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                            |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,400 % éch. 20/03/2055  | ¥ 1 720 000                         | \$ 8 945              |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029  | MXN 121 000                         | 7 117                 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>5,000 % éch. 25/10/2035  | PLN 15 600                          | 4 165                 |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 31/07/2054                           | £ 3 300                             | 3 757                 |
| CI Financial Corp.<br>4,625 % éch. 12/12/2031                                  | € 3 000                             | 3 569                 |
| Rocket Cos., Inc.<br>6,375 % éch. 01/08/2033                                   | \$ 3 300                            | 3 367                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                         | 3 370                               | 3 336                 |
| Jubilee Place BV<br>2,900 % éch. 17/10/2061                                    | € 2 800                             | 3 303                 |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                    | \$ 3 300                            | 3 288                 |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                      | 3 300                               | 3 126                 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,125 % éch. 01/06/2031          | € 2 600                             | 3 010                 |
| Banco Santander S.A.<br>4,867 % éch. 15/04/2031                                | \$ 3 000                            | 2 988                 |
| UBS Group AG<br>7,000 % éch. 10/02/2030                                        | 2 900                               | 2 965                 |
| Universal Music Group NV<br>3,750 % éch. 30/06/2032                            | € 2 300                             | 2 726                 |
| Grupo Nutresa S.A.<br>9,000 % éch. 12/05/2035                                  | \$ 2 400                            | 2 723                 |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd.<br>5,049 % éch. 28/01/2031                           | 2 700                               | 2 700                 |
| Public Service Co. of Colorado<br>5,050 % éch. 15/06/2036                      | 2 600                               | 2 594                 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>3,200 % éch. 20/09/2055  | ¥ 463 900                           | 2 589                 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien<br>4,500 % éch. 13/01/2031 | \$ 2 600                            | 2 588                 |
| Motion Finco SARL<br>7,375 % éch. 15/06/2030                                   | € 2 400                             | 2 581                 |

| DESCRIPTION                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                               |                                     |                           |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 07/03/2030                              | £ 9 000                             | \$ 12 164                 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,400 % éch. 20/03/2055     | ¥ 1 730 000                         | 8 732                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029     | MXN 121 000                         | 6 959                     |
| Obligations du Trésor américain<br>2,875 % éch. 15/05/2049                        | \$ 8 800                            | 6 315                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,375 % éch. 31/12/2029                            | 4 500                               | 4 590                     |
| Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 30/04/2030                            | 4 200                               | 4 210                     |
| Billets du Trésor américain<br>3,625 % éch. 31/10/2030                            | 4 100                               | 4 061                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 28/02/2030     | MXN 65 000                          | 3 815                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                            | \$ 3 370                            | 3 308                     |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 31/07/2054                              | £ 2 800                             | 3 018                     |
| Banco Santander S.A.<br>4,867 % éch. 15/04/2031                                   | \$ 3 000                            | 2 981                     |
| UBS Group AG<br>7,000 % éch. 10/02/2030                                           | 2 900                               | 2 951                     |
| ZF North America Capital, Inc.<br>7,500 % éch. 24/03/2031                         | 2 900                               | 2 908                     |
| Universal Music Group NV<br>3,750 % éch. 30/06/2032                               | € 2 300                             | 2 740                     |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd.<br>5,049 % éch. 28/01/2031                              | \$ 2 700                            | 2 676                     |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,250 % éch. 31/03/2032 | ZAR 43 500                          | 2 639                     |
| Obligation internationale du gouvernement israélien<br>4,500 % éch. 13/01/2031    | \$ 2 600                            | 2 598                     |
| Public Service Co. of Colorado<br>5,050 % éch. 15/06/2036                         | 2 600                               | 2 549                     |
| Las Vegas Sands Corp.<br>6,000 % éch. 14/06/2030                                  | 2 300                               | 2 375                     |
| P3 Group SARL<br>3,375 % éch. 22/03/2031                                          | € 2 000                             | 2 261                     |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Diversified Income Fund

| DESCRIPTION                                                                       | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                               |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)   | 145 057 173                         | \$ 1 446 612          |
|                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                            | \$ 80 540                           | 79 446                |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                         | 77 700                              | 73 601                |
| Petroleos Mexicanos<br>6,750 % éch. 21/09/2047                                    | 57 725                              | 47 696                |
| Triton Bond Trust<br>5,250 % éch. 15/02/2058                                      | AUD 60 000                          | 42 507                |
| Valerie Asset Ltd.<br>5,219 % éch. 15/09/2050                                     | \$ 42 730                           | 41 749                |
| AFG Trust<br>5,262 % éch. 10/10/2057                                              | AUD 58 500                          | 41 728                |
| Émirat d'Abu Dhabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033                                     | \$ 38 500                           | 38 257                |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust<br>5,300 % éch. 15/08/2057               | AUD 53 825                          | 37 416                |
| Discovery Global Holdings, Inc.<br>6,144 % éch. 03/06/2033                        | \$ 36 900                           | 36 808                |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,500 % éch. 31/01/2037 | ZAR 612 700                         | 36 544                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,804 % éch. 20/04/2033    | \$ 34 000                           | 34 000                |
| Fulvia Spv SRL<br>3,013 % éch. 24/12/2042                                         | € 29 300                            | 33 935                |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>4,125 % éch. 12/01/2029     | \$ 33 800                           | 33 757                |
| Sapphire Trust Central Finance<br>5,299 % éch. 12/12/2067                         | AUD 44 500                          | 31 635                |
| Domi BV<br>2,892 % éch. 15/02/2057                                                | € 25 000                            | 29 741                |
| Sapphire Trust Central Finance<br>5,501 % éch. 12/03/2068                         | AUD 41 000                          | 29 333                |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,750 % éch. 16/09/2030      | \$ 28 200                           | 29 229                |
| Liberty Trust<br>5,312 % éch. 10/10/2058                                          | AUD 40 000                          | 28 436                |
| OCP Euro CLO DAC<br>3,156 % éch. 20/04/2035                                       | € 22 500                            | 26 623                |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 138 540 778                         | \$ 1 381 600              |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)                   | 971 694                             | 97 714                    |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | \$ 80 540                           | 79 055                    |
| Petroleos Mexicanos<br>6,625 % éch. 15/06/2035                                  | 72 500                              | 69 089                    |
| Obligations du Trésor américain<br>4,000 % éch. 15/11/2042                      | 75 500                              | 68 547                    |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                       | 54 875                              | 54 906                    |
| Obligations du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/08/2044                      | 59 000                              | 52 094                    |
|                                                                                 | ACTIONS                             |                           |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (a)         | 4 889 829                           | 50 170                    |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Union européenne<br>3,000 % éch. 04/12/2034                                     | € 41 710                            | 47 271                    |
| Obligation internationale du gouvernement chilien<br>4,850 % éch. 22/01/2029    | \$ 33 000                           | 33 482                    |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,750 % éch. 16/09/2030    | 28 200                              | 28 273                    |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>5,125 % éch. 13/01/2028   | 24 000                              | 24 276                    |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>4,875 % éch. 12/02/2030   | 22 725                              | 23 209                    |
| Bacardi Ltd.<br>4,700 % éch. 15/05/2028                                         | 21 840                              | 21 820                    |
| Venture Global LNG, Inc.<br>8,375 % éch. 01/06/2031                             | 20 300                              | 21 097                    |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois<br>4,000 % éch. 25/07/2029   | € 17 675                            | 21 012                    |
| Nexi SpA<br>2,125 % éch. 30/04/2029                                             | 18 100                              | 20 626                    |
| Charter Communications Operating LLC<br>3,850 % éch. 01/04/2061                 | \$ 32 900                           | 19 243                    |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/05/2044                      | 19 900                              | 19 163                    |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>6,625 % éch. 27/09/2029    | € 14 500                            | 19 055                    |

(a) Le Fonds Diversified Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

| DESCRIPTION                                                                       | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                               |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)   | 8 788 632                           | \$ 87 647             |
|                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                            | \$ 3 170                            | 3 127                 |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                         | 3 100                               | 2 936                 |
| Invesco U.S. CLO Ltd.<br>4,831 % éch. 20/07/2037                                  | 2 700                               | 2 700                 |
| Castlelake Aircraft Structured Trust<br>5,073 % éch. 15/03/2051                   | 2 000                               | 2 000                 |
| Blackrock DLF CLO LLC<br>5,253 % éch. 25/07/2034                                  | 1 900                               | 1 900                 |
| Resimac Bastille Trust<br>5,158 % éch. 09/12/2057                                 | AUD 2 500                           | 1 807                 |
| Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC<br>3,414 % éch. 15/07/2039            | € 1 400                             | 1 618                 |
| Gaci First Investment Co.<br>4,875 % éch. 14/05/2029                              | \$ 1 600                            | 1 599                 |
| Discovery Global Holdings, Inc.<br>6,144 % éch. 03/06/2033                        | 1 600                               | 1 596                 |
| BBVA Consumer Auto<br>2,819 % éch. 25/02/2042                                     | € 1 300                             | 1 531                 |
| Émirat d'Abu Dhabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033                                     | \$ 1 500                            | 1 491                 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>9,000 % éch. 31/01/2040 | ZAR 26 400                          | 1 454                 |
| Sapphire Trust Central Finance<br>5,501 % éch. 12/03/2068                         | AUD 2 000                           | 1 431                 |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,804 % éch. 20/04/2033    | \$ 1 400                            | 1 400                 |
| Invesco Commercial Real Estate Finance Trust LLC<br>5,050 % éch. 19/01/2044       | 1 400                               | 1 400                 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>4,125 % éch. 12/01/2029     | 1 400                               | 1 398                 |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust<br>5,300 % éch. 15/08/2057               | AUD 2 000                           | 1 390                 |
| Curzon Mortgages PLC<br>4,592 % éch. 28/07/2049                                   | £ 1 000                             | 1 359                 |
| Hawksmoor Mortgage Funding PLC<br>4,587 % éch. 25/02/2057                         | 1 000                               | 1 338                 |

| DESCRIPTION                                                                                  | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                          |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)              | 10 398 150                          | \$ 103 700                |
|                                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                       | \$ 3 170                            | 3 112                     |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                                    | 2 025                               | 2 027                     |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,875 % éch. 28/02/2035            | ZAR 27 900                          | 1 602                     |
| FTA Santander Consumer Spain Auto<br>3,689 % éch. 22/09/2039                                 | € 1 059                             | 1 236                     |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen<br>6,853 % éch. 28/03/2054                | \$ 850                              | 905                       |
| Occidental Petroleum Corp.<br>7,875 % éch. 15/09/2031                                        | 750                                 | 856                       |
| Medline Borrower LP<br>3,875 % éch. 01/04/2029                                               | 850                                 | 836                       |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>4,125 % éch. 12/01/2029                | 800                                 | 790                       |
| Charter Communications Operating LLC<br>3,850 % éch. 01/04/2061                              | 1 225                               | 717                       |
| Nexi SpA<br>2,125 % éch. 30/04/2029                                                          | € 625                               | 711                       |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abu Dhabi<br>4,875 % éch. 30/04/2029 | \$ 700                              | 710                       |
| Morgan Stanley<br>5,250 % éch. 21/04/2034                                                    | 700                                 | 706                       |
| NGPL PipeCo LLC<br>7,768 % éch. 15/12/2037                                                   | 600                                 | 697                       |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU<br>3,375 % éch. 21/04/2029                       | € 600                               | 695                       |
| Électricité de France S.A.<br>9,125 % éch. 15/03/2033                                        | \$ 575                              | 665                       |
| WMG Acquisition Corp.<br>3,000 % éch. 15/02/2031                                             | 675                                 | 628                       |
| FORESEA Holding S.A.<br>7,500 % éch. 15/06/2030                                              | 636                                 | 625                       |
| Itau Unibanco Holding S.A.<br>6,000 % éch. 27/02/2030                                        | 600                                 | 620                       |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abu Dhabi<br>5,000 % éch. 30/04/2034 | 600                                 | 612                       |

(a) Le Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Diversified Income ESG Fund

| DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                              |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                            |                                     |                           |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                            | € 500                               | \$ 586                | First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                          | € 500                               | \$ 582                    |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                           | \$ 405                              | 399                   | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO ESG<br>Income Fund (a)  | ACTIONS                             |                           |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                        | 375                                 | 375                   |                                                                                | 34 773                              | 386                       |
| Plenti PL & Green ABS Trust<br>5,276 % éch. 11/07/2037                           | AUD 500                             | 355                   |                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                        | \$ 375                              | 355                   | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                      | \$ 375                              | 375                       |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust<br>5,300 % éch. 15/08/2057              | AUD 500                             | 348                   | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                         | 380                                 | 373                       |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain<br>5,950 % éch. 27/04/2033 | € 250                               | 299                   | National Grid PLC<br>3,875 % éch. 16/01/2029                                   | € 300                               | 357                       |
| ZF Europe Finance BV<br>5,500 % éch. 17/02/2032                                  | 200                                 | 238                   | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                      | \$ 300                              | 301                       |
| GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos S.A.<br>3,158 % éch. 23/12/2036     | 200                                 | 233                   | IQVIA, Inc.<br>2,250 % éch. 15/01/2028                                         | € 250                               | 291                       |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,804 % éch. 20/04/2033   | \$ 200                              | 200                   | Obligation internationale du gouvernement philippin<br>5,500 % éch. 17/01/2048 | \$ 250                              | 242                       |
| Dhafrah Pv2 Energy Co. LLC<br>5,794 % éch. 30/06/2053                            | 200                                 | 200                   | Chobani LLC<br>4,625 % éch. 15/11/2028                                         | 225                                 | 223                       |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni<br>7,125 % éch. 10/06/2036    | 200                                 | 200                   | Barclays PLC<br>7,437 % éch. 02/11/2033                                        | 200                                 | 222                       |
| Ford Motor Credit Co. LLC<br>4,970 % éch. 06/04/2029                             | 200                                 | 200                   | Logicor Financing SARL<br>1,625 % éch. 17/01/2030                              | € 200                               | 215                       |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>5,375 % éch. 14/04/2036    | 200                                 | 200                   | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>7,500 % éch. 02/02/2034 | \$ 200                              | 214                       |
| Discovery Global Holdings, Inc.<br>6,144 % éch. 03/06/2033                       | 175                                 | 175                   | Smurfit Kappa Treasury ULC<br>5,200 % éch. 15/01/2030                          | 200                                 | 207                       |
| VZ Secured Financing BV<br>5,000 % éch. 15/01/2032                               | 150                                 | 135                   | Obligation internationale du gouvernement brésilien<br>6,250 % éch. 18/03/2031 | 200                                 | 207                       |
| SW Finance PLC<br>6,875 % éch. 14/11/2034                                        | £ 100                               | 135                   | Sabesp Lux SARL<br>5,625 % éch. 20/08/2030                                     | 200                                 | 200                       |
| Nidda Healthcare Holding GmbH<br>5,625 % éch. 21/02/2030                         | € 100                               | 123                   | TerraForm Power Operating LLC<br>5,000 % éch. 31/01/2028                       | 200                                 | 199                       |
| Mahle GmbH<br>7,125 % éch. 15/07/2032                                            | 100                                 | 121                   | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>4,875 % éch. 19/05/2033  | 200                                 | 191                       |
| Fastighets AB Balder<br>3,625 % éch. 25/08/2031                                  | 100                                 | 119                   | Avantor Funding, Inc.<br>3,875 % éch. 01/11/2029                               | 200                                 | 189                       |
| Flora Food Management BV<br>7,500 % éch. 31/10/2030                              | 100                                 | 117                   | JPMorgan Chase & Co.<br>2,580 % éch. 22/04/2032                                | 200                                 | 180                       |
| ARGAN S.A.<br>3,779 % éch. 30/10/2029                                            | 100                                 | 117                   | AT&T, Inc.<br>4,300 % éch. 15/02/2030                                          | 175                                 | 176                       |
| Informa PLC<br>3,750 % éch. 29/04/2032                                           | 100                                 | 116                   | Quanta Services, Inc.<br>2,350 % éch. 15/01/2032                               | 200                                 | 176                       |
| Froneri Lux FinCo SARL<br>4,750 % éch. 01/08/2032                                | 100                                 | 116                   | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.<br>1,350 % éch. 15/03/2031  | 200                                 | 171                       |
| Public Property Invest A/S<br>3,250 % éch. 21/04/2029                            | 100                                 | 116                   | Wabtec Transportation Netherlands BV<br>1,250 % éch. 03/12/2027                | € 150                               | 169                       |
| Latvenergo A/S<br>4,162 % éch. 25/06/2033                                        | 100                                 | 116                   | Obligation internationale du gouvernement panaméen<br>6,700 % éch. 26/01/2036  | \$ 150                              | 161                       |
| Molins Finance S.A.<br>5,500 % éch. 15/06/2033                                   | 100                                 | 116                   | Seagate Data Storage Technology Pte. Ltd.<br>5,750 % éch. 01/12/2034           | 150                                 | 153                       |
| Volkswagen Bank GmbH<br>3,625 % éch. 26/11/2028                                  | 100                                 | 116                   | HCA, Inc.<br>4,125 % éch. 15/06/2029                                           | 150                                 | 150                       |
| Sagax AB<br>3,375 % éch. 26/01/2031                                              | 100                                 | 115                   | Obligation internationale du gouvernement hongrois<br>4,000 % éch. 25/07/2029  | € 125                               | 149                       |
| CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF<br>3,875 % éch. 28/05/2031       | 100                                 | 115                   | Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>3,625 % éch. 15/02/2032                 | \$ 150                              | 138                       |
| Cellnex Finance Co. S.A.<br>3,000 % éch. 19/01/2031                              | 100                                 | 115                   | Ball Corp.<br>2,875 % éch. 15/08/2030                                          | 150                                 | 136                       |
| ams-OSRAM AG<br>7,250 % éch. 31/05/2032                                          | 100                                 | 115                   | LSEGA Financing PLC<br>4,500 % éch. 19/10/2028                                 | £ 100                               | 136                       |
| Anglian Water Services Financing PLC<br>4,250 % éch. 23/06/2036                  | 100                                 | 114                   | ams-OSRAM AG<br>10,500 % éch. 30/03/2029                                       | € 100                               | 126                       |
| Wabtec Transportation Netherlands BV<br>1,250 % éch. 03/12/2027                  | 100                                 | 113                   | American Tower Corp.<br>2,950 % éch. 15/01/2051                                | \$ 200                              | 124                       |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,750 % éch. 16/09/2030     | \$ 100                              | 104                   | British Telecommunications PLC<br>3,875 % éch. 20/01/2034                      | € 100                               | 118                       |
| Nexstar Media, Inc.<br>6,500 % éch. 15/09/2033                                   | 100                                 | 100                   | New Immo Holding S.A.<br>4,950 % éch. 14/11/2030                               | 100                                 | 118                       |
| VOC Escrow Ltd.<br>5,000 % éch. 15/02/2028                                       | 100                                 | 100                   | Charter Communications Operating LLC<br>3,950 % éch. 30/06/2062                | \$ 200                              | 118                       |
| WMG Acquisition Corp.<br>3,750 % éch. 01/12/2029                                 | 100                                 | 96                    | CaixaBank S.A.<br>3,750 % éch. 07/09/2029                                      | € 100                               | 116                       |

| DESCRIPTION                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026 (suite)</b> |                                     |                           |
| Sandoz Finance BV                           |                                     |                           |
| 3,250 % éch. 12/09/2029                     | € 100                               | \$ 116                    |
| SCF Rahoituspalvelut DAC                    |                                     |                           |
| 3,381 % éch. 25/06/2034                     | 99                                  | 115                       |
| Nexi SpA                                    |                                     |                           |
| 2,125 % éch. 30/04/2029                     | 100                                 | 114                       |
| SSE PLC                                     |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 18/03/2032                     | 100                                 | 113                       |
| Norsk Hydro ASA                             |                                     |                           |
| 3,625 % éch. 23/01/2032                     | 100                                 | 113                       |
| Smiths Group PLC                            |                                     |                           |
| 3,625 % éch. 13/11/2033                     | 100                                 | 112                       |
| Fastighets AB Balder                        |                                     |                           |
| 3,625 % éch. 25/08/2031                     | 100                                 | 112                       |

(a) Le Fonds Diversified Income ESG Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

| DESCRIPTION                                                                       | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                               |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)   | 49 791 302                          | \$ 496 579            | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 49 533 828                          | \$ 494 000                |
|                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                            | \$ 69 600                           | 68 923                | Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/11/2034                          | \$ 74 900                           | 75 327                    |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                         | 67 700                              | 64 129                | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | 69 190                              | 67 914                    |
|                                                                                   | ACTIONS                             |                       | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | COP 121 851 000                     | 34 469                    |
| Apple, Inc.                                                                       | 200 000                             | 59 126                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 121 851 000                         | 32 263                    |
| NVIDIA Corp.                                                                      | 286 000                             | 58 593                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 121 851 000                         | 31 671                    |
| Booking Holdings, Inc.                                                            | 356 000                             | 58 238                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 121 851 000                         | 30 873                    |
| MercadoLibre, Inc.                                                                | 35 700                              | 57 477                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 121 851 000                         | 29 959                    |
|                                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 121 851 000                         | 29 256                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | COP 121 851 000                     | 34 415                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 121 851 000                         | 28 342                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | 121 851 000                         | 32 354                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 108 685 000                         | 26 774                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | 121 851 000                         | 30 922                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/08/2030  | 108 685 000                         | 24 822                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | 121 851 000                         | 30 695                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 108 685 000                         | 24 738                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | 121 851 000                         | 30 281                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 108 685 000                         | 24 334                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | 121 851 000                         | 30 214                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 108 685 000                         | 23 653                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035    | 121 851 000                         | 29 670                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 108 685 000                         | 23 058                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030    | 108 685 000                         | 26 737                | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 108 685 000                         | 22 744                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030    | 108 685 000                         | 24 943                | Obligation internationale du gouvernement turc<br>7,625 % éch. 15/05/2034       | \$ 8 300                            | 8 601                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/08/2030    | 108 685 000                         | 24 706                | Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,200 % éch. 20/03/2064   | ¥ 2 017 000                         | 8 479                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030    | 108 685 000                         | 24 481                | ZF Europe Finance BV<br>7,000 % éch. 12/06/2030                                 | € 5 000                             | 6 335                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030    | 108 685 000                         | 23 874                |                                                                                 |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030    | 108 685 000                         | 23 714                |                                                                                 |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030    | 108 685 000                         | 23 422                |                                                                                 |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,875 % éch. 28/02/2035 | ZAR 312 900                         | 18 990                |                                                                                 |                                     |                           |

(a) Le Fonds Dynamic Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Emerging Local Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                                | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                        |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)            | 215 522 239 \$                      | 2 149 399             |
|                                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>3,900 % éch. 30/11/2026             | MYR 1 298 957                       | 332 729               |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>4,070 % éch. 30/09/2026             | 864 411                             | 220 641               |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>3,844 % éch. 15/04/2033             | 669 950                             | 171 875               |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,726 % éch. 31/03/2026             | 620 684                             | 157 932               |
| Banque de développement chinoise<br>2,630 % éch. 08/01/2034                                | CNY 1 000 250                       | 151 919               |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>4,500 % éch. 25/07/2030              | PLN 535 600                         | 149 016               |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 31/05/2029              | MXN 2 068 300                       | 119 897               |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029              | 1 895 500                           | 110 035               |
| Obligation internationale du gouvernement indien<br>6,940 % éch. 11/05/2036                | INR 9 598 610                       | 102 944               |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>5,000 % éch. 25/10/2035              | PLN 379 100                         | 100 815               |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,000 % éch. 15/04/2032              | MXN 1 787 600                       | 97 467                |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>5,875 % éch. 15/03/2031            | IDR 1 605 613 000                   | 91 043                |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>2,700 % éch. 17/06/2040           | THB 2 842 320                       | 90 632                |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque<br>4,250 % éch. 24/10/2034 | CZK 1 814 900                       | 86 987                |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque<br>4,900 % éch. 14/04/2034 | 1 569 600                           | 77 834                |
| Banque de développement chinoise<br>1,870 % éch. 05/09/2035                                | CNY 527 870                         | 75 960                |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                                  | COP 311 688 600                     | 75 300                |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 28/02/2030              | MXN 1 229 500                       | 70 221                |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,612 % éch. 30/04/2035             | MYR 256 370                         | 65 263                |

| DESCRIPTION                                                                                    | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                            |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                | 242 756 836 \$                      | 2 420 924                 |
|                                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029                  | MXN 6 945 000                       | 405 163                   |
| Obligation internationale du gouvernement philippin<br>6,250 % éch. 28/02/2029                 | PHP 21 384 210                      | 361 912                   |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>3,900 % éch. 30/11/2026                 | MYR 1 298 957                       | 326 441                   |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>4,070 % éch. 30/09/2026                 | 864 411                             | 217 817                   |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,726 % éch. 31/03/2026                 | 581 414                             | 149 428                   |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,150 % éch. 12/08/2032                  | PEN 350 900                         | 107 930                   |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>6,750 % éch. 15/07/2035                | IDR 1 716 269 000                   | 101 958                   |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 31/05/2029                  | MXN 1 758 800                       | 100 930                   |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque<br>4,900 % éch. 14/04/2034     | CZK 1 867 200                       | 93 148                    |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>2,980 % éch. 17/06/2045               | THB 2 811 530                       | 86 472                    |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,000 % éch. 31/01/2030              | ZAR 1 306 752                       | 80 362                    |
| <b>ACTIONS</b>                                                                                 |                                     |                           |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (d) | 5 203 833                           | 78 346                    |
|                                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>6,500 % éch. 15/07/2030                | IDR 1 226 584 000                   | 75 560                    |
| TES colombien<br>11,000 % éch. 22/08/2029                                                      | COP 289 107 000                     | 74 969                    |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,612 % éch. 30/04/2035                 | MYR 296 230                         | 74 594                    |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>4,254 % éch. 31/05/2035                 | 280 990                             | 74 262                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,000 % éch. 15/04/2032                  | MXN 1 245 000                       | 69 324                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 28/02/2030                  | 993 500                             | 57 446                    |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>5,875 % éch. 15/03/2031                | IDR 878 892 000                     | 50 830                    |

(a) Le Fonds Emerging Local Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                                                     |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                             |     |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien            |     |                                     |                       |
| 5,875 % éch. 15/03/2031                                         | IDR | 176 797 000                         | \$ 10 184             |
| Obligation internationale du gouvernement polonais              |     |                                     |                       |
| 5,750 % éch. 25/04/2029                                         | PLN | 31 800                              | 8 922                 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien             |     |                                     |                       |
| 3,900 % éch. 30/11/2026                                         | MYR | 32 269                              | 8 182                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain              |     |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 31/05/2029                                         | MXN | 115 400                             | 6 584                 |
| TES colombien                                                   |     |                                     |                       |
| 7,000 % éch. 26/03/2031                                         | COP | 30 042 700                          | 6 474                 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien              |     |                                     |                       |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                         | PEN | 18 550                              | 6 196                 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien            |     |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 15/07/2030                                         | IDR | 102 787 000                         | 5 953                 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain          |     |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                         | ZAR | 94 800                              | 5 870                 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien             |     |                                     |                       |
| 4,070 % éch. 30/09/2026                                         | MYR | 22 290                              | 5 689                 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien             |     |                                     |                       |
| 3,844 % éch. 15/04/2033                                         |     | 21 660                              | 5 553                 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais           |     |                                     |                       |
| 2,700 % éch. 17/06/2040                                         | THB | 171 090                             | 5 439                 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien             |     |                                     |                       |
| 4,662 % éch. 31/03/2038                                         | MYR | 16 750                              | 4 609                 |
| Obligation internationale du gouvernement indien                |     |                                     |                       |
| 6,940 % éch. 11/05/2036                                         | INR | 426 590                             | 4 575                 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais              |     |                                     |                       |
| 5,000 % éch. 25/10/2035                                         | PLN | 15 900                              | 4 187                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain              |     |                                     |                       |
| 8,000 % éch. 24/05/2035                                         | MXN | 76 000                              | 4 115                 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien             |     |                                     |                       |
| 3,726 % éch. 31/03/2026                                         | MYR | 16 015                              | 4 075                 |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque |     |                                     |                       |
| 4,550 % éch. 03/10/2035                                         | CZK | 71 400                              | 3 508                 |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque |     |                                     |                       |
| 4,900 % éch. 14/04/2034                                         |     | 49 200                              | 2 439                 |
| Banque européenne d'investissement                              |     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 25/07/2030                                         | PLN | 8 600                               | 2 421                 |
| TES colombien                                                   |     |                                     |                       |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                        | COP | 9 651 000                           | 2 351                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain              |     |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 28/02/2030                                         | MXN | 34 900                              | 1 994                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain              |     |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 01/03/2029                                         |     | 34 300                              | 1 976                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain              |     |                                     |                       |
| 8,000 % éch. 15/04/2032                                         |     | 35 400                              | 1 961                 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos                  |     |                                     |                       |
| 4,700 % éch. 01/09/2030                                         | CLP | 1 645 000                           | 1 829                 |

| DESCRIPTION                                                         |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                 |     |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement philippin                 |     |                                     |                           |
| 6,250 % éch. 28/02/2029                                             | PHP | 593 930                             | \$ 10 012                 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien                 |     |                                     |                           |
| 3,900 % éch. 30/11/2026                                             | MYR | 32 269                              | 8 004                     |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien                 |     |                                     |                           |
| 4,070 % éch. 30/09/2026                                             |     | 22 290                              | 5 645                     |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien                |     |                                     |                           |
| 5,875 % éch. 15/03/2031                                             | IDR | 83 077 000                          | 4 594                     |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien                 |     |                                     |                           |
| 3,726 % éch. 31/03/2026                                             | MYR | 15 002                              | 3 856                     |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien                 |     |                                     |                           |
| 4,662 % éch. 31/03/2038                                             |     | 13 910                              | 3 607                     |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien                |     |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 15/07/2030                                             | IDR | 57 793 000                          | 3 544                     |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain              |     |                                     |                           |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                             | ZAR | 53 600                              | 3 300                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais               |     |                                     |                           |
| 1,585 % éch. 17/12/2035                                             | THB | 78 086                              | 2 364                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 28/02/2030                                             | MXN | 40 000                              | 2 324                     |
| Obligation internationale du gouvernement polonais                  |     |                                     |                           |
| 2,750 % éch. 25/10/2029                                             | PLN | 8 500                               | 2 254                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 31/05/2029                                             | MXN | 35 700                              | 2 064                     |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque     |     |                                     |                           |
| 4,900 % éch. 14/04/2034                                             | CZK | 38 300                              | 1 910                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 02/03/2028                                             | MXN | 33 100                              | 1 871                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais               |     |                                     |                           |
| 3,390 % éch. 17/06/2037                                             | THB | 54 879                              | 1 842                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais               |     |                                     |                           |
| 2,700 % éch. 17/06/2040                                             |     | 47 230                              | 1 576                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais               |     |                                     |                           |
| 3,450 % éch. 17/06/2043                                             |     | 48 590                              | 1 561                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 7,750 % éch. 13/11/2042                                             | MXN | 31 100                              | 1 531                     |
| TES colombien                                                       |     |                                     |                           |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                                            | COP | 5 448 100                           | 1 526                     |
| Beignet Investor LLC                                                |     |                                     |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049                                             | \$  | 1 440                               | 1 487                     |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien                |     |                                     |                           |
| 6,750 % éch. 15/07/2035                                             | IDR | 24 402 000                          | 1 409                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 8,000 % éch. 24/05/2035                                             | MXN | 26 000                              | 1 401                     |
| TES colombien                                                       |     |                                     |                           |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                            | COP | 5 234 600                           | 1 362                     |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine |     |                                     |                           |
| 10,500 % éch. 15/03/2037                                            | DOP | 80 000                              | 1 356                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 8,000 % éch. 07/11/2047                                             | MXN | 26 200                              | 1 303                     |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                  |     |                                     |                           |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                             | PEN | 3 900                               | 1 236                     |
| Obligation internationale du gouvernement roumain                   |     |                                     |                           |
| 4,250 % éch. 28/04/2036                                             | RON | 6 100                               | 1 108                     |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain              |     |                                     |                           |
| 7,000 % éch. 28/02/2031                                             | ZAR | 18 600                              | 1 097                     |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos                      |     |                                     |                           |
| 4,700 % éch. 01/09/2030                                             | CLP | 975 000                             | 1 076                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                  |     |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 01/03/2029                                             | MXN | 18 700                              | 1 069                     |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Emerging Markets Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 167 550 686 \$                      | 1 670 987             |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                          |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                                         | ZAR 853 000                         | 50 626                |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                              |                                     |                       |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                                                         | PEN 152 870                         | 47 029                |
| Obligation internationale congolaise                                            |                                     |                       |
| 9,500 % éch. 26/05/2036                                                         | \$ 40 500                           | 39 433                |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                                |                                     |                       |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                                         | 36 200                              | 35 498                |
| Obligation internationale du gouvernement argentin                              |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 09/07/2035                                                         | 46 500                              | 34 725                |
| Luminis S.A.                                                                    |                                     |                       |
| 9,649 % éch. 15/09/2038                                                         | 25 900                              | 30 574                |
| Sonangol Finance Ltd.                                                           |                                     |                       |
| 10,000 % éch. 29/01/2031                                                        | 31 000                              | 29 663                |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                                       |                                     |                       |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                                                         | 29 600                              | 29 304                |
| Petroleos Mexicanos                                                             |                                     |                       |
| 7,690 % éch. 23/01/2050                                                         | 31 800                              | 28 662                |
| Obligation internationale du gouvernement angolais                              |                                     |                       |
| 9,875 % éch. 31/03/2037                                                         | 27 700                              | 28 171                |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                             |                                     |                       |
| 6,125 % éch. 21/01/2031                                                         | 27 600                              | 27 423                |
| Banco Nacional de Mexico S.A.                                                   |                                     |                       |
| 6,697 % éch. 07/08/2036                                                         | 26 200                              | 26 200                |
| Obligation internationale du gouvernement chilien                               |                                     |                       |
| 4,350 % éch. 13/04/2031                                                         | 25 800                              | 25 775                |
| Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC                                                      |                                     |                       |
| 5,794 % éch. 30/06/2053                                                         | 25 600                              | 25 600                |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni                              |                                     |                       |
| 7,125 % éch. 10/06/2036                                                         | 25 200                              | 25 200                |
| Gaci First Investment Co.                                                       |                                     |                       |
| 6,250 % éch. 14/05/2056                                                         | 25 300                              | 25 019                |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                             |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 21/01/2033                                                         | 24 900                              | 24 643                |
| QNB Finance Ltd.                                                                |                                     |                       |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                                                         | 24 400                              | 24 217                |
| Emirates NBD Bank PJSC                                                          |                                     |                       |
| 5,125 % éch. 29/06/2031                                                         | 24 400                              | 24 143                |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 208 649 363 \$                      | 2 080 859                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                          |                                     |                           |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                                         | ZAR 649 500                         | 40 553                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 3,750 % éch. 11/01/2028                                                         | \$ 38 500                           | 38 014                    |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine             |                                     |                           |
| 5,950 % éch. 25/01/2027                                                         | 27 700                              | 27 859                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                             |                                     |                           |
| 6,125 % éch. 21/01/2031                                                         | 27 600                              | 27 498                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien                             |                                     |                           |
| 3,250 % éch. 22/04/2032                                                         | 29 100                              | 25 444                    |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                                |                                     |                           |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                                         | 23 000                              | 23 208                    |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                              |                                     |                           |
| 3,200 % éch. 20/09/2055                                                         | ¥ 3 750 000                         | 22 690                    |
| KSA Sukuk Ltd.                                                                  |                                     |                           |
| 3,628 % éch. 20/04/2027                                                         | \$ 20 000                           | 19 930                    |
| MTR Corp. Ltd.                                                                  |                                     |                           |
| 5,250 % éch. 01/04/2055                                                         | 20 000                              | 19 912                    |
| Global Sukuk Ventures                                                           |                                     |                           |
| 4,250 % éch. 10/11/2035                                                         | 19 500                              | 19 344                    |
| Petroleos Mexicanos                                                             |                                     |                           |
| 6,700 % éch. 16/02/2032                                                         | 17 458                              | 17 600                    |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                          |                                     |                           |
| 4,300 % éch. 12/10/2028                                                         | 17 600                              | 17 409                    |
| Vista Energy Argentina S.A.U.                                                   |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 10/06/2033                                                         | 15 400                              | 16 017                    |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien                             |                                     |                           |
| 6,625 % éch. 15/03/2035                                                         | 15 400                              | 15 904                    |
| KSA Sukuk Ltd.                                                                  |                                     |                           |
| 4,875 % éch. 09/09/2035                                                         | 15 800                              | 15 761                    |
| Obligation internationale du gouvernement omanais                               |                                     |                           |
| 6,750 % éch. 28/10/2027                                                         | 14 800                              | 15 382                    |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni                              |                                     |                           |
| 7,125 % éch. 10/06/2036                                                         | 15 100                              | 15 029                    |
| Oracle Corp.                                                                    |                                     |                           |
| 5,700 % éch. 04/02/2036                                                         | 15 000                              | 14 417                    |
| Oracle Corp.                                                                    |                                     |                           |
| 6,700 % éch. 04/02/2056                                                         | 15 100                              | 14 136                    |

(a) Le Fonds Emerging Markets Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                            |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien<br>7,625 % éch. 20/05/2034                  | \$ 44 600                           | \$ 44 600             |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois<br>4,875 % éch. 25/03/2038                  | € 36 000                            | 41 871                |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035                  | PEN 73 380                          | 22 571                |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>4,875 % éch. 16/05/2036                  | € 19 200                            | 22 349                |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>4,875 % éch. 19/05/2033                  | \$ 21 200                           | 20 303                |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain<br>6,001 % éch. 16/01/2036               | € 17 000                            | 20 086                |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>6,125 % éch. 21/01/2031                 | \$ 20 000                           | 19 880                |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,500 % éch. 31/01/2037              | ZAR 322 200                         | 19 132                |
| Industrial Subordinated Trust 2.0<br>6,550 % éch. 15/04/2036                                   | \$ 17 300                           | 17 490                |
| MTR Corp. Ltd.<br>4,125 % éch. 10/06/2046                                                      | € 15 000                            | 17 192                |
| Latvenergo A/S<br>4,162 % éch. 25/06/2033                                                      | 12 700                              | 14 742                |
| Luminis S.A.<br>9,649 % éch. 15/09/2038                                                        | \$ 12 200                           | 14 401                |
| First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,789 % éch. 03/06/2031                                           | 14 500                              | 14 355                |
| Dhahrah Pv2 Energy Co. LLC<br>5,794 % éch. 30/06/2053                                          | 13 700                              | 13 700                |
| Serbia International Bond<br>4,875 % éch. 06/05/2038                                           | € 11 700                            | 13 333                |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni<br>7,125 % éch. 10/06/2036                  | \$ 12 400                           | 12 400                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,804 % éch. 20/04/2033                 | 12 100                              | 12 100                |
| Gacii First Investment Co.<br>6,250 % éch. 14/05/2056                                          | 12 200                              | 12 065                |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>5,125 % éch. 29/06/2031                                              | 12 000                              | 11 874                |
| QNB Finance Ltd.<br>4,679 % éch. 27/04/2029                                                    | 11 900                              | 11 811                |
| Émirat d'Abu Dhabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033                                                  | 11 700                              | 11 626                |
| Alphabet, Inc.<br>6,125 % éch. 13/02/2126                                                      | £ 8 400                             | 11 456                |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine<br>7,150 % éch. 24/02/2055 | \$ 10 000                           | 10 560                |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>6,338 % éch. 04/05/2053                  | 10 900                              | 10 305                |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>4,195 % éch. 13/01/2029                                              | 10 200                              | 10 200                |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>6,500 % éch. 21/01/2033                 | 10 200                              | 10 060                |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033                    | 10 200                              | 10 002                |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi<br>5,000 % éch. 30/04/2034   | 9 600                               | 9 742                 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>4,460 % éch. 04/03/2038                | € 8 200                             | 9 666                 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,625 % éch. 30/05/2037                   | 8 700                               | 9 639                 |
| Obligation internationale du gouvernement philippin<br>5,750 % éch. 27/01/2051                 | \$ 9 500                            | 9 500                 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT<br>7,150 % éch. 22/10/2031                                | 9 400                               | 9 400                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>6,250 % éch. 27/08/2037                  | 9 400                               | 9 310                 |
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais<br>6,975 % éch. 24/04/2029               | 9 300                               | 9 269                 |
| Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd.<br>6,500 % éch. 02/02/2031                                        | 8 900                               | 8 900                 |

| DESCRIPTION                                                                                    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                            |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,750 % éch. 29/05/2034                    | \$ 41 400                           | \$ 42 153                 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,625 % éch. 22/02/2036                   | € 25 400                            | 28 945                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>8,000 % éch. 14/11/2035                 | \$ 21 000                           | 22 581                    |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,875 % éch. 28/02/2035              | ZAR 348 000                         | 21 733                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>6,125 % éch. 21/01/2031                 | \$ 16 800                           | 16 826                    |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien<br>6,375 % éch. 11/04/2031                  | € 14 200                            | 16 460                    |
| Aegea Finance SARL<br>7,625 % éch. 20/01/2036                                                  | \$ 16 200                           | 15 830                    |
| Engie Energia Chile S.A.<br>6,375 % éch. 17/04/2034                                            | 14 900                              | 15 820                    |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine<br>6,600 % éch. 01/06/2036 | 15 000                              | 15 625                    |
| Obligation internationale du gouvernement turc<br>9,125 % éch. 13/07/2030                      | 13 100                              | 14 492                    |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois<br>6,750 % éch. 25/09/2052                  | 13 200                              | 13 912                    |
| Obligation internationale du gouvernement serbe<br>1,000 % éch. 23/09/2028                     | € 11 500                            | 12 246                    |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien<br>7,625 % éch. 29/05/2032                  | \$ 11 700                           | 11 949                    |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare<br>3,375 % éch. 18/07/2035                   | € 9 800                             | 11 514                    |
| LD Celulose International GmbH<br>7,950 % éch. 26/01/2032                                      | \$ 10 000                           | 10 440                    |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien<br>6,250 % éch. 18/03/2031                 | 10 000                              | 10 380                    |
| Metalsa S.A. de C.V.<br>3,750 % éch. 04/05/2031                                                | 10 600                              | 9 198                     |
| DIB Sukuk Ltd.<br>4,572 % éch. 19/11/2030                                                      | 8 500                               | 8 309                     |
| Obligation internationale du gouvernement hongkongais<br>3,750 % éch. 07/06/2032               | € 6 800                             | 8 217                     |
| Magyar Export-Import Bank<br>6,000 % éch. 16/05/2029                                           | 6 200                               | 7 734                     |
| Obligation internationale du gouvernement salvadorien<br>9,650 % éch. 21/11/2054               | \$ 6 700                            | 7 636                     |
| BDO Unibank, Inc.<br>4,375 % éch. 03/12/2030                                                   | 7 300                               | 7 333                     |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien<br>9,450 % éch. 04/02/2033                  | 6 600                               | 7 290                     |
| Bangkok Bank PCL<br>5,082 % éch. 26/11/2035                                                    | 7 000                               | 6 986                     |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 7 308 132                           | \$ 72 884             |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Grupo Nutresa S.A.<br>8,000 % éch. 12/05/2030                                   | \$ 1 700                            | 1 811                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | COP 6 322 600                       | 1 664                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 659                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 633                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 588                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 576                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 575                 |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.<br>5,625 % éch. 22/04/2056              | \$ 1 400                            | 1 400                 |
| Suzano Austria GmbH<br>3,750 % éch. 15/01/2031                                  | 1 500                               | 1 399                 |
| Gaci First Investment Co.<br>6,250 % éch. 14/05/2056                            | 1 400                               | 1 392                 |
| Chile Electricity PEC SpA<br>0,000 % éch. 25/01/2028                            | 1 384                               | 1 257                 |
| Millicom International Cellular S.A.<br>4,500 % éch. 27/04/2031                 | 1 300                               | 1 213                 |
| Banco Internacional del Peru SAA Interbank<br>4,800 % éch. 15/07/2031           | 1 100                               | 1 097                 |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                       | COP 4 219 300                       | 1 066                 |
| State Oil, Inc.<br>0,000 % éch. 24/03/2031                                      | \$ 1 000                            | 989                   |
| GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % éch. 20/05/2028                                        | 900                                 | 914                   |
| Grupo Nutresa S.A.<br>9,000 % éch. 12/05/2035                                   | 800                                 | 904                   |
| PacifiCorp<br>7,125 % éch. 15/08/2056                                           | 900                                 | 902                   |
| Fresnillo PLC<br>4,250 % éch. 02/10/2050                                        | 1 100                               | 863                   |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 7 901 317                           | \$ 78 800                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                 | \$ 1 700                            | 1 781                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | COP 6 322 600                       | 1 762                     |
| Petrobras Global Finance BV<br>5,125 % éch. 10/09/2030                          | \$ 1 700                            | 1 680                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | COP 6 322 600                       | 1 653                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 646                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 621                     |
| Grupo Nutresa S.A.<br>9,000 % éch. 12/05/2035                                   | \$ 1 400                            | 1 582                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | COP 6 322 600                       | 1 580                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 553                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 22/08/2029  | 6 322 600                           | 1 534                     |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.<br>5,625 % éch. 22/04/2056              | \$ 1 400                            | 1 393                     |
| Saudi Awwal Bank<br>5,947 % éch. 04/09/2035                                     | 1 300                               | 1 296                     |
| Windfall Mining Group, Inc.<br>5,854 % éch. 13/05/2032                          | 1 200                               | 1 228                     |
| First Quantum Minerals Ltd.<br>8,625 % éch. 01/06/2031                          | 1 000                               | 1 037                     |
| Cencosud S.A.<br>5,950 % éch. 28/05/2031                                        | 900                                 | 948                       |
| Muthoot Finance Ltd.<br>6,375 % éch. 02/03/2030                                 | 900                                 | 919                       |
| GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % éch. 20/05/2028                                        | 1 000                               | 906                       |
| PRIOR Luxembourg Holding SARL<br>6,750 % éch. 15/10/2030                        | 900                                 | 884                       |
| Digicel International Finance Ltd.<br>8,625 % éch. 01/08/2032                   | 850                                 | 867                       |

(a) Le Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

| DESCRIPTION                                                                                  | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                          |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)              | 60 282 190 \$                       | 601 189               |
|                                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 8,000 % éch. 15/04/2032                   | MXN 1 248 513                       | 65 865                |
| TES colombien 11,750 % éch. 24/01/2035                                                       | COP 166 321 700                     | 43 672                |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,850 % éch. 12/08/2035                   | PEN 80 720                          | 24 984                |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,642 % éch. 07/11/2033                  | MYR 75 200                          | 20 234                |
| Banque de développement chinoise 1,870 % éch. 05/09/2035                                     | CNY 138 350                         | 19 913                |
| TES colombien 11,000 % éch. 22/08/2029                                                       | COP 73 921 700                      | 18 464                |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 8,500 % éch. 31/05/2029                   | MXN 316 300                         | 18 311                |
| Luminis S.A. 9,649 % éch. 15/09/2038                                                         | \$ 13 900                           | 16 408                |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 4,789 % éch. 03/06/2031                                            |                                     | 15 840                |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,400 % éch. 12/08/2034                   | PEN 53 100                          | 15 312                |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 8,500 % éch. 28/02/2030                   | MXN 236 500                         | 13 657                |
| State Oil, Inc. 0,000 % éch. 24/03/2031                                                      | \$ 11 400                           | 11 330                |
| Obligation internationale du gouvernement angolais 9,875 % éch. 31/03/2037                   |                                     | 10 683                |
| Banque de développement chinoise 2,630 % éch. 08/01/2034                                     | CNY 70 310                          | 10 667                |
| Petroleos Mexicanos 7,690 % éch. 23/01/2050                                                  | \$ 11 500                           | 10 375                |
| Emirates NBD Bank PJSC 5,125 % éch. 29/06/2031                                               |                                     | 10 290                |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 10,500 % éch. 15/03/2037 | DOP 573 200                         | 10 004                |
| Obligation internationale du gouvernement qatari 4,800 % éch. 08/04/2033                     | \$ 10 200                           | 10 002                |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % éch. 01/09/2030                       | CLP 8 500 000                       | 9 475                 |

| DESCRIPTION                                                                                  | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                          |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)              | 46 637 507 \$                       | 465 100                   |
|                                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 8,000 % éch. 15/04/2032                   | MXN 1 021 000                       | 55 540                    |
| Obligation internationale du gouvernement angolais 9,875 % éch. 31/03/2037                   | \$ 10 500                           | 11 019                    |
| Beignet Investor LLC 6,581 % éch. 30/05/2049                                                 |                                     | 9 466                     |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 2,750 % éch. 25/10/2029                   | PLN 25 900                          | 6 946                     |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen 8,500 % éch. 04/04/2038                 | PYG 41 237 000                      | 6 408                     |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi 5,000 % éch. 30/04/2034    | \$ 5 900                            | 5 932                     |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït 4,652 % éch. 09/10/2035                  |                                     | 5 561                     |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain 5,950 % éch. 27/04/2033                | € 4 200                             | 5 138                     |
| TES colombien 2,250 % éch. 18/04/2029                                                        | COP 16 746 361                      | 4 171                     |
| Obligation internationale du gouvernement angolais 8,750 % éch. 14/04/2032                   | \$ 3 700                            | 3 769                     |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen 8,500 % éch. 04/04/2038                 | PYG 23 752 000                      | 3 675                     |
| QatarEnergy 4,625 % éch. 23/06/2029                                                          | \$ 3 600                            | 3 586                     |
| Obligation internationale du gouvernement équatorien 0,000 % éch. 31/07/2030                 |                                     | 3 378                     |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 10,500 % éch. 15/03/2037 | DOP 193 100                         | 3 357                     |
| Export-Import Bank of India 5,750 % éch. 12/01/2056                                          | \$ 3 300                            | 3 349                     |
| CBB International Sukuk Programme Co. WLL 6,124 % éch. 03/09/2034                            |                                     | 3 290                     |
| Obligation internationale du gouvernement angolais 9,375 % éch. 31/03/2033                   |                                     | 3 233                     |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni 7,100 % éch. 03/02/2038                   |                                     | 3 231                     |
| Obligation internationale congolaise 8,750 % éch. 16/04/2032                                 |                                     | 3 158                     |

(a) Le Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

| DESCRIPTION                                                                             | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                     |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)         | 80 680                              | \$ 805                | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 70 195                              | \$ 700                    |
|                                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien<br>3,900 % éch. 30/11/2026          | MYR 2 014                           | 513                   | Obligation internationale du gouvernement philippin<br>6,250 % éch. 28/02/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                          | PHP 38 880                          | 657                       |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,000 % éch. 31/01/2030       | ZAR 8 100                           | 494                   | Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,422 % éch. 30/09/2027                                                                                                                                                                                                                                                                                          | MYR 1 730                           | 440                       |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 31/05/2029           | MXN 7 700                           | 438                   | Obligation internationale du gouvernement paraguayen<br>8,500 % éch. 04/04/2038                                                                                                                                                                                                                                                                                         | PYG 1 150 000                       | 179                       |
| Banque européenne pour la reconstruction et le développement<br>6,750 % éch. 16/01/2029 | AZN 650                             | 382                   | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                           | MXN 2 600                           | 152                       |
| Banque de développement chinoise<br>1,870 % éch. 05/09/2035                             | CNY 2 220                           | 320                   | Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>5,875 % éch. 15/03/2031                                                                                                                                                                                                                                                                                         | IDR 2 456 000                       | 140                       |
| Banque européenne pour la reconstruction et le développement<br>6,060 % éch. 02/12/2029 | AZN 500                             | 294                   | Obligation internationale du gouvernement polonais<br>2,750 % éch. 25/10/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                           | PLN 500                             | 134                       |
| Luminis S.A.<br>9,649 % éch. 15/09/2038                                                 | \$ 200                              | 236                   | Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,726 % éch. 31/03/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                          | MYR 478                             | 123                       |
| Banque européenne pour la reconstruction et le développement<br>6,300 % éch. 31/03/2028 | AZN 400                             | 235                   | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 02/03/2028                                                                                                                                                                                                                                                                                           | MXN 1 800                           | 106                       |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                               | COP 951 000                         | 228                   | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | \$ 95                               | 97                        |
| Baiterek National Investment Holding JSC<br>16,950 % éch. 02/04/2029                    | KZT 106 500                         | 221                   | Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035                                                                                                                                                                                                                                                                                           | PEN 300                             | 92                        |
| Baiterek National Investment Holding JSC<br>16,950 % éch. 02/04/2031                    | 106 500                             | 221                   | Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>6,250 % éch. 31/03/2036                                                                                                                                                                                                                                                                                       | ZAR 1 600                           | 78                        |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen<br>8,500 % éch. 04/04/2038         | PYG 1 294 000                       | 199                   | Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,950 % éch. 12/08/2031                                                                                                                                                                                                                                                                                           | PEN 240                             | 76                        |
| First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,789 % éch. 03/06/2031                                    | \$ 200                              | 198                   | Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 31/05/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                           | MXN 1 200                           | 70                        |
| Banque de développement chinoise<br>2,630 % éch. 08/01/2034                             | CNY 1 230                           | 187                   | TES colombien<br>11,000 % éch. 22/08/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | COP 246 800                         | 64                        |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien<br>5,875 % éch. 15/03/2031         | IDR 2 456 000                       | 142                   | Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>7,300 % éch. 12/08/2033                                                                                                                                                                                                                                                                                           | PEN 200                             | 64                        |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,000 % éch. 15/04/2032           | MXN 2 600                           | 141                   | Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>3,450 % éch. 17/06/2043                                                                                                                                                                                                                                                                                        | THB 1 710                           | 60                        |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035           | PEN 450                             | 137                   | Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035                                                                                                                                                                                                                                                                                          | COP 141 700                         | 40                        |
| Obligation d'infrastructure de la république du Kenya<br>12,500 % éch. 10/01/2033       | KES 17 200                          | 136                   | Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>1,840 % éch. 17/05/2036                                                                                                                                                                                                                                                                                        | THB 1 290                           | 40                        |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien<br>3,726 % éch. 31/03/2026          | MYR 510                             | 130                   | Obligation internationale du gouvernement turc<br>34,100 % éch. 10/07/2030                                                                                                                                                                                                                                                                                              | TRY 1 900                           | 40                        |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>5,000 % éch. 25/01/2030           | PLN 400                             | 116                   | TES colombien<br>2,250 % éch. 18/04/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | COP 161 222                         | 40                        |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>5,000 % éch. 25/10/2035           | 400                                 | 107                   | (a) Le Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.                                                                                                                                                                                                                                                              |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>5,400 % éch. 12/08/2034           | PEN 350                             | 99                    | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. |                                     |                           |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                               | \$ 100                              | 95                    | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.                       |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,750 % éch. 31/01/2044       | ZAR 1 600                           | 87                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029           | MXN 1 400                           | 81                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement argentin<br>4,125 % éch. 09/07/2035           | \$ 100                              | 79                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |
| TES colombien<br>12,500 % éch. 27/02/2030                                               | COP 316 400                         | 79                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO ESG Income Fund

| DESCRIPTION                                                                    |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                            |     |                                     |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                         | \$  | 10 600                              | \$ 10 492             |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                      |     | 10 013                              | 9 485                 |
| TES colombien<br>12,500 % éch. 27/02/2030                                      | COP | 30 932 900                          | 8 979                 |
| Obligations du Trésor américain<br>4,750 % éch. 15/02/2056                     | \$  | 5 900                               | 5 896                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>5,625 % éch. 19/02/2036 | €   | 4 500                               | 5 054                 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035  | PEN | 15 200                              | 4 875                 |
| CBRE Europe Logistics Partners S.C.A. SICAV-SIF<br>3,875 % éch. 28/05/2031     | €   | 4 000                               | 4 607                 |
| Ares European CLO DAC<br>3,512 % éch. 15/07/2037                               |     | 3 300                               | 3 814                 |
| Capital Four CLO DAC<br>3,854 % éch. 15/04/2038                                |     | 2 900                               | 3 436                 |
| PLS Group Ltd.<br>6,875 % éch. 01/05/2031                                      | \$  | 2 600                               | 2 683                 |
| Obligation du gouvernement australien<br>5,000 % éch. 21/06/2036               | AUD | 3 800                               | 2 679                 |
| Margay CLO DAC<br>3,439 % éch. 15/07/2037                                      | €   | 2 300                               | 2 667                 |
| Rakuten Group, Inc.<br>9,750 % éch. 15/04/2029                                 | \$  | 2 440                               | 2 663                 |
| ADT Security Corp.<br>5,875 % éch. 15/10/2033                                  |     | 2 480                               | 2 435                 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>7,300 % éch. 12/08/2033  | PEN | 7 000                               | 2 340                 |
| Volkswagen Bank GmbH<br>4,000 % éch. 26/11/2030                                | €   | 2 000                               | 2 316                 |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.<br>3,875 % éch. 29/04/2033                 |     | 1 900                               | 2 218                 |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033    | \$  | 2 200                               | 2 157                 |
| Arbour CLO DAC<br>3,883 % éch. 15/08/2038                                      | €   | 1 800                               | 2 145                 |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2045                     | \$  | 2 090                               | 2 031                 |
| Gap, Inc.<br>3,875 % éch. 01/10/2031                                           |     | 2 200                               | 2 010                 |
| ARGAN S.A.<br>3,779 % éch. 30/10/2029                                          | €   | 1 700                               | 1 991                 |
| Anglian Water Services Financing PLC<br>4,250 % éch. 23/06/2036                |     | 1 700                               | 1 956                 |
| OCP Euro CLO DAC<br>3,513 % éch. 15/04/2037                                    |     | 1 700                               | 1 928                 |
| BPCE S.A.<br>5,389 % éch. 28/05/2031                                           | \$  | 1 760                               | 1 811                 |
| Plenti PL & Green ABS Trust<br>5,276 % éch. 11/07/2037                         | AUD | 2 500                               | 1 777                 |
| CPI Property Group S.A.<br>6,875 % éch. 05/02/2033                             | £   | 1 300                               | 1 754                 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>4,875 % éch. 16/05/2036  | €   | 1 500                               | 1 746                 |
| Altice France S.A.<br>9,360 % éch. 14/05/2029                                  | \$  | 1 728                               | 1 728                 |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>6,125 % éch. 01/06/2031                       |     | 1 700                               | 1 700                 |
| Toro European CLO DAC<br>4,154 % éch. 15/04/2037                               | €   | 1 400                               | 1 624                 |
| Nova Securitisation SARL<br>5,750 % éch. 03/02/2031                            | \$  | 1 600                               | 1 590                 |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                      | COP | 5 471 800                           | 1 552                 |
| TES colombien<br>12,000 % éch. 13/03/2058                                      |     | 4 879 000                           | 1 418                 |

| DESCRIPTION                                                                          |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |    |                                     |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                               | \$ | 10 230                              | \$ 10 041                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,500 % éch. 31/03/2026                               |    | 4 900                               | 4 903                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,500 % éch. 01/05/2054 |    | 2 480                               | 2 578                     |
| goeasy Ltd.<br>9,250 % éch. 01/12/2028                                               |    | 1 200                               | 981                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,500 % éch. 15/04/2027                               |    | 800                                 | 806                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035                               |    | 490                                 | 491                       |
| Oracle Corp.<br>2,300 % éch. 25/03/2028                                              |    | 350                                 | 335                       |
| Oracle Corp.<br>4,800 % éch. 03/08/2028                                              |    | 320                                 | 320                       |
| New Immo Holding S.A.<br>2,750 % éch. 26/11/2026                                     | €  | 200                                 | 232                       |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

| DESCRIPTION                                                                  | ACTIONS                       | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                  | ACTIONS                       | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                               |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                               |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)               | 1 518 344 €                   | 162 043               | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)                     | 1 845 327 €                   | 196 872                   |
|                                                                              | VALEUR NOMINALE (en milliers) |                       | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 5 622 216                     | 56 223                    |
| Bon du Trésor britannique 4,125 % éch. 07/03/2031                            | £ 57 500                      | 66 574                |                                                                              | VALEUR NOMINALE (en milliers) |                           |
|                                                                              | ACTIONS                       |                       | Obligation internationale du gouvernement néerlandais                        |                               |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 5 622 216                     | 56 222                | 2,500 % éch. 15/01/2030                                                      | € 27 900                      | 28 084                    |
|                                                                              | VALEUR NOMINALE (en milliers) |                       | Bon du Trésor britannique 4,125 % éch. 07/03/2031                            | £ 22 800                      | 25 990                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,100 % éch. 15/08/2031                    | € 41 010                      | 41 531                | Obligation internationale du gouvernement espagnol                           |                               |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,500 % éch. 15/02/2031                    | 38 000                        | 39 515                | 3,200 % éch. 31/10/2035                                                      | € 20 500                      | 20 174                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,450 % éch. 15/07/2031                    | 32 200                        | 33 303                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,150 % éch. 15/11/2031                    | 19 200                        | 19 121                    |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol                           |                               |                       | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,300 % éch. 01/10/2054                    | 18 900                        | 18 195                    |
| 3,400 % éch. 31/10/2036                                                      | 32 600                        | 32 428                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,500 % éch. 01/03/2030                    | 16 700                        | 17 144                    |
| Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 22/10/2031                            | £ 24 100                      | 27 745                | Bon du Trésor britannique 4,750 % éch. 22/10/2043                            | £ 12 900                      | 13 831                    |
| Obligation internationale du gouvernement belge                              |                               |                       | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,625 % éch. 10/01/2034                      | € 13 700                      | 13 476                    |
| 3,400 % éch. 22/06/2036                                                      | € 23 000                      | 22 667                | Obligation internationale du gouvernement espagnol                           |                               |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,850 % éch. 01/02/2031                    | 22 100                        | 22 336                | 1,900 % éch. 31/10/2052                                                      | 20 000                        | 13 015                    |
| Obligation internationale du gouvernement australien                         |                               |                       | Obligation internationale du gouvernement espagnol                           |                               |                           |
| 1,500 % éch. 21/06/2031                                                      | AUD 42 700                    | 21 400                | 3,500 % éch. 31/05/2029                                                      | 11 300                        | 11 500                    |
| Obligation internationale du gouvernement slovène                            |                               |                       | Nykredit Realkredit A/S 4,000 % éch. 01/10/2056                              | DKK 84 347                    | 11 216                    |
| 3,275 % éch. 12/03/2036                                                      | € 18 600                      | 18 650                | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/04/2026                              | 81 800                        | 10 929                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,500 % éch. 01/03/2030                    | 16 700                        | 17 363                | Coventry Building Society 0,010 % éch. 07/07/2028                            | € 11 300                      | 10 585                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,250 % éch. 15/09/2032                    | 16 145                        | 16 459                | Union européenne 3,375 % éch. 04/10/2039                                     | 10 900                        | 10 493                    |
|                                                                              | ACTIONS                       |                       | Ginnie Mae 3,500 % éch. 20/01/2055                                           | \$ 12 756                     | 10 163                    |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro Government Bond UCITS ETF        | 568 658                       | 14 056                | Banco BPM SpA 3,750 % éch. 27/06/2028                                        | € 10 000                      | 10 143                    |
|                                                                              | VALEUR NOMINALE (en milliers) |                       | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/04/2026                 | DKK 75 300                    | 10 061                    |
| Bon du Trésor britannique 4,750 % éch. 22/10/2043                            | £ 12 900                      | 13 373                | Compartment Driver UK Ten 4,330 % éch. 25/04/2033                            | £ 8 400                       | 9 699                     |
| Ginnie Mae 3,500 % éch. 20/10/2055                                           | \$ 12 800                     | 10 198                | Obligation internationale du gouvernement saoudien                           |                               |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation                       |                               |                       | 5,125 % éch. 13/01/2028                                                      | \$ 10 300                     | 8 867                     |
| 1,125 % éch. 15/10/2030 (b)                                                  | 11 828                        | 10 187                | Obligation internationale du gouvernement irlandais                          |                               |                           |
| Union européenne 3,625 % éch. 12/12/2040                                     | € 10 100                      | 9 865                 | 2,600 % éch. 18/10/2034                                                      | € 9 000                       | 8 718                     |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol                           |                               |                       | Economic Master Issuer PLC 0,000 % éch. 25/04/2075                           | £ 7 486                       | 8 663                     |
| 2,700 % éch. 31/01/2030                                                      | 9 600                         | 9 503                 | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028                                           | € 8 754                       | 8 566                     |
| Obligation internationale du gouvernement slovène                            |                               |                       | Obligation internationale du gouvernement mexicain                           |                               |                           |
| 3,125 % éch. 02/07/2035                                                      | 9 300                         | 9 223                 | 6,625 % éch. 29/01/2038                                                      | \$ 9 500                      | 8 470                     |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC 4,587 % éch. 18/02/2068                    | £ 7 800                       | 8 998                 | E-Carat DE 0,000 % éch. 25/05/2034                                           | € 8 300                       | 8 323                     |
| Obligation internationale du gouvernement autrichien                         |                               |                       | Holmes Master Issuer PLC 4,444 % éch. 15/10/2072                             | £ 7 100                       | 8 209                     |
| 3,200 % éch. 20/02/2036                                                      | € 9 000                       | 8 997                 | Permanent Master Issuer PLC 0,000 % éch. 15/07/2073                          | 7 100                         | 8 199                     |
|                                                                              |                               |                       | SC Germany S.A., Compartment Leasing 2,425 % éch. 14/09/2036                 | € 8 100                       | 8 102                     |
|                                                                              |                               |                       | White Rose Master Issuer PLC 4,316 % éch. 16/07/2071                         | £ 6 716                       | 7 770                     |

(a) Le Fonds Euro Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Euro Credit Fund

| DESCRIPTION                                                                  | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                  | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 3 350 958                           | € 33 510              | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 3 279 905                           | € 32 800                  |
|                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Union européenne                                                             |                                     |                       | Union européenne                                                             |                                     |                           |
| 3,125 % éch. 04/12/2030                                                      | € 18 800                            | 19 372                | 0,000 % éch. 04/10/2030                                                      | € 7 900                             | 7 049                     |
| Goldman Sachs Group, Inc.                                                    |                                     |                       | Fonds européen de stabilité financière                                       |                                     |                           |
| 3,509 % éch. 17/08/2033                                                      | 5 100                               | 5 079                 | 3,000 % éch. 15/12/2028                                                      | 6 100                               | 6 162                     |
| BPCE S.A.                                                                    |                                     |                       | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                                              |                                     |                           |
| 3,875 % éch. 03/01/2034                                                      | 3 400                               | 3 396                 | 2,750 % éch. 15/05/2030                                                      | 6 100                               | 6 109                     |
| UBS Group AG                                                                 |                                     |                       | Banque européenne d'investissement                                           |                                     |                           |
| 1,000 % éch. 13/01/2037                                                      | 3 300                               | 3 295                 | 0,050 % éch. 13/10/2034                                                      | 6 800                               | 5 342                     |
| Mizuho Financial Group, Inc.                                                 |                                     |                       | Banco BPM SpA                                                                |                                     |                           |
| 3,210 % éch. 16/05/2032                                                      | 3 200                               | 3 200                 | 3,250 % éch. 28/05/2031                                                      | 3 900                               | 3 972                     |
| Nykredit Realkredit A/S                                                      |                                     |                       | UBS Group AG                                                                 |                                     |                           |
| 3,750 % éch. 26/09/2033                                                      | 3 100                               | 3 079                 | 1,000 % éch. 13/01/2037                                                      | 3 300                               | 3 272                     |
| GSG Bidco Ltd.                                                               |                                     |                       | Adif Alta Velocidad                                                          |                                     |                           |
| 4,700 % éch. 15/06/2031                                                      | 2 800                               | 2 800                 | 3,500 % éch. 30/07/2028                                                      | 3 000                               | 3 037                     |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.                                        |                                     |                       | Banque européenne d'investissement                                           |                                     |                           |
| 2,989 % éch. 10/02/2030                                                      | 2 600                               | 2 600                 | 0,250 % éch. 20/01/2032                                                      | 3 100                               | 2 713                     |
| Anglian Water Services Financing PLC                                         |                                     |                       | Bureau Veritas S.A.                                                          |                                     |                           |
| 4,250 % éch. 23/06/2036                                                      | 2 600                               | 2 577                 | 3,375 % éch. 01/10/2033                                                      | 2 600                               | 2 582                     |
| Informa PLC                                                                  |                                     |                       | Kommunekredit                                                                |                                     |                           |
| 3,750 % éch. 29/04/2032                                                      | 2 400                               | 2 385                 | 2,375 % éch. 15/09/2032                                                      | 2 500                               | 2 435                     |
| Morgan Stanley                                                               |                                     |                       | Banque européenne d'investissement                                           |                                     |                           |
| 3,790 % éch. 21/03/2030                                                      | 2 300                               | 2 362                 | 2,750 % éch. 28/07/2028                                                      | 2 400                               | 2 406                     |
| Novartis Finance S.A.                                                        |                                     |                       | CaixaBank S.A.                                                               |                                     |                           |
| 3,100 % éch. 13/01/2032                                                      | 2 300                               | 2 289                 | 4,125 % éch. 09/02/2032                                                      | 2 200                               | 2 291                     |
| Japan Bank for International Cooperation                                     |                                     |                       | Nykredit Realkredit A/S                                                      |                                     |                           |
| 3,125 % éch. 22/04/2031                                                      | 2 200                               | 2 198                 | 3,625 % éch. 24/07/2030                                                      | 2 100                               | 2 110                     |
| Robert Bosch GmbH                                                            |                                     |                       | Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.                                      |                                     |                           |
| 4,000 % éch. 21/05/2036                                                      | 2 200                               | 2 170                 | 4,125 % éch. 13/03/2029                                                      | 2 000                               | 2 081                     |
| Stellantis NV                                                                |                                     |                       | Commonwealth Bank of Australia                                               |                                     |                           |
| 6,250 % éch. 16/03/2031                                                      | 2 000                               | 1 990                 | 2,853 % éch. 09/10/2031                                                      | 1 900                               | 1 902                     |
| Akelius Residential Property AB                                              |                                     |                       | Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                                           |                                     |                           |
| 3,950 % éch. 25/03/2031                                                      | 2 000                               | 1 987                 | 3,250 % éch. 08/06/2033                                                      | 1 900                               | 1 896                     |
| NTT Finance Corp.                                                            |                                     |                       | Orange S.A.                                                                  |                                     |                           |
| 2,906 % éch. 16/03/2029                                                      | 2 000                               | 1 980                 | 4,000 % éch. 13/01/2029                                                      | \$ 2 200                            | 1 867                     |
| Toronto-Dominion Bank                                                        |                                     |                       | Holding d'Infrastructures de Transport SASU                                  |                                     |                           |
| 3,641 % éch. 22/10/2031                                                      | 1 900                               | 1 908                 | 1,625 % éch. 18/09/2029                                                      | € 1 900                             | 1 817                     |
| Orange S.A.                                                                  |                                     |                       | BPCE S.A.                                                                    |                                     |                           |
| 4,000 % éch. 13/01/2029                                                      | \$ 2 200                            | 1 880                 | 1,625 % éch. 02/03/2029                                                      | 1 800                               | 1 765                     |

(a) Le Fonds Euro Credit Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Euro Income Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                               |                                     |                       | <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026 (suite)</b>                                      |                                     |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                            | \$ 51 000                           | € 42 902              | GS Mortgage-Backed Securities Trust<br>3,133 % éch. 24/11/2067                   | € 12 700                            | € 12 700              |
| Obligation internationale du gouvernement<br>mexicain<br>8,500 % éch. 02/03/2028  | MXN 831 200                         | 41 639                | TES colombien<br>12,750 % éch. 28/11/2040                                        | COP 53 081 700                      | 12 331                |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                         | \$ 49 062                           | 39 701                | Obligation internationale du gouvernement<br>péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035 | PEN 47 099                          | 12 240                |
| <b>ACTIONS</b>                                                                    |                                     |                       | Informa PLC<br>3,750 % éch. 29/04/2032                                           | € 12 000                            | 11 927                |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar<br>Short-Term Floating NAV Fund (a)   | 3 212 577                           | 32 127                | Dilosk RMBS DAC<br>2,733 % éch. 25/10/2064                                       | 11 700                              | 11 700                |
| <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>                                      |                                     |                       |                                                                                  |                                     |                       |
| Discovery Global Holdings, Inc.<br>0,000 % éch. 03/06/2033                        | € 32 200                            | 32 120                |                                                                                  |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement<br>mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029  | MXN 613 300                         | 30 695                |                                                                                  |                                     |                       |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/01/2056                                             | \$ 30 808                           | 26 879                |                                                                                  |                                     |                       |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/02/2055                                             | 29 992                              | 26 166                |                                                                                  |                                     |                       |
| Polaris PLC<br>0,000 % éch. 27/03/2069                                            | £ 20 000                            | 23 165                |                                                                                  |                                     |                       |
| Sculptor European CLO DAC<br>2,939 % éch. 10/10/2034                              | € 20 000                            | 20 021                |                                                                                  |                                     |                       |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                             | 19 900                              | 19 900                |                                                                                  |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement<br>mexicain<br>8,500 % éch. 31/05/2029  | MXN 387 000                         | 19 332                |                                                                                  |                                     |                       |
| Frontier Mortgage Funding PLC<br>4,532 % éch. 20/12/2066                          | £ 16 400                            | 18 976                |                                                                                  |                                     |                       |
| Davide Campari-Milano NV<br>4,250 % éch. 17/06/2033                               | € 19 000                            | 18 849                |                                                                                  |                                     |                       |
| Verisure Holding AB<br>4,125 % éch. 02/01/2032                                    | 18 600                              | 18 600                |                                                                                  |                                     |                       |
| Curzon Mortgages PLC<br>4,592 % éch. 28/07/2049                                   | £ 15 600                            | 18 035                |                                                                                  |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement<br>mexicain<br>8,500 % éch. 28/02/2030  | MXN 333 300                         | 16 561                |                                                                                  |                                     |                       |
| VCL Multi-Compartment S.A.<br>2,394 % éch. 21/03/2033                             | € 16 500                            | 16 500                |                                                                                  |                                     |                       |
| Mahle GmbH<br>7,125 % éch. 15/07/2032                                             | 15 300                              | 15 989                |                                                                                  |                                     |                       |
| Invesco Euro CLO DAC<br>3,277 % éch. 15/07/2037                                   | 15 600                              | 15 600                |                                                                                  |                                     |                       |
| Madison Park Euro Funding DAC<br>3,979 % éch. 15/07/2032                          | 15 444                              | 15 441                |                                                                                  |                                     |                       |
| Anglian Water Services Financing PLC<br>4,250 % éch. 23/06/2036                   | 15 500                              | 15 362                |                                                                                  |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement<br>mexicain<br>3,875 % éch. 16/05/2031  | 15 000                              | 14 984                |                                                                                  |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement<br>mexicain<br>4,875 % éch. 16/05/2036  | 15 000                              | 14 946                |                                                                                  |                                     |                       |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.<br>3,875 % éch. 29/04/2033                    | 14 600                              | 14 544                |                                                                                  |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement<br>égyptien<br>19,698 % éch. 14/10/2030 | EGP 766 000                         | 13 689                |                                                                                  |                                     |                       |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>2,743 % éch. 17/02/2029                              | € 13 600                            | 13 600                |                                                                                  |                                     |                       |
| BBVA Consumer FTA<br>2,849 % éch. 20/05/2039                                      | 13 600                              | 13 600                |                                                                                  |                                     |                       |
| Arbour CLO DAC<br>3,453 % éch. 15/08/2038                                         | 13 500                              | 13 500                |                                                                                  |                                     |                       |
| GSG Bidco Ltd.<br>5,375 % éch. 15/06/2036                                         | 13 500                              | 13 500                |                                                                                  |                                     |                       |
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL<br>2,953 % éch. 26/12/2041                      | 13 400                              | 13 400                |                                                                                  |                                     |                       |
| Bavarian Sky S.A.<br>2,705 % éch. 20/02/2034                                      | 13 300                              | 13 300                |                                                                                  |                                     |                       |
| VCL Multi-Compartment S.A.<br>2,715 % éch. 21/11/2032                             | 13 300                              | 13 300                |                                                                                  |                                     |                       |
| <b>ACTIONS</b>                                                                    |                                     |                       |                                                                                  |                                     |                       |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity<br>UCITS ETF (a)                       | 120 500                             | 12 836                |                                                                                  |                                     |                       |

| DESCRIPTION                                                                     |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |     |                                     |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | \$  | 50 140                              | € 42 043                  |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 02/03/2028   | MXN | 831 200                             | 41 835                    |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/01/2056                                           | \$  | 30 808                              | 27 714                    |
| Nissan Motor Co. Ltd.<br>5,250 % éch. 17/07/2029                                | €   | 26 535                              | 27 091                    |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/02/2055                                           | \$  | 29 992                              | 26 979                    |
| <b>ACTIONS</b>                                                                  |     |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) |     | 1 689 944                           | 16 900                    |
|                                                                                 |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>4,875 % éch. 16/05/2036   | €   | 15 000                              | 14 775                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>2,743 % éch. 17/02/2029                            |     | 13 600                              | 13 484                    |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % éch. 15/04/2032                             |     | 13 400                              | 12 796                    |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>8,248 % éch. 21/11/2033                                  | \$  | 11 740                              | 11 978                    |
| Magnum Icc Finance BV<br>3,250 % éch. 26/11/2031                                | €   | 11 700                              | 11 559                    |
| Barry Callebaut Services NV<br>3,750 % éch. 19/02/2028                          |     | 11 200                              | 11 292                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>5,375 % éch. 16/05/2040   |     | 10 000                              | 10 070                    |
| EXOR NV<br>3,750 % éch. 05/11/2035                                              |     | 10 100                              | 9 917                     |
| Smiths Group PLC<br>3,625 % éch. 13/11/2033                                     |     | 9 600                               | 9 504                     |
| Venture Global LNG, Inc.<br>9,500 % éch. 01/02/2029                             | \$  | 8 481                               | 7 890                     |
| Sagax AB<br>1,125 % éch. 30/01/2027                                             | €   | 7 082                               | 6 981                     |
| IHG Finance LLC<br>4,375 % éch. 28/11/2029                                      |     | 6 520                               | 6 806                     |
| Émirat d'Abu Dhabi<br>4,625 % éch. 20/04/2033                                   | \$  | 7 400                               | 6 352                     |
| Warehouses De Pauw CVA<br>3,125 % éch. 15/01/2031                               | €   | 6 500                               | 6 282                     |
| AXA Logistics Europe Master S.C.A.<br>3,375 % éch. 13/05/2031                   |     | 6 100                               | 6 079                     |
| Morgan Stanley<br>3,383 % éch. 23/01/2032                                       |     | 5 820                               | 5 831                     |
| Galderma Finance Europe BV<br>3,375 % éch. 17/03/2031                           |     | 5 700                               | 5 671                     |
| SoftBank Group Corp.<br>6,375 % éch. 22/04/2030                                 |     | 5 500                               | 5 647                     |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033     | \$  | 5 700                               | 4 931                     |
| Informa PLC<br>3,750 % éch. 29/04/2032                                          | €   | 4 600                               | 4 602                     |

(a) Le Fonds Euro Income Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Euro Long Average Duration Fund

| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                                | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                        |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>4,100 % éch. 25/05/2046         | € 60 300                            | \$ 59 820             | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar<br>Short-Term Floating NAV Fund (a)            | 4 900 297 \$                        | 49 004                    |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       |                                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-<br>Term Floating NAV Fund (a)      | 4 900 297                           | 49 002                | Obligation internationale du gouvernement français<br>4,500 % éch. 25/04/2041              | € 44 150                            | 46 352                    |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                               | 24 700                              | 25 047                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                  | £ 40 200                            | 46 543                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                               | 23 100                              | 23 535                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,100 % éch. 15/08/2031                          | € 31 461                            | 31 861                | Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                       | £ 20 100                            | 22 912                    |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>4,400 % éch. 25/05/2057         | 28 200                              | 28 077                | République d'Allemagne<br>1,800 % éch. 15/08/2053                                          | € 31 400                            | 22 008                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                          | 24 700                              | 25 548                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,850 % éch. 01/02/2031                               | 19 700                              | 19 509                    |
| République d'Allemagne<br>2,500 % éch. 04/07/2044                                     | 28 600                              | 25 259                | Obligation internationale du gouvernement français<br>3,250 % éch. 25/05/2055              | 22 500                              | 18 365                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | 23 100                              | 24 023                | Obligation internationale du gouvernement français<br>2,000 % éch. 25/05/2048              | 25 600                              | 17 444                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,000 % éch. 22/10/2031                                  | £ 17 900                            | 20 603                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                               | 14 900                              | 15 296                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,850 % éch. 01/02/2031                          | € 19 700                            | 19 911                | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,625 % éch. 15/10/2029 (b)      | \$ 16 528                           | 14 293                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,125 % éch. 15/10/2030 (b) | \$ 21 953                           | 18 906                | Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>4,200 % éch. 31/01/2037              | € 13 300                            | 14 113                    |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/11/2055                                                 | 22 000                              | 17 495                |                                                                                            | ACTIONS                             |                           |
| Obligation internationale du gouvernement slovène<br>3,275 % éch. 12/03/2036          | € 17 300                            | 17 341                | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity<br>UCITS ETF (a)                                | 127 000                             | 13 511                    |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>3,750 % éch. 25/05/2056         | 17 700                              | 15 733                |                                                                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                          | 14 900                              | 15 492                | Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                       | £ 12 100                            | 13 063                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,250 % éch. 15/07/2029 (b) | \$ 17 238                           | 14 306                | République d'Allemagne<br>2,900 % éch. 15/08/2056                                          | € 14 500                            | 12 438                    |
| République d'Allemagne<br>2,900 % éch. 15/08/2056                                     | € 14 500                            | 12 825                | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>2,625 % éch. 10/01/2034                                 | 12 100                              | 11 613                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,250 % éch. 15/09/2032                          | 12 301                              | 12 540                | Obligation internationale du gouvernement français<br>0,500 % éch. 25/06/2044              | 21 000                              | 11 417                    |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       | Obligation internationale du gouvernement néerlandais<br>2,000 % éch. 15/01/2054           | 14 400                              | 10 308                    |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro<br>Government Bond UCITS ETF              | 496 500                             | 12 381                | Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % éch. 01/10/2056                                         | DKK 70 220                          | 9 337                     |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | République d'Allemagne<br>1,000 % éch. 15/05/2038                                          | € 11 100                            | 8 553                     |
| République d'Allemagne<br>1,250 % éch. 15/08/2048                                     | € 17 700                            | 11 668                | Obligation internationale du gouvernement français<br>4,000 % éch. 25/10/2038              | 8 400                               | 8 382                     |
| Obligation internationale du gouvernement néerlandais<br>3,500 % éch. 15/01/2056      | 11 200                              | 11 139                | République d'Allemagne<br>2,200 % éch. 15/02/2034                                          | 8 000                               | 7 536                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>3,600 % éch. 25/05/2042         | 11 500                              | 10 951                | République d'Allemagne<br>2,600 % éch. 15/05/2041                                          | 7 900                               | 7 191                     |
| Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                  | £ 10 000                            | 10 367                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,700 % éch. 15/06/2030                               | 6 900                               | 7 088                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/01/2056                                                 | \$ 11 000                           | 8 763                 | Compartment Driver UK Ten<br>4,330 % éch. 25/04/2033                                       | £ 6 100                             | 7 043                     |
| Obligation internationale du gouvernement néerlandais<br>2,750 % éch. 15/01/2047      | € 9 700                             | 8 660                 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,950 % éch. 01/07/2030                               | € 7 000                             | 6 991                     |
| Obligation internationale du gouvernement slovaque<br>4,125 % éch. 19/02/2046         | 8 000                               | 7 874                 | Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035                                                | 6 500                               | 6 559                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>4,000 % éch. 25/04/2060         | 8 000                               | 7 464                 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,394 % éch. 15/10/2031                               | 6 100                               | 6 313                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>4,000 % éch. 25/04/2055         | 7 900                               | 7 355                 | Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>5,125 % éch. 13/01/2028              | \$ 7 200                            | 6 199                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>3,250 % éch. 25/05/2055         | 8 800                               | 7 287                 | Permanent Master Issuer PLC<br>0,000 % éch. 15/07/2073                                     | £ 5 300                             | 6 120                     |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC<br>4,587 % éch. 18/02/2068                          | £ 6 200                             | 7 152                 | E-Carat DE<br>0,000 % éch. 25/05/2034                                                      | € 6 100                             | 6 117                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,700 % éch. 15/06/2030                          | € 6 900                             | 7 126                 | Obligation internationale du gouvernement français<br>0,750 % éch. 25/05/2053              | 14 000                              | 5 985                     |
| Obligation internationale du gouvernement slovène<br>3,125 % éch. 02/07/2035          | 7 100                               | 7 041                 | SC Germany S.A., Compartment Leasing<br>2,425 % éch. 14/09/2036                            | 5 900                               | 5 902                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,950 % éch. 01/07/2030                          | 7 000                               | 7 021                 |                                                                                            |                                     |                           |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       | (a) Le Fonds Euro Long Average Duration Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. |                                     |                           |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity<br>UCITS ETF (a)                           | 64 500                              | 6 859                 | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.          |                                     |                           |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Euro Short-Term Fund

| DESCRIPTION                                                                  | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                    | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                            |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 6 953 682                           | € 69 538              | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)   | 6 169 943                           | € 61 700                  |
|                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,100 % éch. 26/08/2027                 | € 18 000                            | 17 863                | Obligation internationale du gouvernement du Koweït<br>4,016 % éch. 09/10/2028 | \$ 3 700                            | 3 164                     |
| Golden Bar Securitisation SRL<br>3,136 % éch. 20/12/2044                     | 3 300                               | 3 309                 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>3,629 % éch. 06/04/2026                     | € 3 000                             | 3 006                     |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>6,127 % éch. 20/02/2054                   | £ 2 695                             | 3 117                 | Coventry Building Society<br>0,125 % éch. 20/06/2026                           | 2 800                               | 2 781                     |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC<br>4,587 % éch. 18/02/2068                 | 2 400                               | 2 768                 | SC Germany S.A., Compartment Leasing<br>2,425 % éch. 14/09/2036                | 2 200                               | 2 202                     |
| Alphabet, Inc.<br>4,125 % éch. 13/02/2029                                    | 2 400                               | 2 753                 | DNB Boligkredit A/S<br>0,250 % éch. 07/09/2026                                 | 1 800                               | 1 782                     |
| Hill FL BV<br>2,939 % éch. 18/06/2034                                        | € 2 600                             | 2 600                 | E-Carat DE<br>0,000 % éch. 25/05/2034                                          | 1 500                               | 1 504                     |
| Harvest Funding PLC<br>4,643 % éch. 15/11/2069                               | £ 2 200                             | 2 526                 | Toronto-Dominion Bank<br>3,250 % éch. 27/04/2026                               | 1 500                               | 1 503                     |
| Auto ABS Spanish Loans<br>3,713 % éch. 28/09/2038                            | € 2 446                             | 2 453                 | Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.<br>0,875 % éch. 07/04/2026                    | 1 466                               | 1 464                     |
| Holmes Master Issuer PLC<br>4,277 % éch. 15/10/2072                          | £ 2 000                             | 2 308                 | Dell Bank International DAC<br>4,500 % éch. 18/10/2027                         | 1 400                               | 1 439                     |
| Koromo UK PLC<br>4,305 % éch. 23/11/2032                                     | 2 000                               | 2 308                 | Compartment VCL<br>2,431 % éch. 21/04/2031                                     | 1 314                               | 1 315                     |
| Polaris PLC<br>4,464 % éch. 27/06/2070                                       | 2 000                               | 2 308                 | Lloyds Bank PLC<br>0,125 % éch. 18/06/2026                                     | 1 203                               | 1 195                     |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                        | € 2 300                             | 2 300                 | Banco di Desio e della Brianza SpA<br>0,375 % éch. 24/07/2026                  | 1 100                               | 1 092                     |
| Bavarian Sky S.A.<br>2,705 % éch. 20/02/2034                                 | 2 300                               | 2 300                 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA<br>0,500 % éch. 01/10/2026         | 1 000                               | 991                       |
| NIBC Bank NV<br>2,750 % éch. 26/03/2029                                      | 2 300                               | 2 299                 | Cie de Financement Foncier S.A.<br>0,225 % éch. 14/09/2026                     | 900                                 | 892                       |
| Driver UK Multi-Compartment S.A.<br>4,315 % éch. 25/09/2033                  | £ 2 000                             | 2 298                 | Cie de Saint-Gobain S.A.<br>2,750 % éch. 04/04/2028                            | 800                                 | 803                       |
| Pony S.A., Compartment German Auto Loans<br>2,609 % éch. 14/12/2036          | € 2 100                             | 2 100                 | Bavarian Sky S.A.<br>2,367 % éch. 21/02/2033                                   | 800                                 | 801                       |
| Dartry Park CLO DAC<br>2,963 % éch. 28/01/2034                               | 2 027                               | 2 027                 | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie<br>3,150 % éch. 20/11/2026                 | 600                                 | 605                       |
| PMF PLC<br>4,495 % éch. 16/02/2063                                           | £ 1 500                             | 1 733                 | VCL Multi-Compartment S.A.<br>2,389 % éch. 21/12/2030                          | 556                                 | 557                       |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>0,875 % éch. 09/05/2029                         | € 1 700                             | 1 596                 | E-Carat DE<br>3,529 % éch. 25/11/2035                                          | 500                                 | 500                       |

(a) Le Fonds Euro Short-Term Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                  | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                      | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                          |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                              |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 6 227 506                           | € 62 276              | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)     | 4 459 742                           | € 44 600                  |
|                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)                         | 77 882                              | 8 298                     |
| IHO Verwaltungs GmbH<br>5,625 % éch. 15/05/2031                              | € 4 300                             | 4 322                 |                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Fibercop SpA<br>5,125 % éch. 30/06/2032                                      | 3 500                               | 3 567                 | Bellis Acquisition Co. PLC<br>8,125 % éch. 14/05/2030                            | £ 3 500                             | 3 757                     |
| Maxam Prill SARL<br>6,000 % éch. 15/07/2030                                  | 3 350                               | 3 414                 | Albion Financing 1 SARL<br>5,375 % éch. 21/05/2030                               | € 3 000                             | 3 000                     |
| Metlen Energy & Metals S.A.<br>3,875 % éch. 26/05/2031                       | 3 500                               | 3 398                 | Cidron Aida Finco SARL<br>7,000 % éch. 27/10/2031                                | 2 900                               | 2 766                     |
| Infrastrutture Wireless Italiana SpA<br>3,750 % éch. 01/04/2030              | 3 300                               | 3 253                 | BNP Paribas Cardif S.A.<br>6,000 % éch. 07/11/2035                               | 2 600                               | 2 620                     |
| ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.<br>3,750 % éch. 11/06/2030  | 3 200                               | 3 194                 | IGT Lottery Holdings BV<br>4,250 % éch. 15/03/2030                               | 2 400                               | 2 412                     |
| Stellantis NV<br>6,250 % éch. 16/03/2031                                     | 3 200                               | 3 177                 | Telefonica Emisiones S.A.<br>1,000 % éch. 31/12/2099                             | 2 500                               | 2 412                     |
| Rakuten Group, Inc.<br>4,250 % éch. 22/04/2027                               | 3 200                               | 3 158                 | CAB SELAS<br>3,375 % éch. 01/02/2028                                             | 2 500                               | 2 408                     |
| Vodafone Group PLC<br>8,000 % éch. 30/08/2086                                | £ 2 500                             | 3 058                 | Avis Budget Finance PLC<br>7,000 % éch. 28/02/2029                               | 2 400                               | 2 348                     |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH<br>6,750 % éch. 15/02/2032                     | € 2 900                             | 2 892                 | SPIE S.A.<br>3,875 % éch. 18/05/2031                                             | 2 300                               | 2 284                     |
| Stellantis NV<br>6,875 % éch. 16/12/2033                                     | 2 900                               | 2 878                 | Toronto-Dominion Bank<br>8,125 % éch. 31/10/2082                                 | \$ 2 500                            | 2 280                     |
| SoftBank Group Corp.<br>8,250 % éch. 22/10/2031                              | \$ 3 200                            | 2 857                 | Altice France S.A.<br>10,860 % éch. 31/05/2031                                   | 2 592                               | 2 258                     |
| CPI Property Group S.A.<br>4,750 % éch. 22/07/2030                           | € 3 000                             | 2 854                 | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                           | 2 660                               | 2 230                     |
| CoreWeave, Inc.<br>8,500 % éch. 15/07/2032                                   | 2 800                               | 2 810                 | DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH<br>4,875 % éch. 21/08/2030 | € 2 200                             | 2 218                     |
| LSF12 Pillar Investments US, Inc.<br>5,750 % éch. 15/05/2033                 | 2 800                               | 2 800                 | VZ Secured Financing BV<br>3,500 % éch. 15/01/2032                               | 2 400                               | 2 202                     |
| Telefonica Europe BV<br>5,752 % éch. 15/01/2032                              | 2 700                               | 2 779                 | Ubisoft Entertainment S.A.<br>0,878 % éch. 24/11/2027                            | 2 600                               | 2 175                     |
| Mahle GmbH<br>7,125 % éch. 15/07/2032                                        | 2 600                               | 2 717                 | BCP Modular Services Finance PLC<br>4,750 % éch. 30/11/2028                      | 2 300                               | 2 171                     |
| Alexandrite Monnet UK Holdco PLC<br>6,875 % éch. 31/05/2031                  | 2 700                               | 2 700                 | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                  | \$ 2 390                            | 2 145                     |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC<br>3,250 % éch. 01/09/2028            | \$ 3 225                            | 2 617                 | Kronos International, Inc.<br>9,500 % éch. 15/03/2029                            | € 2 239                             | 2 060                     |
|                                                                              |                                     |                       | CPI Property Group S.A.<br>6,000 % éch. 27/01/2032                               | 1 900                               | 1 931                     |
|                                                                              |                                     |                       | Tereos Finance Groupe S.A.<br>4,750 % éch. 30/04/2027                            | 1 900                               | 1 904                     |
|                                                                              |                                     |                       | United Group BV<br>3,625 % éch. 15/02/2028                                       | 1 900                               | 1 895                     |
|                                                                              |                                     |                       | ZF Finance GmbH<br>3,750 % éch. 21/09/2028                                       | 1 900                               | 1 859                     |
|                                                                              |                                     |                       | CPI Property Group S.A.<br>4,875 % éch. 18/08/2026                               | 1 800                               | 1 785                     |
|                                                                              |                                     |                       | International Personal Finance PLC<br>10,750 % éch. 14/12/2029                   | 1 700                               | 1 771                     |
|                                                                              |                                     |                       | Vmed O2 UK Financing PLC<br>4,000 % éch. 31/01/2029                              | £ 1 600                             | 1 762                     |
|                                                                              |                                     |                       | Cheplapharm Arzneimittel GmbH<br>7,125 % éch. 15/06/2031                         | € 1 700                             | 1 743                     |
|                                                                              |                                     |                       | BlueNord ASA<br>12,000 % éch. 10/07/2085                                         | \$ 1 800                            | 1 657                     |

(a) Le Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                     |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)                        | 1 294 967                           | € 138 431             | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 2 228 504                           | € 238 001                 |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 6 650 507                           | 66 506                    |
|                                                                                       |                                     |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,100 % éch. 15/08/2031                          | € 92 742                            | 94 036                | Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | £ 39 500                            | 45 417                    |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,400 % éch. 15/05/2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | € 40 527                            | 40 072                    |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)          | 6 650 507                           | 66 505                | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2026 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                   | \$ 35 274                           | 30 697                    |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,100 % éch. 15/08/2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | € 29 913                            | 30 310                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                  | £ 48 600                            | 56 247                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>4,100 % éch. 01/02/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 21 900                              | 22 964                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,087 % éch. 15/04/2029                          | € 51 900                            | 52 416                | Bon du Trésor britannique<br>1,500 % éch. 22/07/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | £ 19 300                            | 21 932                    |
| Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035                                           | 44 500                              | 45 118                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | € 21 000                            | 21 558                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | 42 300                              | 43 988                | Union européenne<br>4,000 % éch. 12/10/2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 21 100                              | 20 400                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,000 % éch. 22/10/2031                                  | £ 36 400                            | 41 386                | Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 07/03/2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | £ 13 200                            | 15 252                    |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>0,100 % éch. 25/07/2031         | € 40 772                            | 39 650                | Union européenne<br>3,125 % éch. 05/12/2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | € 14 500                            | 14 577                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,400 % éch. 15/05/2030                          | 39 997                              | 39 476                | Fonds européen de stabilité financière<br>2,625 % éch. 16/07/2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 13 900                              | 13 736                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,400 % éch. 15/03/2029                          | 36 100                              | 35 927                | Obligation internationale du gouvernement néerlandais<br>2,500 % éch. 15/01/2030                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 13 600                              | 13 713                    |
| Obligation internationale du gouvernement australien<br>1,500 % éch. 21/06/2031       | AUD 57 000                          | 28 869                | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,394 % éch. 15/10/2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 12 600                              | 12 976                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,850 % éch. 01/02/2031                          | € 27 400                            | 27 693                | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>2,625 % éch. 10/01/2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 13 300                              | 12 743                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                          | 25 000                              | 25 856                | Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,200 % éch. 31/10/2035                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 12 200                              | 12 040                    |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,100 % éch. 30/07/2031         | 21 800                              | 22 203                | Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>4,200 % éch. 31/01/2037                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 10 900                              | 11 577                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                          | 21 000                              | 21 834                | Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | £ 9 900                             | 10 579                    |
| Obligation internationale du gouvernement slovène<br>3,275 % éch. 12/03/2036          | 18 050                              | 18 120                | République d'Allemagne<br>2,200 % éch. 15/02/2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | € 9 800                             | 9 242                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/10/2055                                                 | \$ 20 500                           | 16 284                | Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/06/2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | \$ 10 822                           | 8 621                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,375 % éch. 15/07/2027 (b) | 17 894                              | 15 384                | Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/10/2054                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 10 695                              | 8 495                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/01/2056                                                 | 18 900                              | 15 056                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,125 % éch. 15/10/2030 (b) | 15 142                              | 13 046                | (a) Le Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                     |                           |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                           | 14 900                              | 12 883                | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>4,125 % éch. 12/01/2029         | 14 600                              | 12 470                | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. |                                     |                           |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.                       |                                     |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro Government Bond UCITS ETF                 | 493 941                             | 12 312                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>4,200 % éch. 31/01/2037         | € 10 900                            | 11 592                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                     |                           |

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Advantage Fund

| DESCRIPTION                                                                         | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                 |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)     | 9 950 179                           | \$ 99 233             |
|                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/09/2055                                               | \$ 16 900                           | 17 486                |
| Ginnie Mae<br>3,000 % éch. 20/11/2055                                               | 13 400                              | 12 034                |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | COP 26 759 600                      | 7 558                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | 26 759 600                          | 7 105                 |
| Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                | £ 5 400                             | 7 090                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | COP 26 759 600                      | 6 791                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | 26 759 600                          | 6 741                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | 26 759 600                          | 6 650                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | 26 759 600                          | 6 635                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035      | 26 759 600                          | 6 516                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030      | 26 065 200                          | 6 403                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030      | 26 065 200                          | 5 990                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 19/09/2030      | 26 065 200                          | 5 900                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030      | 26 065 200                          | 5 869                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030      | 26 065 200                          | 5 726                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030      | 26 065 200                          | 5 674                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030      | 26 065 200                          | 5 610                 |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>2,750 % éch. 25/02/2029       | € 3 400                             | 4 065                 |
|                                                                                     | ACTIONS                             |                       |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Global Government Bond UCITS ETF (g)         | 150 000                             | 3 767                 |
|                                                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien<br>4,875 % éch. 23/04/2033      | € 3 100                             | 3 624                 |
|                                                                                     | ACTIONS                             |                       |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Bond Opportunities Fund (g) | 327 056                             | 3 300                 |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 10 518 591                          | \$ 104 900                |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/09/2055                                           | \$ 16 900                           | 17 502                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 07/03/2030                            | £ 6 600                             | 8 786                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | COP 26 759 600                      | 7 570                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 26 759 600                          | 7 085                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 26 759 600                          | 6 955                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 26 759 600                          | 6 780                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 26 759 600                          | 6 579                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 26 759 600                          | 6 425                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 19/09/2030  | 26 065 200                          | 6 413                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 26 759 600                          | 6 224                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 26 065 200                          | 5 961                     |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>3,000 % éch. 01/06/2034   | CAD 8 200                           | 5 923                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | COP 26 065 200                      | 5 919                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 26 065 200                          | 5 836                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 26 065 200                          | 5 670                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 26 065 200                          | 5 523                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 26 065 200                          | 5 432                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>2,750 % éch. 25/02/2029   | € 3 400                             | 3 980                     |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>0,000 % éch. 31/01/2028   | 3 500                               | 3 942                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>2,750 % éch. 25/10/2027   | 2 650                               | 3 161                     |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>0,750 % éch. 25/02/2028   | 2 750                               | 3 160                     |

(a) Le Fonds Global Advantage Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 937 772 323 \$                      | 9 352 231             |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 20/08/2055                                                         | \$ 581 328                          | 601 493               |
| Obligation internationale du gouvernement français                              |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 25/02/2029                                                         | € 220 600                           | 263 608               |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                               |                                     |                       |
| 3,400 % éch. 01/04/2028                                                         | 206 300                             | 247 105               |
| Banque de développement chinoise                                                |                                     |                       |
| 2,630 % éch. 08/01/2034                                                         | CNY 918 400                         | 139 007               |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/03/2055                                                         | \$ 148 853                          | 136 851               |
| Union européenne                                                                |                                     |                       |
| 3,375 % éch. 12/12/2035                                                         | € 109 715                           | 131 121               |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | \$ 130 300                          | 129 183               |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais                           |                                     |                       |
| 2,700 % éch. 17/06/2040                                                         | THB 3 847 400                       | 122 611               |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/01/2055                                                         | \$ 110 065                          | 102 120               |
| Obligation internationale du gouvernement canadien                              |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 01/03/2031                                                         | CAD 136 900                         | 97 341                |
| QNB Finance Ltd.                                                                |                                     |                       |
| 4,538 % éch. 19/09/2027                                                         | \$ 91 900                           | 91 555                |
| RD Michigan Property Owner LLC                                                  |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                                         | 89 000                              | 84 305                |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol                              |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 31/05/2029                                                         | € 65 500                            | 79 801                |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 20/07/2055                                                         | \$ 72 472                           | 74 986                |
| Valerie Asset Ltd.                                                              |                                     |                       |
| 5,219 % éch. 15/09/2050                                                         | 74 451                              | 72 742                |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais                           |                                     |                       |
| 1,840 % éch. 17/05/2036                                                         | THB 2 215 900                       | 70 411                |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/10/2054                                                         | \$ 74 247                           | 68 424                |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/05/2055                                                         | 73 100                              | 67 823                |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien                              |                                     |                       |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                                                         | PEN 199 190                         | 61 100                |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 941 037 398 \$                      | 9 384 800                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 20/08/2055                                                         | \$ 581 328                          | 602 038                   |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                               |                                     |                           |
| 2,100 % éch. 26/08/2027                                                         | € 286 500                           | 334 770                   |
| Obligation internationale du gouvernement français                              |                                     |                           |
| 2,750 % éch. 25/10/2027                                                         | 197 250                             | 235 332                   |
| Obligation internationale du gouvernement français                              |                                     |                           |
| 0,750 % éch. 25/02/2028                                                         | 144 250                             | 165 745                   |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol                              |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 31/01/2028                                                         | 130 700                             | 147 097                   |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/07/2055                                                         | \$ 150 055                          | 139 223                   |
| Obligation internationale du gouvernement chinois                               |                                     |                           |
| 1,650 % éch. 15/05/2035                                                         | CNY 824 300                         | 117 299                   |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/11/2054                                                         | \$ 116 093                          | 106 660                   |
| Obligation internationale du gouvernement canadien                              |                                     |                           |
| 2,750 % éch. 01/03/2031                                                         | CAD 136 900                         | 97 323                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/12/2053                                                         | \$ 93 356                           | 96 959                    |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | 90 960                              | 89 283                    |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais                           |                                     |                           |
| 2,500 % éch. 17/11/2029                                                         | THB 2 355 170                       | 78 810                    |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 20/07/2055                                                         | \$ 72 472                           | 75 054                    |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais                           |                                     |                           |
| 1,840 % éch. 17/05/2036                                                         | THB 2 215 900                       | 68 700                    |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/06/2055                                                         | \$ 72 836                           | 67 578                    |
| Union européenne                                                                |                                     |                           |
| 3,375 % éch. 12/12/2035                                                         | € 56 100                            | 66 301                    |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/12/2054                                                         | \$ 61 120                           | 56 326                    |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/04/2055                                                         | 44 475                              | 41 265                    |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/10/2054                                                         | 40 874                              | 37 553                    |

(a) Le Fonds Global Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                                           |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                   |     |                                     |                       |
| Ginnie Mae                                            |     |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 20/08/2055                               | \$  | 155 000                             | \$ 160 377            |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                     |     |                                     |                       |
| 3,400 % éch. 01/04/2028                               | €   | 49 700                              | 59 567                |
| Obligation internationale du gouvernement français    |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 25/02/2029                               |     | 31 100                              | 37 178                |
| Banque de développement chinoise                      |     |                                     |                       |
| 2,630 % éch. 08/01/2034                               | CNY | 222 300                             | 33 647                |
| Billets du Trésor américain                           |     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                               | \$  | 30 000                              | 29 716                |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais |     |                                     |                       |
| 2,700 % éch. 17/06/2040                               | THB | 907 600                             | 29 003                |
| New South Wales Treasury Corp.                        |     |                                     |                       |
| 2,500 % éch. 22/11/2032                               | AUD | 45 700                              | 27 938                |
| Mizuho Financial Group, Inc.                          |     |                                     |                       |
| 3,210 % éch. 16/05/2032                               | €   | 21 800                              | 25 969                |
| Ginnie Mae                                            |     |                                     |                       |
| 3,000 % éch. 20/04/2052                               | \$  | 26 000                              | 23 315                |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol    |     |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 31/05/2029                               | €   | 16 700                              | 20 354                |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien    |     |                                     |                       |
| 6,850 % éch. 12/08/2035                               | PEN | 63 200                              | 19 194                |
| RD Michigan Property Owner LLC                        |     |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                               | \$  | 20 000                              | 18 945                |
| <b>ACTIONS</b>                                        |     |                                     |                       |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro           |     |                                     |                       |
| Government Bond UCITS ETF                             |     | 630 000                             | 18 396                |
| <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>          |     |                                     |                       |
| Treasury Corp. of Victoria                            |     |                                     |                       |
| 2,000 % éch. 17/09/2035                               | AUD | 29 400                              | 15 654                |
| Obligation internationale du gouvernement canadien    |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 01/03/2031                               | CAD | 21 500                              | 15 287                |
| Morgan Stanley                                        |     |                                     |                       |
| 3,383 % éch. 23/01/2032                               | €   | 12 400                              | 14 543                |
| Treasury Corp. of Victoria                            |     |                                     |                       |
| 2,000 % éch. 20/11/2037                               | AUD | 29 500                              | 14 519                |
| Obligation internationale du gouvernement qatari      |     |                                     |                       |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                               | \$  | 14 800                              | 14 513                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                     |     |                                     |                       |
| 3,150 % éch. 15/03/2033                               | €   | 11 700                              | 13 636                |
| OCP Euro CLO DAC                                      |     |                                     |                       |
| 3,156 % éch. 20/04/2035                               |     | 11 300                              | 13 397                |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais |     |                                     |                       |
| 1,840 % éch. 17/05/2036                               | THB | 382 640                             | 12 166                |
| SR-Boligkredit A/S                                    |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 27/02/2033                               | €   | 9 500                               | 11 201                |
| ICG Euro CLO DAC                                      |     |                                     |                       |
| 3,455 % éch. 26/01/2038                               |     | 9 400                               | 11 110                |
| Central Nippon Expressway Co. Ltd.                    |     |                                     |                       |
| 4,124 % éch. 25/02/2031                               | \$  | 10 800                              | 10 800                |
| Obligation internationale du gouvernement du Koweït   |     |                                     |                       |
| 4,804 % éch. 20/04/2033                               |     | 10 500                              | 10 500                |
| Westpac Banking Corp.                                 |     |                                     |                       |
| 3,038 % éch. 01/03/2030                               | €   | 9 000                               | 10 417                |
| Ares European CLO DAC                                 |     |                                     |                       |
| 3,512 % éch. 15/07/2037                               |     | 9 000                               | 10 403                |
| Émirat d'Abu Dhabi                                    |     |                                     |                       |
| 4,625 % éch. 20/04/2033                               | \$  | 10 400                              | 10 334                |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC                    |     |                                     |                       |
| 5,527 % éch. 15/03/2061                               | £   | 7 639                               | 10 200                |
| National Bank of Canada                               |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 20/01/2031                               | €   | 8 700                               | 10 126                |
| ING Bank NV                                           |     |                                     |                       |
| 3,125 % éch. 08/04/2031                               |     | 8 800                               | 10 055                |
| Bank of Nova Scotia                                   |     |                                     |                       |
| 3,084 % éch. 17/06/2030                               |     | 8 600                               | 9 935                 |
| Sagax AB                                              |     |                                     |                       |
| 3,375 % éch. 26/01/2031                               |     | 8 600                               | 9 926                 |
| Freddie Mac                                           |     |                                     |                       |
| 5,078 % éch. 25/06/2055                               | \$  | 9 789                               | 9 868                 |
| Capital Four CLO DAC                                  |     |                                     |                       |
| 3,394 % éch. 15/04/2038                               | €   | 8 300                               | 9 835                 |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien   |     |                                     |                       |
| 4,875 % éch. 23/04/2033                               |     | 8 400                               | 9 821                 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                     |     |                                     |                       |
| 3,300 % éch. 15/06/2033                               |     | 8 600                               | 9 804                 |
| NTT Finance Corp.                                     |     |                                     |                       |
| 4,665 % éch. 20/06/2031                               | \$  | 9 700                               | 9 700                 |

| DESCRIPTION                                               |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                       |     |                                     |                       |
| Ginnie Mae                                                |     |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 20/08/2055                                   | \$  | 155 000                             | \$ 160 522            |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                         |     |                                     |                       |
| 2,100 % éch. 26/08/2027                                   | €   | 69 000                              | 80 677                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                         |     |                                     |                       |
| 3,400 % éch. 01/04/2028                                   |     | 49 700                              | 58 096                |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol        |     |                                     |                       |
| 0,000 % éch. 31/01/2028                                   |     | 32 150                              | 36 204                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |     |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 01/11/2053                                   | \$  | 29 533                              | 30 673                |
| Obligation internationale du gouvernement français        |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 25/10/2027                                   | €   | 24 700                              | 29 469                |
| Obligation internationale du gouvernement français        |     |                                     |                       |
| 0,750 % éch. 25/02/2028                                   |     | 24 800                              | 28 496                |
| Obligation internationale du gouvernement chinois         |     |                                     |                       |
| 1,650 % éch. 15/05/2035                                   | CNY | 199 500                             | 28 389                |
| Development Bank of Japan, Inc.                           |     |                                     |                       |
| 2,125 % éch. 01/09/2026                                   | €   | 19 200                              | 22 696                |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais     |     |                                     |                       |
| 2,500 % éch. 17/11/2029                                   | THB | 609 880                             | 20 408                |
| Billets du Trésor américain                               |     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                   | \$  | 20 440                              | 20 063                |
| KEB Hana Bank                                             |     |                                     |                       |
| 3,750 % éch. 04/05/2026                                   | €   | 16 200                              | 18 853                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |     |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 01/12/2053                                   | \$  | 17 645                              | 18 326                |
| Queensland Treasury Corp.                                 |     |                                     |                       |
| 5,250 % éch. 21/07/2036                                   | AUD | 26 000                              | 18 281                |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                           |     |                                     |                       |
| 0,010 % éch. 05/05/2027                                   | €   | 16 000                              | 18 096                |
| Union européenne                                          |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 13/12/2032                                   |     | 15 400                              | 17 955                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |     |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 01/11/2053                                   | \$  | 16 966                              | 17 634                |
| Queensland Treasury Corp.                                 |     |                                     |                       |
| 4,500 % éch. 22/08/2035                                   | AUD | 25 900                              | 17 305                |
| Obligation internationale du gouvernement canadien        |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 01/03/2031                                   | CAD | 21 500                              | 15 285                |
| Obligation internationale du gouvernement qatari          |     |                                     |                       |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                   | \$  | 14 800                              | 14 866                |
| Morgan Stanley                                            |     |                                     |                       |
| 3,622 % éch. 01/04/2031                                   |     | 14 700                              | 14 132                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                         |     |                                     |                       |
| 3,250 % éch. 15/11/2032                                   | €   | 11 800                              | 13 895                |
| Queensland Treasury Corp.                                 |     |                                     |                       |
| 1,750 % éch. 20/07/2034                                   | AUD | 25 200                              | 13 661                |
| Obligation internationale du gouvernement polonais        |     |                                     |                       |
| 3,875 % éch. 07/07/2037                                   | €   | 10 600                              | 12 360                |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais     |     |                                     |                       |
| 1,840 % éch. 17/05/2036                                   | THB | 382 640                             | 12 139                |
| Obligation internationale du gouvernement canadien        |     |                                     |                       |
| 3,000 % éch. 01/06/2034                                   | CAD | 17 100                              | 11 972                |
| Toronto-Dominion Bank                                     |     |                                     |                       |
| 3,563 % éch. 16/04/2031                                   | €   | 9 000                               | 10 794                |
| Toronto-Dominion Bank                                     |     |                                     |                       |
| 3,355 % éch. 16/02/2027                                   |     | 8 900                               | 10 267                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                         |     |                                     |                       |
| 3,150 % éch. 15/03/2033                                   |     | 8 900                               | 10 093                |
| RELX Capital, Inc.                                        |     |                                     |                       |
| 5,250 % éch. 27/03/2035                                   | \$  | 9 900                               | 10 091                |

(a) Le Fonds Global Bond ESG Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Bond Ex-US Fund

| DESCRIPTION                                                                      | ACTIONS                                      | COÛT<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                              |                                              |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 19 210 676 \$                                | 191 581               |
|                                                                                  | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                       |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/08/2055                                            | \$ 36 500                                    | 37 766                |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/01/2056                                            | 28 600                                       | 26 503                |
| Ginnie Mae<br>3,000 % éch. 20/06/2052                                            | 15 000                                       | 13 471                |
| Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035                                      | € 7 400                                      | 8 867                 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>2,700 % éch. 17/06/2040 | THB 274 100                                  | 8 813                 |
|                                                                                  | <b>ACTIONS</b>                               |                       |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro Government Bond UCITS ETF            | 300 000                                      | 8 773                 |
|                                                                                  | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                       |
| Banque de développement chinoise<br>2,630 % éch. 08/01/2034                      | CNY 56 400                                   | 8 537                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                           | \$ 7 900                                     | 7 827                 |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/11/2055                                            | 7 000                                        | 6 431                 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>1,840 % éch. 17/05/2036 | THB 194 351                                  | 6 175                 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,500 % éch. 31/05/2029    | € 4 600                                      | 5 604                 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,850 % éch. 12/08/2035    | PEN 17 600                                   | 5 330                 |
| Aldbrook Mortgage Transaction PLC<br>4,587 % éch. 18/02/2068                     | £ 4 000                                      | 5 292                 |
| Hops Hill PLC<br>4,570 % éch. 21/06/2058                                         | 4 000                                        | 5 292                 |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                      | \$ 5 200                                     | 5 181                 |
| Toro European CLO DAC<br>3,474 % éch. 15/04/2037                                 | € 4 400                                      | 5 103                 |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                        | \$ 5 300                                     | 5 020                 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>2,750 % éch. 01/03/2031    | CAD 5 800                                    | 4 124                 |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033      | \$ 4 000                                     | 3 922                 |

| DESCRIPTION                                                                          | ACTIONS                                      | PRODUITS<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |                                              |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 23 894 663 \$                                | 238 300                   |
|                                                                                      | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                           |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/08/2055                                                | \$ 36 500                                    | 37 800                    |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/06/2055                                                | 19 676                                       | 18 256                    |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>2,500 % éch. 17/11/2029     | THB 290 370                                  | 9 716                     |
| Obligation internationale du gouvernement chinois<br>1,650 % éch. 15/05/2035         | CNY 67 800                                   | 9 704                     |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>0,000 % éch. 31/01/2028        | € 8 050                                      | 9 066                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                               | \$ 6 720                                     | 6 601                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/11/2054                                                | 7 003                                        | 6 434                     |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>3,000 % éch. 01/06/2034        | CAD 8 800                                    | 6 155                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>1,840 % éch. 17/05/2036     | THB 194 351                                  | 6 088                     |
| Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035                                          | € 4 400                                      | 5 163                     |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>2,750 % éch. 01/03/2031        | CAD 5 800                                    | 4 123                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/07/2055                                                | \$ 4 420                                     | 4 101                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/10/2054                                                | 3 598                                        | 3 305                     |
| JPMorgan Chase & Co.<br>6,070 % éch. 22/10/2027                                      | 3 000                                        | 3 044                     |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>2,500 % éch. 31/05/2027        | € 2 300                                      | 2 751                     |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 07/03/2030                                 | £ 2 000                                      | 2 723                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>2,980 % éch. 17/06/2045     | THB 84 878                                   | 2 553                     |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais<br>3,775 % éch. 25/06/2032     | 68 870                                       | 2 462                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,000 % éch. 01/06/2054 | \$ 2 296                                     | 2 348                     |

(a) Le Fonds Global Bond Ex-US Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



| DESCRIPTION                                            |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                    |     |                                     |                       |
| TES colombien                                          |     |                                     |                       |
| 12,500 % éch. 27/02/2030                               | COP | 1 685 500                           | \$ 483                |
| Bon du Trésor britannique                              |     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 07/03/2031                                | £   | 350                                 | 461                   |
| Obligation internationale du gouvernement français     |     |                                     |                       |
| 0,750 % éch. 25/02/2028                                | €   | 400                                 | 445                   |
| Obligations du Trésor américain                        |     |                                     |                       |
| 4,625 % éch. 15/02/2046                                | \$  | 358                                 | 344                   |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien     |     |                                     |                       |
| 7,300 % éch. 12/08/2033                                | PEN | 1 000                               | 332                   |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |     |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                | ZAR | 5 150                               | 311                   |
| Obligations du Trésor américain                        |     |                                     |                       |
| 5,000 % éch. 15/05/2056                                | \$  | 306                                 | 310                   |
| Billets du Trésor américain                            |     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 31/05/2031                                |     | 300                                 | 298                   |
| Obligation internationale du gouvernement israélien    |     |                                     |                       |
| 1,500 % éch. 16/01/2029                                | €   | 260                                 | 286                   |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol     |     |                                     |                       |
| 3,150 % éch. 30/04/2035                                |     | 250                                 | 284                   |
| Gaci First Investment Co.                              |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 14/10/2028                                |     | 250                                 | 283                   |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol     |     |                                     |                       |
| 2,400 % éch. 31/05/2028                                |     | 220                                 | 252                   |
| Treasury Corp. of Victoria                             |     |                                     |                       |
| 1,500 % éch. 10/09/2031                                | AUD | 400                                 | 237                   |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                      |     |                                     |                       |
| 2,850 % éch. 01/02/2031                                | €   | 200                                 | 228                   |
| Obligation internationale du gouvernement polonais     |     |                                     |                       |
| 4,875 % éch. 12/02/2030                                | \$  | 210                                 | 213                   |
| Billets du Trésor américain                            |     |                                     |                       |
| 4,375 % éch. 15/05/2036                                |     | 200                                 | 198                   |
| Billets du Trésor américain                            |     |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 31/05/2028                                |     | 150                                 | 150                   |
| New South Wales Treasury Corp.                         |     |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/11/2037                                | AUD | 250                                 | 145                   |
| Obligation internationale du gouvernement français     |     |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 25/02/2029                                | €   | 120                                 | 138                   |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois     |     |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 25/07/2029                                |     | 110                                 | 129                   |
| Union européenne                                       |     |                                     |                       |
| 3,250 % éch. 12/12/2036                                |     | 100                                 | 113                   |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                      |     |                                     |                       |
| 3,450 % éch. 01/02/2036                                |     | 100                                 | 112                   |
| Obligations du Trésor américain                        |     |                                     |                       |
| 1,875 % éch. 15/02/2041                                | \$  | 162                                 | 112                   |
| Morgan Stanley                                         |     |                                     |                       |
| 5,664 % éch. 17/04/2036                                |     | 76                                  | 78                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.                              |     |                                     |                       |
| 5,065 % éch. 21/01/2037                                |     | 76                                  | 74                    |
| Obligation internationale du gouvernement japonais     |     |                                     |                       |
| 0,400 % éch. 20/06/2040                                | ¥   | 17 200                              | 74                    |
| Bank of America Corp.                                  |     |                                     |                       |
| 4,456 % éch. 06/02/2032                                | \$  | 75                                  | 74                    |
| Wells Fargo & Co.                                      |     |                                     |                       |
| 4,960 % éch. 23/01/2037                                |     | 70                                  | 68                    |

| DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                     |                           |
| Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. |                                     |                           |
| Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.                       |                                     |                           |

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global High Yield Bond Fund

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                       |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                     |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036    | \$ 21 225                           | € 20 937              | Medline Borrower LP<br>3,875 % éch. 01/04/2029                                     | \$ 20 600                           | € 20 237                  |
| Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 31/03/2028    | 19 225                              | 19 260                | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                             | 20 590                              | 20 210                    |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045 | 20 150                              | 19 087                | Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035                             | 17 695                              | 17 674                    |
| ams-OSRAM AG<br>7,250 % éch. 31/05/2032                   | € 14 420                            | 16 695                | INEOS U.S. Finance LLC<br>6,966 % éch. 18/02/2030                                  | 18 603                              | 16 682                    |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035    | \$ 16 500                           | 16 531                | Billets du Trésor américain<br>3,761 % éch. 31/07/2027                             | 15 800                              | 15 821                    |
| Var Energi ASA<br>4,950 % éch. 29/04/2086                 | € 10 400                            | 12 105                | Albion Financing 1 SARL<br>7,000 % éch. 21/05/2030                                 | 15 025                              | 15 352                    |
| CCO Holdings LLC<br>4,750 % éch. 01/02/2032               | \$ 12 300                           | 11 285                | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                    | 13 625                              | 14 150                    |
| B.C. Ltd.<br>10,000 % éch. 15/04/2032                     | 10 550                              | 10 936                | CCO Holdings LLC<br>5,000 % éch. 01/02/2028                                        | 12 700                              | 12 573                    |
| Albertsons Cos., Inc.<br>5,625 % éch. 31/03/2032          | 10 400                              | 10 400                | Bayer AG<br>7,000 % éch. 25/09/2083                                                | € 10 000                            | 12 242                    |
| Standard Industries, Inc.<br>4,750 % éch. 15/01/2028      | 8 875                               | 8 826                 | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                          | \$ 12 125                           | 12 145                    |
| Maxam Prill SARL<br>6,000 % éch. 15/07/2030               | € 7 100                             | 8 447                 | Cordia Finanz GmbH<br>9,375 % éch. 03/10/2031                                      | 11 775                              | 10 978                    |
| LBM Acquisition LLC<br>6,250 % éch. 15/01/2029            | \$ 8 925                            | 8 304                 | Albertsons Cos., Inc.<br>5,625 % éch. 31/03/2032                                   | 10 400                              | 10 194                    |
| Gg12 SpA<br>6,250 % éch. 28/04/2033                       | € 6 600                             | 7 788                 | CCO Holdings LLC<br>5,375 % éch. 01/06/2029                                        | 9 650                               | 9 541                     |
| Coherent Corp.<br>5,000 % éch. 15/12/2029                 | \$ 7 875                            | 7 782                 | <b>ACTIONS</b>                                                                     |                                     |                           |
| Sirius XM Radio LLC<br>5,875 % éch. 15/04/2032            | 7 700                               | 7 690                 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) | 912 496                             | 9 100                     |
| New Immo Holding S.A.<br>5,500 % éch. 23/04/2031          | € 6 400                             | 7 550                 | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>                                       |                                     |                           |
| PacifiCorp<br>7,125 % éch. 15/08/2056                     | \$ 7 150                            | 7 150                 | Block, Inc.<br>3,500 % éch. 01/06/2031                                             | \$ 8 950                            | 8 134                     |
| Tutor Perini Corp.<br>6,625 % éch. 15/07/2033             | 7 007                               | 7 014                 | Iron Mountain, Inc.<br>4,500 % éch. 15/02/2031                                     | 8 050                               | 7 645                     |
| Schaeffler AG<br>4,125 % éch. 13/05/2029                  | € 5 800                             | 6 825                 | B.C. Ltd.<br>10,000 % éch. 15/04/2032                                              | 7 300                               | 7 448                     |
| HomeVi SASU<br>6,625 % éch. 31/10/2031                    | 5 600                               | 6 641                 | Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % éch. 15/04/2032                                | € 6 725                             | 7 261                     |
|                                                           |                                     |                       | Seagate Data Storage Technology Pte Ltd.<br>5,875 % éch. 15/07/2030                | \$ 6 975                            | 7 182                     |
|                                                           |                                     |                       | Chord Energy Corp.<br>6,750 % éch. 15/03/2033                                      | 6 975                               | 7 179                     |

(a) Le Fonds Global High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global High Yield Bond ESG Fund

| DESCRIPTION                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                 |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                             |                                     |                           |
| Clearway Energy Operating LLC<br>3,750 % éch. 15/01/2032            | \$ 600                              | \$ 551                | Clearway Energy Operating LLC<br>3,750 % éch. 15/01/2032        | \$ 530                              | \$ 488                    |
| Axon Enterprise, Inc.<br>6,125 % éch. 15/03/2030                    | 400                                 | 415                   | Axon Enterprise, Inc.<br>6,125 % éch. 15/03/2030                | 410                                 | 424                       |
| ams-OSRAM AG<br>7,250 % éch. 31/05/2032                             | € 200                               | 236                   | BCP Modular Services Finance PLC<br>6,500 % éch. 10/07/2031     | € 200                               | 207                       |
| Schaeffler AG<br>5,000 % éch. 13/05/2033                            | 200                                 | 234                   | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036          | \$ 200                              | 196                       |
| SoftBank Group Corp.<br>8,250 % éch. 22/10/2031                     | \$ 200                              | 208                   | Tenet Healthcare Corp.<br>4,375 % éch. 15/01/2030               | 195                                 | 188                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036              | 210                                 | 207                   | Ball Corp.<br>2,875 % éch. 15/08/2030                           | 190                                 | 173                       |
| Centene Corp.<br>3,000 % éch. 15/10/2030                            | 225                                 | 202                   | JetBlue Airways Corp.<br>9,875 % éch. 20/09/2031                | 175                                 | 168                       |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045           | 200                                 | 189                   | IQVIA, Inc.<br>6,250 % éch. 01/06/2032                          | 150                                 | 154                       |
| SoftBank Group Corp.<br>7,000 % éch. 22/04/2032                     | € 150                               | 184                   | INEOS U.S. Finance LLC<br>6,966 % éch. 18/02/2030               | 175                                 | 151                       |
| Seagate Data Storage Technology Pte Ltd.<br>8,250 % éch. 15/12/2029 | \$ 175                              | 183                   | Avis Budget Car Rental LLC<br>4,750 % éch. 01/04/2028           | 150                                 | 146                       |
| Carnival Corp. Ltd.<br>5,125 % éch. 01/05/2029                      | 150                                 | 150                   | Novelis Sheet Ingot GmbH<br>3,375 % éch. 15/04/2029             | € 120                               | 139                       |
| DISH DBS Corp.<br>5,250 % éch. 01/12/2026                           | 150                                 | 149                   | CCO Holdings LLC<br>5,375 % éch. 01/06/2029                     | \$ 140                              | 138                       |
| Allied Universal Holdco LLC<br>4,625 % éch. 01/06/2028              | 150                                 | 148                   | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                 | 125                                 | 130                       |
| VZ Secured Financing BV<br>5,000 % éch. 15/01/2032                  | 160                                 | 144                   | ams-OSRAM AG<br>10,500 % éch. 30/03/2029                        | € 100                               | 126                       |
| Cloud Software Group, Inc.<br>6,500 % éch. 31/03/2029               | 140                                 | 139                   | IWG U.S. Finance LLC<br>6,500 % éch. 28/06/2030                 | 100                                 | 123                       |
| OneMain Finance Corp.<br>7,125 % éch. 15/11/2031                    | 125                                 | 127                   | Bayer AG<br>7,000 % éch. 25/09/2083                             | 100                                 | 122                       |
| Avis Budget Car Rental LLC<br>8,375 % éch. 15/06/2032               | 125                                 | 126                   | Iron Mountain, Inc.<br>4,500 % éch. 15/02/2031                  | \$ 126                              | 120                       |
| Univision Communications, Inc.<br>8,875 % éch. 15/04/2033           | 125                                 | 125                   | United Group BV<br>6,500 % éch. 31/10/2031                      | € 100                               | 120                       |
| Celsa Opco S.A.<br>8,250 % éch. 15/12/2030                          | € 100                               | 123                   | Crowdstrike Holdings, Inc.<br>3,000 % éch. 15/02/2029           | \$ 125                              | 119                       |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH<br>7,500 % éch. 15/05/2030            | 100                                 | 120                   | New Immo Holding S.A.<br>4,950 % éch. 14/11/2030                | € 100                               | 117                       |
| Maxam Prill SARL<br>6,000 % éch. 15/07/2030                         | 100                                 | 120                   | Service Corp. International<br>3,375 % éch. 15/08/2030          | \$ 125                              | 116                       |
| ZF Europe Finance BV<br>5,500 % éch. 17/02/2032                     | 100                                 | 119                   | CAB SELAS<br>3,375 % éch. 01/02/2028                            | € 100                               | 116                       |
| CAB SELAS<br>3,375 % éch. 01/02/2028                                | 100                                 | 116                   | Flora Food Management BV<br>6,875 % éch. 02/07/2029             | 100                                 | 113                       |
| Novelis Sheet Ingot GmbH<br>3,375 % éch. 15/04/2029                 | 100                                 | 116                   | Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % éch. 15/04/2032             | 100                                 | 113                       |
| Stellantis NV<br>6,250 % éch. 16/03/2031                            | 100                                 | 116                   | Cidron Aida Finco SARL<br>7,000 % éch. 27/10/2031               | 100                                 | 113                       |
| Stellantis NV<br>6,875 % éch. 16/12/2033                            | 100                                 | 116                   | RCI Banque S.A.<br>4,750 % éch. 24/03/2037                      | 100                                 | 112                       |
| Infrastrutture Wireless Italiana SpA<br>3,625 % éch. 13/10/2032     | 100                                 | 112                   | Aston Martin Capital Holdings Ltd.<br>10,375 % éch. 31/03/2029  | £ 100                               | 112                       |
| Citycon Treasury BV<br>5,000 % éch. 11/03/2030                      | 100                                 | 109                   | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045       | \$ 110                              | 110                       |
| ZF North America Capital, Inc.<br>7,500 % éch. 24/03/2031           | \$ 100                              | 101                   | United Rentals North America, Inc.<br>6,125 % éch. 15/03/2034   | 100                                 | 104                       |
|                                                                     |                                     |                       | DISH DBS Corp.<br>5,250 % éch. 01/12/2026                       | 100                                 | 99                        |
|                                                                     |                                     |                       | Organon & Co.<br>4,125 % éch. 30/04/2028                        | 100                                 | 98                        |
|                                                                     |                                     |                       | Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>4,750 % éch. 15/06/2029 | 100                                 | 98                        |
|                                                                     |                                     |                       | goeasy Ltd.<br>7,375 % éch. 01/10/2030                          | 100                                 | 92                        |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Investment Grade Credit Fund

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 85 601 537 \$                       | 853 690               |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | \$ 75 570                           | 74 828                |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                             | 56 200                              | 53 235                |
| Obligations du Trésor américain<br>1,750 % éch. 15/08/2041                            | 60 600                              | 41 982                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>2,375 % éch. 15/02/2056 (b) | 27 198                              | 25 364                |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2055                            | 23 900                              | 23 285                |
| Informa PLC<br>3,750 % éch. 29/04/2032                                                | € 17 400                            | 20 055                |
| BNP Paribas S.A.<br>4,892 % éch. 30/06/2030                                           | \$ 20 000                           | 20 000                |
| Nationwide Building Society<br>5,167 % éch. 12/12/2033                                | £ 14 200                            | 19 175                |
| Verisure Holding AB<br>4,125 % éch. 02/01/2032                                        | € 16 800                            | 19 123                |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                           | \$ 19 100                           | 19 028                |
| Obligations du Trésor américain<br>2,250 % éch. 15/05/2041                            | 25 500                              | 18 994                |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                             | COP 74 655 500                      | 18 721                |
| Société Générale S.A.<br>4,857 % éch. 07/07/2029                                      | \$ 18 700                           | 18 700                |
| Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 31/03/2031                                | 18 600                              | 18 537                |
| TES colombien<br>12,500 % éch. 27/02/2030                                             | COP 71 641 900                      | 17 910                |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>3,200 % éch. 20/09/2055         | ¥ 2 817 000                         | 17 203                |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien<br>4,000 % éch. 23/04/2030        | € 14 600                            | 17 075                |
| Simon Global Development BV<br>3,650 % éch. 15/06/2031                                | 14 500                              | 16 765                |
| Lloyds Banking Group PLC<br>4,241 % éch. 10/02/2030                                   | \$ 16 400                           | 16 400                |

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 91 297 489 \$                       | 910 500                   |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | \$ 75 570                           | 74 072                    |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2055                            | 74 200                              | 70 664                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,000 % éch. 01/01/2056  | 48 656                              | 47 306                    |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                             | COP 120 005 700                     | 31 715                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>2,375 % éch. 15/02/2056 (b) | \$ 27 374                           | 25 660                    |
| Bank of America N.A.<br>5,526 % éch. 18/08/2026                                       | 22 300                              | 22 384                    |
| AerCap Ireland Capital DAC<br>2,450 % éch. 29/10/2026                                 | 21 120                              | 20 883                    |
| Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 31/03/2031                                | 18 600                              | 18 570                    |
| Fannie Mae<br>6,625 % éch. 15/11/2030                                                 | 16 854                              | 18 469                    |
| TES colombien<br>12,500 % éch. 27/02/2030                                             | COP 56 270 700                      | 15 362                    |
| Kraft Heinz Foods Co.<br>4,375 % éch. 01/06/2046                                      | \$ 18 570                           | 14 879                    |
| ONEOK, Inc.<br>5,700 % éch. 01/11/2054                                                | 15 491                              | 14 639                    |
| Marvell Technology, Inc.<br>2,450 % éch. 15/04/2028                                   | 14 850                              | 14 332                    |
| Citigroup, Inc.<br>6,875 % éch. 31/12/2099                                            | 13 900                              | 14 245                    |
| T-Mobile USA, Inc.<br>2,050 % éch. 15/02/2028                                         | 14 740                              | 14 176                    |
| BNP Paribas S.A.<br>5,786 % éch. 13/01/2033                                           | 13 500                              | 13 979                    |
| Charles Schwab Corp.<br>6,196 % éch. 17/11/2029                                       | 13 300                              | 13 803                    |
| Mercedes-Benz Finance North America LLC<br>4,125 % éch. 10/03/2028                    | 13 500                              | 13 425                    |
| Werfen S.A.<br>4,625 % éch. 06/06/2028                                                | € 11 000                            | 13 140                    |

(a) Le Fonds Global Investment Grade Credit Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund

| DESCRIPTION                                            |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COUT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                    |     |                                     |                       |
| RD Michigan Property Owner LLC                         |     |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                | \$  | 11 600                              | \$ 10 988             |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien    |     |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 23/04/2030                                | €   | 8 200                               | 9 590                 |
| ING Groep NV                                           |     |                                     |                       |
| 3,125 % éch. 10/02/2032                                |     | 7 500                               | 8 799                 |
| Nova Securitisation SARL                               |     |                                     |                       |
| 5,750 % éch. 03/02/2031                                | \$  | 8 200                               | 8 156                 |
| Arcadis NV                                             |     |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 20/05/2031                                | €   | 6 700                               | 7 785                 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation |     |                                     |                       |
| 2,375 % éch. 15/02/2056 (a)                            | \$  | 7 115                               | 6 610                 |
| TES colombien                                          |     |                                     |                       |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                               | COP | 24 795 000                          | 6 517                 |
| Treasury Corp. of Victoria                             |     |                                     |                       |
| 2,000 % éch. 17/09/2035                                | AUD | 12 500                              | 6 466                 |
| South Australian Government Financing Authority        |     |                                     |                       |
| 4,750 % éch. 24/05/2035                                |     | 9 600                               | 6 395                 |
| Obligation du gouvernement australien                  |     |                                     |                       |
| 5,000 % éch. 21/06/2036                                |     | 9 000                               | 6 344                 |
| P3 Group SARL                                          |     |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 19/04/2032                                | €   | 5 275                               | 6 057                 |
| Latvenergo A/S                                         |     |                                     |                       |
| 4,162 % éch. 25/06/2033                                |     | 5 100                               | 5 920                 |
| TES colombien                                          |     |                                     |                       |
| 12,750 % éch. 28/11/2040                               | COP | 20 974 000                          | 5 846                 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais     |     |                                     |                       |
| 2,400 % éch. 20/03/2055                                | ¥   | 1 130 000                           | 5 841                 |
| BNP Paribas Cardif S.A.                                |     |                                     |                       |
| 6,125 % éch. 19/12/2033                                | €   | 4 900                               | 5 661                 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain |     |                                     |                       |
| 8,875 % éch. 28/02/2035                                | ZAR | 89 800                              | 5 622                 |
| Anglian Water Services Financing PLC                   |     |                                     |                       |
| 4,250 % éch. 23/06/2036                                | €   | 4 600                               | 5 292                 |
| SPIE S.A.                                              |     |                                     |                       |
| 3,875 % éch. 18/05/2031                                |     | 4 400                               | 5 156                 |
| CPI Property Group S.A.                                |     |                                     |                       |
| 6,875 % éch. 05/02/2033                                | £   | 3 800                               | 5 126                 |
| Freddie Mac                                            |     |                                     |                       |
| 4,498 % éch. 25/12/2055                                | \$  | 4 977                               | 4 994                 |

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                       |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement canadien        |                                     |                           |
| 2,250 % éch. 01/12/2029                                   | CAD 16 500                          | \$ 11 727                 |
| Mizuho Financial Group, Inc.                              |                                     |                           |
| 3,170 % éch. 11/09/2027                                   | \$ 8 126                            | 8 030                     |
| Veralto Corp.                                             |                                     |                           |
| 5,500 % éch. 18/09/2026                                   | 7 200                               | 7 249                     |
| NIBC Bank NV                                              |                                     |                           |
| 2,875 % éch. 24/01/2030                                   | € 5 900                             | 7 029                     |
| Oracle Corp.                                              |                                     |                           |
| 5,500 % éch. 03/08/2035                                   | \$ 7 000                            | 6 796                     |
| P3 Group SARL                                             |                                     |                           |
| 4,625 % éch. 13/02/2030                                   | € 5 275                             | 6 256                     |
| Corebridge Financial, Inc.                                |                                     |                           |
| 3,900 % éch. 05/04/2032                                   | \$ 6 150                            | 5 848                     |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien       |                                     |                           |
| 4,000 % éch. 23/04/2030                                   | € 5 000                             | 5 768                     |
| BNP Paribas S.A.                                          |                                     |                           |
| 5,906 % éch. 19/11/2035                                   | \$ 5 500                            | 5 596                     |
| Amgen, Inc.                                               |                                     |                           |
| 5,150 % éch. 02/03/2028                                   | 5 300                               | 5 366                     |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                           |                                     |                           |
| 2,625 % éch. 10/01/2034                                   | € 4 700                             | 5 364                     |
| Equinix Europe Financing Corp. LLC                        |                                     |                           |
| 3,250 % éch. 19/05/2029                                   | 4 100                               | 4 909                     |
| Citigroup, Inc.                                           |                                     |                           |
| 2,572 % éch. 03/06/2031                                   | \$ 5 300                            | 4 873                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 3,000 % éch. 01/07/2052                                   | 5 481                               | 4 814                     |
| ABN AMRO Bank NV                                          |                                     |                           |
| 3,000 % éch. 25/02/2031                                   | € 4 000                             | 4 776                     |
| Électricité de France S.A.                                |                                     |                           |
| 7,375 % éch. 17/06/2035                                   | £ 3 400                             | 4 758                     |
| Wabtec Transportation Netherlands BV                      |                                     |                           |
| 1,250 % éch. 03/12/2027                                   | € 4 200                             | 4 754                     |
| Keysight Technologies, Inc.                               |                                     |                           |
| 5,350 % éch. 30/07/2030                                   | \$ 4 600                            | 4 731                     |
| Sysco Corp.                                               |                                     |                           |
| 5,400 % éch. 23/03/2035                                   | 4 700                               | 4 728                     |
| Norsk Hydro ASA                                           |                                     |                           |
| 3,625 % éch. 23/01/2032                                   | € 3 900                             | 4 622                     |

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Low Duration Real Return Fund

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 43 388 094 \$                       | 432 702               |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,125 % éch. 15/10/2030 (b) | \$ 113 965                          | 113 179               |
| Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                  | £ 48 300                            | 65 195                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,625 % éch. 15/04/2030 (b) | \$ 53 388                           | 53 846                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | € 43 200                            | 52 980                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,375 % éch. 15/07/2027 (b) | \$ 49 779                           | 49 616                |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>4,200 % éch. 31/01/2037         | € 36 500                            | 45 764                |
| République d'Allemagne<br>0,500 % éch. 15/04/2030                                     | 38 026                              | 45 359                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                          | 31 500                              | 38 816                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,625 % éch. 15/10/2029 (b) | \$ 33 566                           | 34 241                |
| Obligation internationale du gouvernement australien<br>1,500 % éch. 21/06/2031       | AUD 56 900                          | 33 544                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,250 % éch. 15/04/2031 (b) | \$ 29 394                           | 28 869                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,400 % éch. 15/05/2030                          | € 24 240                            | 27 617                |
| Bon du Trésor britannique<br>4,000 % éch. 22/10/2031                                  | £ 20 300                            | 27 203                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/01/2032 (b) | \$ 24 695                           | 22 894                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,100 % éch. 15/08/2031                          | € 18 241                            | 21 339                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,850 % éch. 01/02/2031                          | 17 400                              | 20 754                |
| Bon du Trésor britannique<br>0,125 % éch. 10/08/2031                                  | £ 15 292                            | 19 843                |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>1,300 % éch. 20/09/2030         | ¥ 2 850 000                         | 17 713                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,250 % éch. 15/04/2028 (b) | \$ 17 212                           | 17 186                |
| Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                  | £ 14 000                            | 17 033                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                          | € 13 200                            | 16 177                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,250 % éch. 15/09/2032                          | 12 991                              | 15 297                |

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 43 467 678 \$                       | 433 500                   |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2026 (b) | \$ 77 292                           | 78 053                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | € 43 200                            | 50 686                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,125 % éch. 07/03/2031                                  | £ 35 300                            | 47 307                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                          | € 31 500                            | 36 838                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,400 % éch. 15/05/2030                          | 26 808                              | 30 731                    |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>4,200 % éch. 31/01/2037         | 19 800                              | 24 396                    |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>3,125 % éch. 10/10/2028                            | 18 400                              | 22 200                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,850 % éch. 01/02/2031                          | 17 400                              | 19 845                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                  | £ 14 000                            | 17 412                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,000 % éch. 01/03/2054  | \$ 16 068                           | 16 391                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,625 % éch. 15/10/2029 (b) | 15 977                              | 16 293                    |
| Fonds européen de stabilité financière<br>2,625 % éch. 16/07/2029                     | € 13 700                            | 15 753                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                          | 13 200                              | 15 600                    |
| Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035                                           | 10 500                              | 12 209                    |
| Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % éch. 01/10/2056                                    | DKK 75 964                          | 11 921                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,500 % éch. 07/06/2028                                  | £ 8 100                             | 10 709                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,394 % éch. 15/10/2031                          | € 8 600                             | 10 322                    |
| Fonds européen de stabilité financière<br>2,875 % éch. 13/02/2034                     | 8 600                               | 9 708                     |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>2,625 % éch. 10/01/2034                            | 8 000                               | 8 940                     |

(a) Le Fonds Global Low Duration Real Return Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Global Real Return Fund

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 36 154 664 \$                       | 360 568               |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,500 % éch. 31/01/2041         | € 61 700                            | 68 328                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | 53 500                              | 64 999                |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)                        | 509 269                             | 63 034                |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,875 % éch. 15/01/2036 (b) | \$ 53 372                           | 53 032                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                          | € 42 500                            | 51 777                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,125 % éch. 15/10/2030 (b) | \$ 41 664                           | 41 366                |
| Obligation internationale du gouvernement australien<br>1,500 % éch. 21/06/2031       | AUD 69 700                          | 41 346                |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>0,600 % éch. 25/07/2034         | € 35 963                            | 40 093                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,250 % éch. 15/07/2029 (b) | \$ 39 521                           | 38 421                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,400 % éch. 15/03/2029                          | € 30 100                            | 34 892                |
| Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                  | £ 27 000                            | 32 959                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2030 (b) | \$ 34 391                           | 32 741                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,250 % éch. 15/04/2031 (b) | 30 299                              | 29 765                |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>2,125 % éch. 15/01/2035 (b) | 25 465                              | 25 839                |
| Bon du Trésor britannique<br>0,750 % éch. 22/11/2033                                  | £ 17 769                            | 23 098                |
| Bon du Trésor britannique<br>2,000 % éch. 26/01/2035                                  | 7 100                               | 23 055                |
| Obligation internationale du gouvernement roumain<br>5,875 % éch. 11/07/2032          | € 17 700                            | 21 206                |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Advantage Euro Government Bond UCITS ETF                 | 710 556                             | 20 802                |
|                                                                                       | VALEUR NOMINALE<br>(en milliers)    |                       |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,450 % éch. 31/10/2034         | € 17 500                            | 20 441                |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>0,100 % éch. 10/03/2029         | ¥ 3 155 311                         | 20 113                |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>4,200 % éch. 31/01/2037         | € 16 000                            | 19 935                |

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 36 157 956 \$                       | 360 600                   |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,450 % éch. 31/10/2034         | € 84 000                            | 97 773                    |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                           |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)                        | 585 539                             | 72 631                    |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | € 53 500                            | 62 827                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2026 (b) | \$ 54 016                           | 54 032                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,450 % éch. 15/07/2031                          | € 42 500                            | 49 759                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>2,400 % éch. 15/03/2029                          | 30 100                              | 34 383                    |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>3,125 % éch. 10/10/2028                            | 28 300                              | 33 733                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,250 % éch. 15/07/2029 (b) | \$ 34 392                           | 33 532                    |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>0,000 % éch. 31/03/2027                            | € 25 600                            | 29 146                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>4,100 % éch. 01/02/2029                          | 23 200                              | 28 344                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/01/2031 (b) | \$ 25 028                           | 23 604                    |
| Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % éch. 01/10/2056                                    | DKK 147 843                         | 23 200                    |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>0,375 % éch. 23/04/2030                            | € 21 200                            | 23 063                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,400 % éch. 15/05/2030                          | 19 886                              | 22 796                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,750 % éch. 22/10/2043                                  | £ 17 600                            | 21 894                    |
| Union européenne<br>3,375 % éch. 12/12/2035                                           | € 18 300                            | 21 279                    |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/06/2055                                                 | \$ 20 660                           | 19 169                    |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,500 % éch. 31/01/2041         | € 16 000                            | 17 911                    |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>2,625 % éch. 10/01/2034                            | 14 600                              | 16 317                    |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 01/03/2030                          | 12 900                              | 15 246                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,875 % éch. 15/07/2034 (b) | \$ 14 255                           | 14 432                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/10/2026 (b) | 14 350                              | 14 364                    |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol<br>3,000 % éch. 31/01/2033         | € 11 300                            | 12 943                    |

(a) Le Fonds Global Real Return Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Income Fund

| DESCRIPTION                                                                          | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 740 765 806 \$                      | 7 387 403             |
|                                                                                      | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligations du Trésor américain<br>4,750 % éch. 15/02/2056                           | \$ 2 145 679                        | 2 124 621             |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                               | 1 995 200                           | 1 975 391             |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                            | 1 896 279                           | 1 796 250             |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/07/2055                                                | 1 106 612                           | 1 144 997             |
| Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 15/06/2028                               | 1 105 400                           | 1 110 706             |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,000 % éch. 01/02/2056 | 1 008 933                           | 1 001 277             |
| Fannie Mae<br>5,000 % éch. 01/12/2055                                                | 701 417                             | 697 553               |
| Fannie Mae<br>5,000 % éch. 01/01/2055                                                | 694 972                             | 690 410               |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/06/2055                                                | 593 799                             | 614 396               |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                          | 569 300                             | 567 165               |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,000 % éch. 01/12/2055 | 527 350                             | 524 395               |
| QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                                               | 522 400                             | 518 566               |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>5,000 % éch. 01/01/2056 | 514 881                             | 512 040               |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2045                           | 448 303                             | 435 726               |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033          | 411 800                             | 403 819               |
| Discovery Global Holdings, Inc.<br>6,144 % éch. 03/06/2033                           | 388 800                             | 387 828               |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien<br>19,698 % éch. 14/10/2030       | EGP 18 213 800                      | 387 222               |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>5,125 % éch. 29/06/2031                                    | \$ 379 200                          | 375 207               |
| Billets du Trésor américain<br>3,500 % éch. 15/01/2029                               | 375 000                             | 369 141               |

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 675 936 716 \$                      | 6 740 700                 |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | \$ 1 938 000                        | 1 902 268                 |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/07/2055                                                 | 1 106 612                           | 1 146 035                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,000 % éch. 15/12/2027                                | 1 000 000                           | 1 009 381                 |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/06/2055                                                 | 593 799                             | 614 953                   |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                             | 497 000                             | 497 500                   |
| Billets du Trésor américain<br>3,875 % éch. 15/06/2028                                | 405 400                             | 407 789                   |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>7,000 % éch. 01/03/2055  | 369 112                             | 386 429                   |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2026 (b) | 331 932                             | 333 592                   |
| Billets du Trésor américain<br>3,750 % éch. 15/08/2027                                | 300 000                             | 299 156                   |
| Billets du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2026                                | 250 000                             | 251 359                   |
| Billets du Trésor américain<br>4,500 % éch. 15/07/2026                                | 250 000                             | 250 891                   |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 31/10/2026                                | 250 000                             | 250 879                   |
| Billets du Trésor américain<br>3,500 % éch. 30/09/2026                                | 250 000                             | 249 834                   |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033           | 215 500                             | 217 610                   |
| QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                                                | 204 387                             | 203 629                   |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>6,500 % éch. 01/09/2054  | 169 909                             | 176 008                   |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>7,750 % éch. 23/11/2034         | MXN 3 012 590                       | 157 732                   |
| iHeartCommunications, Inc.<br>10,216 % éch. 01/05/2029                                | \$ 160 646                          | 152 421                   |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/01/2028                                | 150 000                             | 152 297                   |

(a) Le Fonds Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Income Fund II

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 25 397 418 \$                       | 253 294               |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                       |
| 5,500 % éch. 01/12/2055                                                         | \$ 14 916                           | 15 144                |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                       |
| 4,750 % éch. 15/02/2056                                                         | 12 539                              | 12 415                |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | 12 000                              | 11 877                |
| RD Michigan Property Owner LLC                                                  |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                                         | 11 612                              | 10 999                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 01/01/2056                                                         | 10 085                              | 9 567                 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                       |
| 4,500 % éch. 01/01/2056                                                         | 7 787                               | 7 607                 |
| JPMorgan Chase & Co.                                                            |                                     |                       |
| 4,457 % éch. 13/11/2031                                                         | € 5 700                             | 7 127                 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation                          |                                     |                       |
| 1,375 % éch. 15/07/2033 (b)                                                     | \$ 6 960                            | 6 810                 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                          |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 31/01/2037                                                         | ZAR 97 900                          | 5 865                 |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                                             |                                     |                       |
| 3,875 % éch. 29/04/2033                                                         | € 4 900                             | 5 720                 |
| Harvest Funding PLC                                                             |                                     |                       |
| 4,643 % éch. 15/11/2069                                                         | £ 4 200                             | 5 675                 |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/12/2055                                                         | \$ 5 588                            | 5 086                 |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/01/2056                                                         | 5 000                               | 4 639                 |
| First Mobility Swiss Lease                                                      |                                     |                       |
| 2,959 % éch. 23/09/2033                                                         | € 3 900                             | 4 570                 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                               |                                     |                       |
| 4,933 % éch. 25/03/2047                                                         | \$ 4 725                            | 4 543                 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation                          |                                     |                       |
| 1,875 % éch. 15/07/2035 (b)                                                     | 4 515                               | 4 517                 |
| Dilosk RMBS DAC                                                                 |                                     |                       |
| 2,733 % éch. 25/10/2064                                                         | € 3 600                             | 4 245                 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC                                         |                                     |                       |
| 3,150 % éch. 15/10/2035                                                         | 3 400                               | 3 918                 |
| FACT S.A.                                                                       |                                     |                       |
| 2,915 % éch. 20/04/2033                                                         | 3 400                               | 3 914                 |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 30 291 530 \$                       | 302 100                   |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/08/2054                                                         | \$ 14 460                           | 15 031                    |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | 11 870                              | 11 651                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/08/2055                                                         | 8 227                               | 8 552                     |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/12/2055                                                         | 5 563                               | 5 162                     |
| FACT S.A.                                                                       |                                     |                           |
| 2,915 % éch. 20/04/2033                                                         | € 3 400                             | 3 986                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 7,750 % éch. 29/05/2031                                                         | MXN 56 000                          | 3 107                     |
| AutoFlorence SRL                                                                |                                     |                           |
| 2,655 % éch. 24/12/2044                                                         | € 2 400                             | 2 816                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/12/2053                                                         | \$ 2 693                            | 2 800                     |
| SC Germany S.A., Compartiment Consumer                                          |                                     |                           |
| 2,665 % éch. 14/12/2038                                                         | € 2 144                             | 2 519                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 5,375 % éch. 22/03/2033                                                         | \$ 2 000                            | 1 947                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/01/2054                                                         | 1 842                               | 1 915                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)                       |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/04/2054                                                         | 1 825                               | 1 897                     |
| Bavarian Sky S.A.                                                               |                                     |                           |
| 2,705 % éch. 20/02/2034                                                         | € 1 400                             | 1 641                     |
| Marzio Finance SRL                                                              |                                     |                           |
| 3,743 % éch. 28/05/2049                                                         | 1 309                               | 1 540                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 5,625 % éch. 09/02/2034                                                         | \$ 1 550                            | 1 515                     |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 01/03/2029                                                         | MXN 25 000                          | 1 457                     |
| Lloyds Banking Group PLC                                                        |                                     |                           |
| 3,875 % éch. 14/05/2032                                                         | € 1 100                             | 1 316                     |
| JPMorgan Chase & Co.                                                            |                                     |                           |
| 4,505 % éch. 22/10/2028                                                         | \$ 700                              | 702                       |
| Obligation internationale du gouvernement roumain                               |                                     |                           |
| 6,250 % éch. 10/09/2034                                                         | € 400                               | 485                       |

(a) Le Fonds Income Fund II investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Low Average Duration Fund

| DESCRIPTION                                                                                  | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                          |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)              | 944 099 \$                          | 9 415                 |
|                                                                                              | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                       | \$ 2 975                            | 2 945                 |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                                    | 2 900                               | 2 747                 |
| Banco Santander S.A.<br>4,600 % éch. 15/04/2029                                              | 2 400                               | 2 400                 |
| Jubilee CLO DAC<br>3,034 % éch. 15/07/2034                                                   | € 1 879                             | 2 205                 |
| Citigroup, Inc.<br>4,643 % éch. 07/05/2028                                                   | \$ 2 100                            | 2 105                 |
| HAT Holdings LLC<br>3,375 % éch. 15/06/2026                                                  | 2 000                               | 1 998                 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,125 % éch. 15/01/2033            | 1 964                               | 1 905                 |
| Southwest Airlines Co.<br>5,125 % éch. 15/06/2027                                            | 1 800                               | 1 808                 |
| VICI Properties LP<br>3,750 % éch. 15/02/2027                                                | 1 800                               | 1 788                 |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                                  | 1 600                               | 1 594                 |
| Cheniere Corpus Christi Holdings LLC<br>5,125 % éch. 30/06/2027                              | 1 500                               | 1 504                 |
| Danske Bank A/S<br>4,662 % éch. 27/03/2029                                                   | 1 500                               | 1 500                 |
| Harvest Funding PLC<br>4,643 % éch. 15/11/2069                                               | £ 1 000                             | 1 351                 |
| John Deere Capital Corp.<br>4,400 % éch. 15/06/2029                                          | \$ 1 300                            | 1 299                 |
| Sempra<br>4,313 % éch. 07/01/2028                                                            | 1 200                               | 1 200                 |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,594 % éch. 20/04/2030                                         | 1 200                               | 1 200                 |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.<br>4,189 % éch. 03/12/2027                | 900                                 | 900                   |
| Sumisho Air Lease Corp.<br>4,500 % éch. 24/03/2029                                           | 900                                 | 899                   |
| Corebridge Global Funding<br>4,550 % éch. 09/01/2031                                         | 800                                 | 799                   |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>6,127 % éch. 20/02/2054                                   | £ 588                               | 797                   |
| Gartner, Inc.<br>4,500 % éch. 01/07/2028                                                     | \$ 800                              | 786                   |
| JPMorgan Chase & Co.<br>1,896 % éch. 05/03/2028                                              | CAD 1 100                           | 781                   |
| Fannie Mae<br>3,061 % éch. 25/06/2027                                                        | \$ 761                              | 754                   |
| Freddie Mac<br>4,650 % éch. 25/07/2056                                                       | 750                                 | 751                   |
| Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi<br>4,875 % éch. 30/04/2029 | 700                                 | 709                   |
| Lloyds Banking Group PLC<br>4,241 % éch. 10/02/2030                                          | 700                                 | 700                   |
| Evergy, Inc.<br>4,250 % éch. 15/03/2029                                                      | 700                                 | 700                   |

| DESCRIPTION                                                                           | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,875 % éch. 31/05/2026                                | \$ 134 200                          | \$ 134 666                |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 942 564                             | 9 400                     |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>3,000 % éch. 01/02/2052  | \$ 5 622                            | 5 004                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | 2 960                               | 2 905                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | 1 919                               | 1 814                     |
| International Business Machines Corp.<br>4,650 % éch. 10/02/2028                      | 1 300                               | 1 321                     |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                             | 1 300                               | 1 302                     |
| Oracle Corp.<br>4,772 % éch. 04/02/2029                                               | 500                                 | 495                       |
| Oracle Corp.<br>5,120 % éch. 03/08/2028                                               | 250                                 | 247                       |
| QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                                                | 200                                 | 199                       |

(a) Le Fonds Low Average Duration Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

| DESCRIPTION                                                                          |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                  |     |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,400 % éch. 20/03/2055        | ¥   | 3 580 000                           | \$ 18 408             |
| <b>ACTIONS</b>                                                                       |     |                                     |                       |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity<br>UCITS ETF (a)                     |     | 176 200                             | 17 701                |
|                                                                                      |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 31/07/2054                                 | £   | 12 000                              | 13 661                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>4,000 % éch. 01/05/2056 | \$  | 13 800                              | 12 925                |
| Bank of America Corp.<br>1,922 % éch. 24/10/2031                                     |     | 13 100                              | 11 805                |
| Lloyds Banking Group PLC<br>3,750 % éch. 18/03/2028                                  |     | 9 800                               | 9 746                 |
| Morgan Stanley<br>3,622 % éch. 01/04/2031                                            |     | 10 000                              | 9 692                 |
| Wells Fargo & Co.<br>5,198 % éch. 23/01/2030                                         |     | 9 400                               | 9 528                 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,875 % éch. 28/02/2035    | ZAR | 149 800                             | 9 413                 |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>5,218 % éch. 23/04/2031                                 | \$  | 8 200                               | 8 484                 |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>3,236 % éch. 13/02/2031                                    | €   | 7 000                               | 8 340                 |
| Northumbrian Water Finance PLC<br>2,375 % éch. 05/10/2027                            | £   | 6 200                               | 8 035                 |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                                          | \$  | 7 400                               | 7 372                 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>7,300 % éch. 12/08/2033        | PEN | 22 300                              | 7 259                 |
| JPMorgan Chase & Co.<br>2,522 % éch. 22/04/2031                                      | \$  | 7 600                               | 7 129                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                               |     | 7 150                               | 7 078                 |
| Baker Hughes Holdings LLC<br>4,350 % éch. 15/06/2031                                 |     | 7 000                               | 6 987                 |
| 365 bank A/S<br>7,125 % éch. 04/07/2028                                              | €   | 5 500                               | 6 862                 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)<br>4,000 % éch. 01/05/2056 | \$  | 7 199                               | 6 742                 |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                            |     | 7 000                               | 6 631                 |

| DESCRIPTION                                                                             |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                     |     |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement australien<br>2,750 % éch. 21/11/2028         | AUD | 41 600                              | \$ 27 589                 |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 07/03/2030                                    | £   | 15 800                              | 21 247                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme<br>(UMBS)<br>5,500 % éch. 01/03/2054 | \$  | 15 656                              | 15 708                    |
| Union européenne<br>2,000 % éch. 04/10/2027                                             | €   | 12 200                              | 13 966                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme<br>(UMBS)<br>4,000 % éch. 01/01/2049 | \$  | 13 818                              | 13 002                    |
| Bon du Trésor britannique<br>4,375 % éch. 31/07/2054                                    | £   | 12 000                              | 12 934                    |
| Province de l'Ontario<br>1,550 % éch. 01/11/2029                                        | CAD | 18 600                              | 12 764                    |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,400 % éch. 20/03/2055           | ¥   | 2 512 600                           | 12 452                    |
| Bank of America Corp.<br>1,922 % éch. 24/10/2031                                        | \$  | 13 100                              | 11 614                    |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien<br>5,125 % éch. 13/01/2028           |     | 10 600                              | 10 802                    |
| Wells Fargo & Co.<br>5,198 % éch. 23/01/2030                                            |     | 10 400                              | 10 544                    |
| Lloyds Banking Group PLC<br>3,750 % éch. 18/03/2028                                     |     | 9 800                               | 9 752                     |
| Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                         |     | 9 300                               | 9 573                     |
| Union européenne<br>2,875 % éch. 05/10/2029                                             | €   | 7 700                               | 8 944                     |
| Wells Fargo & Co.<br>5,574 % éch. 25/07/2029                                            | \$  | 8 500                               | 8 681                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme<br>(UMBS)<br>4,000 % éch. 01/05/2049 |     | 9 033                               | 8 633                     |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>5,218 % éch. 23/04/2031                                    |     | 8 200                               | 8 327                     |
| Northumbrian Water Finance PLC<br>2,375 % éch. 05/10/2027                               | £   | 6 200                               | 8 039                     |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>3,236 % éch. 13/02/2031                                       | €   | 7 000                               | 8 005                     |
| Morgan Stanley<br>3,622 % éch. 01/04/2031                                               | \$  | 7 900                               | 7 574                     |

(a) Le Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Low Duration Income Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 50 898 860 \$                       | 507 607               |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | \$ 109 400                          | 108 325               |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                       | 101 064                             | 95 733                |
| Gaci First Investment Co.<br>4,875 % éch. 14/05/2029                            | 52 100                              | 52 076                |
| Frontier Mortgage Funding PLC<br>4,532 % éch. 20/12/2066                        | £ 37 300                            | 50 252                |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                           | € 40 700                            | 47 694                |
| Curzon Mortgages PLC<br>4,592 % éch. 28/07/2049                                 | £ 33 300                            | 45 259                |
| Freddie Mac<br>4,000 % éch. 25/08/2056                                          | \$ 45 013                           | 43 675                |
| Harvest Funding PLC<br>4,643 % éch. 15/11/2069                                  | £ 31 700                            | 42 822                |
| VCL Multi-Compartment S.A.<br>2,394 % éch. 21/03/2033                           | € 35 000                            | 41 219                |
| Panorama Auto Trust<br>5,367 % éch. 20/05/2034                                  | AUD 55 000                          | 38 569                |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>5,125 % éch. 29/06/2031                               | \$ 38 600                           | 38 194                |
| Hawksmoor Mortgage Funding PLC<br>4,587 % éch. 25/02/2057                       | £ 28 000                            | 37 462                |
| FirstMac Mortgage Funding Trust<br>5,380 % éch. 11/05/2058                      | AUD 52 900                          | 37 458                |
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL<br>2,953 % éch. 26/12/2041                    | € 29 200                            | 34 189                |
| GS Mortgage-Backed Securities Trust<br>3,133 % éch. 24/11/2067                  | 27 100                              | 31 860                |
| AFG Trust<br>5,262 % éch. 10/10/2057                                            | AUD 44 400                          | 31 671                |
| VCL Multi-Compartment S.A.<br>2,715 % éch. 21/11/2032                           | € 26 700                            | 30 977                |
| Providus CLO DAC<br>3,415 % éch. 20/11/2038                                     | 26 400                              | 30 703                |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien<br>4,000 % éch. 23/04/2030  | 25 800                              | 30 203                |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 20 406 020 \$                       | 203 500                   |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | \$ 103 290                          | 101 386                   |
| VCL Multi-Compartment S.A.<br>2,715 % éch. 21/11/2032                           | € 25 702                            | 29 684                    |
| Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC<br>2,585 % éch. 15/08/2033             | 18 665                              | 21 566                    |
| Bavarian Sky S.A.<br>2,705 % éch. 20/02/2034                                    | 16 700                              | 19 283                    |
| Repsol E&P Capital Markets U.S. LLC<br>4,805 % éch. 16/09/2028                  | \$ 16 300                           | 16 324                    |
| Morgan Stanley<br>3,383 % éch. 23/01/2032                                       | € 13 480                            | 15 831                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>2,743 % éch. 17/02/2029                            | 12 400                              | 14 265                    |
| Toronto-Dominion Bank<br>4,361 % éch. 23/04/2029                                | \$ 13 200                           | 13 127                    |
| Cornell University<br>4,169 % éch. 15/06/2030                                   | 12 000                              | 11 990                    |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033     | 10 200                              | 10 298                    |
| Nissan Motor Co. Ltd.<br>5,250 % éch. 17/07/2029                                | € 7 600                             | 9 033                     |
| Petroleos Mexicanos<br>6,840 % éch. 23/01/2030                                  | \$ 8 700                            | 8 971                     |
| Robert Bosch Finance LLC<br>3,250 % éch. 21/05/2029                             | € 7 500                             | 8 635                     |
| Magnum Icc Finance BV<br>2,750 % éch. 26/02/2029                                | 7 500                               | 8 618                     |
| QatarEnergy<br>4,625 % éch. 23/06/2029                                          | \$ 8 600                            | 8 568                     |
| Imperial Brands Finance PLC<br>3,875 % éch. 02/08/2033                          | € 7 100                             | 8 006                     |
| ARGAN S.A.<br>3,779 % éch. 30/10/2029                                           | 5 700                               | 6 617                     |
| Bank of America Corp.<br>4,477 % éch. 23/04/2030                                | \$ 6 300                            | 6 267                     |
| Microchip Technology, Inc.<br>5,050 % éch. 15/02/2030                           | 5 700                               | 5 742                     |

(a) Le Fonds Low Duration Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Low Duration Opportunities Fund

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 6 073 336                           | \$ 60 570             |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | \$ 16 350                           | 16 196                |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       |
| Apple, Inc.                                                                           | 47 000                              | 13 895                |
| NVIDIA Corp.                                                                          | 67 000                              | 13 726                |
| Booking Holdings, Inc.                                                                | 83 000                              | 13 578                |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                             | \$ 13 500                           | 12 788                |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       |
| MercadoLibre, Inc.                                                                    | 6 600                               | 10 626                |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,875 % éch. 15/07/2034 (b) | \$ 7 859                            | 7 946                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | COP 22 777 600                      | 6 433                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | 22 777 600                          | 6 048                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | 22 777 600                          | 5 780                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | 22 777 600                          | 5 738                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | 22 777 600                          | 5 660                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | 22 777 600                          | 5 648                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035        | 22 777 600                          | 5 546                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030        | 20 316 400                          | 4 998                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030        | 20 316 400                          | 4 662                 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien<br>6,900 % éch. 12/08/2037         | PEN 14 800                          | 4 626                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/08/2030        | COP 20 316 400                      | 4 618                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030        | 20 316 400                          | 4 576                 |
| Capital Four CLO DAC<br>3,394 % éch. 15/04/2038                                       | € 3 800                             | 4 503                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030        | COP 20 316 400                      | 4 463                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030        | 20 316 400                          | 4 433                 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030        | 20 316 400                          | 4 378                 |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 4 301 953                           | \$ 42 900                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/11/2034                          | \$ 14 900                           | 14 985                    |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | 13 800                              | 13 546                    |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | COP 22 777 600                      | 6 443                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 22 777 600                          | 6 031                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 22 777 600                          | 5 920                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 22 777 600                          | 5 771                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 22 777 600                          | 5 600                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 22 777 600                          | 5 469                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 24/01/2035  | 22 777 600                          | 5 298                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/08/2030  | 20 316 400                          | 5 005                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 20 316 400                          | 4 640                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 20 316 400                          | 4 624                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 20 316 400                          | 4 549                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 20 316 400                          | 4 421                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 20 316 400                          | 4 310                     |
| Obligation internationale du gouvernement colombien<br>1,000 % éch. 18/09/2030  | 20 316 400                          | 4 251                     |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>2,200 % éch. 20/03/2064   | ¥ 418 000                           | 1 757                     |
| Altice France S.A.<br>6,875 % éch. 15/07/2032                                   | \$ 1 601                            | 1 552                     |
| Obligation internationale du gouvernement qatari<br>4,800 % éch. 08/04/2033     | 1 000                               | 1 010                     |

(a) Le Fonds Low Duration Opportunities Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

| DESCRIPTION                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                           |                                     |                       |
| Public Property Invest A/S<br>3,250 % éch. 21/04/2029                         | € 100                               | \$ 116                |
| Volkswagen Bank GmbH<br>3,625 % éch. 26/11/2028                               | 100                                 | 116                   |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>3,700 % éch. 20/03/2056 | ¥ 10 000                            | 61                    |
| CA Immobilien Anlagen AG<br>3,500 % éch. 07/07/2029                           | € 10                                | 11                    |

| DESCRIPTION                                                                   | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                           |                                     |                           |
| Électricité de France S.A.<br>4,125 % éch. 17/06/2031                         | € 100                               | \$ 121                    |
| Mizuho Financial Group, Inc.<br>3,490 % éch. 05/09/2027                       | 100                                 | 118                       |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.<br>3,741 % éch. 07/03/2029               | \$ 50                               | 49                        |
| Equinix, Inc.<br>1,550 % éch. 15/03/2028                                      | 30                                  | 28                        |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>1,300 % éch. 20/03/2063 | ¥ 7 250                             | 23                        |
| FactSet Research Systems, Inc.<br>3,450 % éch. 01/03/2032                     | \$ 18                               | 16                        |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 521 428                             | \$ 5 200              |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)                   | 19 900                              | 1 997                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Aries Capital DAC<br>0,000 % éch. 10/06/2033                                    | \$ 1 778                            | 1 778                 |
| Obligations du Trésor américain<br>5,000 % éch. 15/05/2056                      | 1 700                               | 1 695                 |
|                                                                                 | ACTIONS                             |                       |
| NVIDIA Corp.                                                                    | 2 801                               | 575                   |
| Apple, Inc.                                                                     | 1 968                               | 573                   |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Mizuho Financial Group, Inc.<br>4,486 % éch. 13/07/2030                         | \$ 400                              | 400                   |
| Harvest CLO DAC<br>3,523 % éch. 25/07/2037                                      | € 300                               | 343                   |
| Aqueduct European CLO DAC<br>3,511 % éch. 15/07/2039                            | 300                                 | 342                   |
| OCP Euro CLO DAC<br>3,513 % éch. 15/04/2037                                     | 300                                 | 340                   |
| Marble Point CLO Ltd.<br>4,667 % éch. 16/11/2034                                | \$ 250                              | 250                   |
| Tikehau U.S. CLO Ltd.<br>4,767 % éch. 18/01/2035                                | 250                                 | 250                   |
| NTT Finance Corp.<br>5,104 % éch. 02/07/2027                                    | 200                                 | 201                   |
| Penske Truck Leasing Co. LP<br>3,400 % éch. 15/11/2026                          | 202                                 | 201                   |
| HSBC Holdings PLC<br>4,755 % éch. 09/06/2028                                    | 200                                 | 200                   |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,428 % éch. 14/08/2026              | 200                                 | 200                   |
| Cooperatieve Rabobank UA<br>4,048 % éch. 09/06/2028                             | 200                                 | 200                   |
| NTT Finance Corp.<br>4,465 % éch. 20/06/2029                                    | 200                                 | 200                   |
| Glencore Funding LLC<br>4,000 % éch. 27/03/2027                                 | 200                                 | 199                   |
| Santander Holdings USA, Inc.<br>3,244 % éch. 05/10/2026                         | 200                                 | 199                   |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>1,542 % éch. 10/09/2027                            | 200                                 | 199                   |
| First Abu Dhabi Bank PJSC<br>4,789 % éch. 03/06/2031                            | 200                                 | 198                   |
| KeyCorp<br>2,250 % éch. 06/04/2027                                              | 200                                 | 197                   |

| DESCRIPTION                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 350 960                             | \$ 3 500                  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligations du Trésor américain<br>5,000 % éch. 15/05/2056                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 1 700                            | 1 707                     |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,428 % éch. 14/08/2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 200                                 | 200                       |
| (a) Le Fonds Inflation Multi-Asset Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                     |                           |
| Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. |                                     |                           |
| Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.                       |                                     |                           |

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 1 067 590                           | \$ 10 647             |
| ONEOK, Inc.                                                                     | 62 118                              | 5 530                 |
| Kinetik Holdings, Inc.                                                          | 100 098                             | 4 899                 |
| Targa Resources Corp.                                                           | 18 700                              | 4 340                 |
| DTE Midstream LLC                                                               | 30 530                              | 4 173                 |
| Enbridge, Inc.                                                                  | 54 206                              | 2 867                 |
| Williams Cos., Inc.                                                             | 38 370                              | 2 811                 |
| TC Energy Corp.                                                                 | 44 042                              | 2 771                 |
| Cheniere Energy, Inc.                                                           | 9 480                               | 2 199                 |
| Hess Midstream LP 'A'                                                           | 45 523                              | 1 675                 |
| Kinder Morgan, Inc.                                                             | 45 160                              | 1 465                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,954 % éch. 11/04/2033                    | \$ 100                              | 99                    |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| EQT Corp.                                                                       | 79 203                              | \$ 4 485                  |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 411 113                             | 4 100                     |
| Expand Energy Corp.                                                             | 36 262                              | 3 520                     |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Venture Global LNG, Inc.<br>9,875 % éch. 01/02/2032                             | \$ 2 350                            | 2 512                     |
|                                                                                 | ACTIONS                             |                           |
| TC Energy Corp.                                                                 | 25 870                              | 1 712                     |
| Hess Midstream LP 'A'                                                           | 19 862                              | 782                       |
| Enbridge, Inc.                                                                  | 10 882                              | 586                       |
| Targa Resources Corp.                                                           | 1 456                               | 394                       |
| Williams Cos., Inc.                                                             | 5 014                               | 390                       |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Transocean International Ltd.<br>7,875 % éch. 15/10/2032                        | \$ 356                              | 376                       |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,954 % éch. 11/04/2033                    | 100                                 | 100                       |

(a) Le Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund est investi en actions d'un Fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Mortgage Opportunities Fund

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                       |                                     |                       |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/01/2055                                   | \$ 159 600                          | \$ 145 564            |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 3,000 % éch. 20/04/2052                                   | 159 529                             | 145 141               |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 20/08/2055                                   | 71 995                              | 74 493                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                       |
| 6,000 % éch. 01/11/2055                                   | 60 753                              | 63 734                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                       |
| 6,000 % éch. 01/09/2040                                   | 45 717                              | 47 189                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                       |
| 6,500 % éch. 01/07/2055                                   | 30 741                              | 32 643                |
| Barings Private Credit Corp. CLO                          |                                     |                       |
| 5,126 % éch. 22/05/2034                                   | 27 500                              | 27 466                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                       |
| 6,000 % éch. 01/11/2040                                   | 25 116                              | 25 924                |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 3,000 % éch. 20/02/2056                                   | 28 155                              | 25 615                |
| Fannie Mae                                                |                                     |                       |
| 4,828 % éch. 25/10/2055                                   | 23 870                              | 24 087                |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 3,000 % éch. 20/07/2052                                   | 25 200                              | 22 601                |
| Fannie Mae                                                |                                     |                       |
| 4,728 % éch. 25/04/2056                                   | 22 000                              | 22 089                |
| Freddie Mac                                               |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 25/08/2056                                   | 22 458                              | 21 791                |
| FirstMac Mortgage Funding Trust                           |                                     |                       |
| 5,380 % éch. 11/05/2058                                   | AUD 20 000                          | 14 162                |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/03/2056                                   | \$ 12 812                           | 11 876                |
| Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust          |                                     |                       |
| 4,003 % éch. 25/07/2037                                   | 10 432                              | 10 448                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                       |
| 5,500 % éch. 01/03/2053                                   | 10 220                              | 10 415                |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                       |
| 4,359 % éch. 20/01/2076                                   | 10 300                              | 10 303                |
| Polaris PLC                                               |                                     |                       |
| 4,464 % éch. 27/06/2070                                   | £ 7 400                             | 10 186                |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                       |
| 5,000 % éch. 01/02/2056                                   | \$ 9 892                            | 10 035                |

| DESCRIPTION                                               | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                       |                                     |                           |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 20/08/2055                                   | \$ 71 995                           | \$ 74 560                 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,000 % éch. 01/04/2055                                   | 30 615                              | 31 110                    |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                           |
| 3,000 % éch. 20/02/2056                                   | 28 052                              | 25 159                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/02/2055                                   | 19 435                              | 20 141                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/03/2055                                   | 18 732                              | 19 413                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/02/2055                                   | 16 251                              | 16 891                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/08/2054                                   | 16 030                              | 16 662                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,500 % éch. 01/09/2054                                   | 16 006                              | 16 637                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,000 % éch. 01/05/2055                                   | 13 575                              | 13 795                    |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,000 % éch. 01/02/2055                                   | 11 671                              | 11 860                    |
| Fannie Mae                                                |                                     |                           |
| 4,300 % éch. 01/12/2032                                   | 8 100                               | 8 032                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,000 % éch. 01/02/2055                                   | 5 272                               | 5 358                     |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/02/2056                                   | 4 987                               | 4 595                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 4,800 % éch. 01/05/2031                                   | 4 173                               | 4 233                     |
| Fannie Mae                                                |                                     |                           |
| 4,400 % éch. 01/12/2029                                   | 3 648                               | 3 651                     |
| Fannie Mae                                                |                                     |                           |
| 4,280 % éch. 01/11/2032                                   | 2 940                               | 2 896                     |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                           |
| 3,000 % éch. 20/01/2056                                   | 2 284                               | 2 013                     |
| Fannie Mae                                                |                                     |                           |
| 4,500 % éch. 01/11/2032                                   | 2 000                               | 1 991                     |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) |                                     |                           |
| 6,000 % éch. 01/01/2055                                   | 1 951                               | 1 982                     |
| Ginnie Mae                                                |                                     |                           |
| 3,500 % éch. 20/03/2056                                   | 2 000                               | 1 835                     |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

| DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                                      | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                              |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 7 221 773                           | \$ 72 021             | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                  | 7 239 686                           | \$ 72 200                 |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,500 % éch. 15/02/2031                          | € 12 400                            | 14 805                | Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/10/2054                                                            | \$ 4 376                            | 4 020                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,100 % éch. 15/05/2033                          | 8 158                               | 8 897                 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2031 (b)            | 3 023                               | 2 834                     |
|                                                                                       | ACTIONS                             |                       |                                                                                                  | ACTIONS                             |                           |
| Invesco Physical Gold ETC                                                             | 19 736                              | 8 748                 | Invesco Physical Gold ETC                                                                        | 4 640                               | 2 299                     |
|                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | iShares Physical Gold ETC                                                                        | 23 134                              | 2 073                     |
| Bon du Trésor britannique<br>4,000 % éch. 22/10/2031                                  | £ 6 200                             | 8 410                 |                                                                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,800 % éch. 15/05/2036                          | € 3 856                             | 4 604                 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,875 % éch. 15/07/2035 (b)            | \$ 2 019                            | 2 026                     |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/01/2056                                                 | \$ 4 400                            | 4 042                 | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                           | 1 840                               | 1 806                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/07/2030 (b) | 2 690                               | 2 540                 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/01/2030 (b)            | 518                                 | 487                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,125 % éch. 15/10/2030 (b) | 2 552                               | 2 516                 | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                                        | 400                                 | 401                       |
| Obligation internationale du gouvernement français<br>0,100 % éch. 25/07/2036         | € 2 401                             | 2 465                 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>2,375 % éch. 15/02/2056 (b)            | 306                                 | 284                       |
| Bon du Trésor britannique<br>0,625 % éch. 22/11/2042                                  | £ 2 317                             | 2 444                 |                                                                                                  | ACTIONS                             |                           |
| Fannie Mae<br>4,728 % éch. 25/07/2055                                                 | \$ 2 370                            | 2 381                 | Alexandria Real Estate Equities, Inc.                                                            | 1 922                               | 94                        |
| Obligation internationale du gouvernement japonais<br>3,400 % éch. 20/12/2055         | ¥ 370 000                           | 2 287                 | Sun Communities, Inc.                                                                            | 562                                 | 70                        |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/01/2031 (b) | \$ 2 410                            | 2 259                 | Rexford Industrial Realty, Inc.                                                                  | 1 911                               | 67                        |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,250 % éch. 15/04/2031 (b) | 2 229                               | 2 192                 | Welltower, Inc.                                                                                  | 321                                 | 67                        |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | 1 900                               | 1 881                 | Equity LifeStyle Properties, Inc.                                                                | 979                                 | 62                        |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                             | 1 800                               | 1 705                 | Essential Properties Realty Trust, Inc.                                                          | 1 922                               | 58                        |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>1,875 % éch. 15/01/2036 (b) | 1 600                               | 1 583                 | CareTrust REIT, Inc.                                                                             | 1 502                               | 57                        |
| Freddie Mac<br>4,578 % éch. 25/06/2056                                                | 1 400                               | 1 400                 | STAG Industrial, Inc.                                                                            | 1 464                               | 56                        |
| Fannie Mae<br>5,128 % éch. 25/06/2055                                                 | 1 326                               | 1 341                 | American Healthcare REIT, Inc.                                                                   | 1 096                               | 53                        |
|                                                                                       |                                     |                       | Ventas, Inc.                                                                                     | 616                                 | 51                        |
|                                                                                       |                                     |                       | (a) Le Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. |                                     |                           |
|                                                                                       |                                     |                       | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.                |                                     |                           |

Les variations importantes de la composition du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds StocksPLUS™ Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 339 984 225 \$                      | 3 390 538             |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                          |                                     |                       |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                                         | ZAR 921 200                         | 57 230                |
| BMW U.S. Capital LLC                                                            |                                     |                       |
| 4,428 % éch. 17/03/2028                                                         | \$ 55 600                           | 55 600                |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                                                       |                                     |                       |
| 4,789 % éch. 03/06/2031                                                         | 52 700                              | 52 173                |
| National Bank of Canada                                                         |                                     |                       |
| 4,402 % éch. 20/01/2029                                                         | 51 500                              | 51 500                |
| Canadian Imperial Bank of Commerce                                              |                                     |                       |
| 4,297 % éch. 26/06/2028                                                         | 48 200                              | 48 200                |
| QNB Finance Ltd.                                                                |                                     |                       |
| 4,538 % éch. 19/09/2027                                                         | 46 500                              | 46 326                |
| VICI Properties LP                                                              |                                     |                       |
| 4,250 % éch. 01/12/2026                                                         | 42 646                              | 42 617                |
| Citigroup, Inc.                                                                 |                                     |                       |
| 4,643 % éch. 07/05/2028                                                         | 39 500                              | 39 579                |
| Obligation internationale du gouvernement canadien                              |                                     |                       |
| 2,750 % éch. 01/03/2031                                                         | CAD 52 200                          | 37 118                |
| Santander UK Group Holdings PLC                                                 |                                     |                       |
| 2,469 % éch. 11/01/2028                                                         | \$ 37 299                           | 36 730                |
| NTT Finance Corp.                                                               |                                     |                       |
| 4,665 % éch. 20/06/2031                                                         | 35 000                              | 35 000                |
| Toro European CLO DAC                                                           |                                     |                       |
| 3,474 % éch. 15/04/2037                                                         | € 28 900                            | 33 518                |
| Volkswagen Group of America Finance LLC                                         |                                     |                       |
| 6,000 % éch. 16/11/2026                                                         | \$ 31 200                           | 31 710                |
| Freddie Mac                                                                     |                                     |                       |
| 4,650 % éch. 25/07/2056                                                         | 31 000                              | 31 029                |
| Polaris PLC                                                                     |                                     |                       |
| 4,464 % éch. 27/06/2070                                                         | £ 22 400                            | 30 832                |
| Goldman Sachs Group, Inc.                                                       |                                     |                       |
| 4,632 % éch. 20/04/2030                                                         | \$ 30 100                           | 30 100                |
| Global Payments, Inc.                                                           |                                     |                       |
| 4,450 % éch. 01/06/2028                                                         | 28 437                              | 28 228                |
| Israel Electric Corp. Ltd.                                                      |                                     |                       |
| 7,750 % éch. 15/12/2027                                                         | 26 500                              | 28 089                |
| Obligation internationale du gouvernement israélien                             |                                     |                       |
| 5,000 % éch. 30/10/2026                                                         | € 22 900                            | 27 645                |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 387 642 165 \$                      | 3 865 900                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos                                  |                                     |                           |
| 5,000 % éch. 01/10/2028                                                         | CLP 54 555 000                      | 62 390                    |
| Obligation internationale du gouvernement canadien                              |                                     |                           |
| 2,750 % éch. 01/03/2031                                                         | CAD 52 200                          | 37 114                    |
| Volkswagen Group of America Finance LLC                                         |                                     |                           |
| 6,000 % éch. 16/11/2026                                                         | \$ 31 200                           | 31 645                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 01/03/2029                                                         | MXN 520 700                         | 30 870                    |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain                          |                                     |                           |
| 8,000 % éch. 31/01/2030                                                         | ZAR 488 300                         | 30 692                    |
| Deutsche Bank AG                                                                |                                     |                           |
| 7,146 % éch. 13/07/2027                                                         | \$ 28 961                           | 29 322                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain                              |                                     |                           |
| 8,500 % éch. 02/03/2028                                                         | MXN 506 000                         | 29 144                    |
| Morgan Stanley                                                                  |                                     |                           |
| 1,593 % éch. 04/05/2027                                                         | \$ 23 850                           | 23 729                    |
| Standard Chartered PLC                                                          |                                     |                           |
| 6,187 % éch. 06/07/2027                                                         | 23 152                              | 23 339                    |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.                                                    |                                     |                           |
| 5,375 % éch. 15/07/2027                                                         | 20 901                              | 21 068                    |
| Hyundai Capital America                                                         |                                     |                           |
| 5,250 % éch. 08/01/2027                                                         | 20 800                              | 21 042                    |
| Lloyds Banking Group PLC                                                        |                                     |                           |
| 5,530 % éch. 26/11/2028                                                         | 20 000                              | 20 157                    |
| Xcel Energy, Inc.                                                               |                                     |                           |
| 3,350 % éch. 01/12/2026                                                         | 19 791                              | 19 711                    |
| Fortis, Inc.                                                                    |                                     |                           |
| 3,055 % éch. 04/10/2026                                                         | 19 400                              | 19 276                    |
| Compartiment Driver UK Nine                                                     |                                     |                           |
| 5,309 % éch. 26/04/2032                                                         | £ 13 255                            | 17 855                    |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | \$ 17 680                           | 17 354                    |
| Air Lease Corp.                                                                 |                                     |                           |
| 1,875 % éch. 15/08/2026                                                         | 17 032                              | 16 852                    |
| CNH Industrial Capital LLC                                                      |                                     |                           |
| 1,450 % éch. 15/07/2026                                                         | 14 250                              | 14 101                    |
| TES colombien                                                                   |                                     |                           |
| 11,000 % éch. 22/08/2029                                                        | COP 53 200 500                      | 13 722                    |

(a) Le Fonds StocksPLUS™ Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

| DESCRIPTION                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                     |                       |
| Freddie Mac<br>4,728 % éch. 25/07/2055                                             | \$ 1 200                            | \$ 1 204              |
| <b>ACTIONS</b>                                                                     |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) | 21 253                              | 212                   |
| <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>                                       |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>7,000 % éch. 28/02/2031  | ZAR 3 500                           | 202                   |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,000 % éch. 31/01/2030  | 1 790                               | 111                   |
| TES colombien<br>11,750 % éch. 24/01/2035                                          | COP 382 400                         | 98                    |
| Fannie Mae<br>3,992 % éch. 25/08/2035                                              | \$ 23                               | 22                    |
| Freddie Mac<br>4,007 % éch. 15/08/2035                                             | 23                                  | 22                    |
| TES colombien<br>7,250 % éch. 18/10/2034                                           | COP 72 900                          | 15                    |

| DESCRIPTION                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>7,000 % éch. 28/02/2031  | ZAR 2 770                           | \$ 165                    |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain<br>8,500 % éch. 01/03/2029      | MXN 2 800                           | 158                       |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>5,000 % éch. 01/10/2028          | CLP 110 000                         | 126                       |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain<br>8,000 % éch. 31/01/2030  | ZAR 1 990                           | 122                       |
| <b>ACTIONS</b>                                                                     |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) | 10 028                              | 100                       |
| <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>                                       |                                     |                           |
| Obligation internationale du gouvernement polonais<br>4,750 % éch. 25/07/2029      | PLN 200                             | 56                        |
| TES colombien<br>11,000 % éch. 22/08/2029                                          | COP 102 100                         | 26                        |

(a) Le Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Strategic Income Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                           | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                   |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 19 587 431                          | \$ 195 347            | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)       | 16 805 488                          | \$ 167 600                |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Obligations du Trésor américain<br>4,750 % éch. 15/02/2056                      | \$ 31 179                           | 30 871                | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                                | \$ 28 290                           | 27 768                    |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                          | 29 300                              | 29 009                |                                                                                       | ACTIONS                             |                           |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                       | 27 683                              | 26 223                | Cisco Systems, Inc.                                                                   | 191 900                             | 24 944                    |
| Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/01/2056                                           | 25 229                              | 23 407                |                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
|                                                                                 | ACTIONS                             |                       | Ginnie Mae<br>3,500 % éch. 20/05/2055                                                 | \$ 24 724                           | 22 939                    |
| Amgen, Inc.                                                                     | 61 174                              | 21 290                | Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/08/2055                                                 | 18 998                              | 19 675                    |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation<br>0,125 % éch. 15/04/2026 (b) | 17 941                              | 17 963                    |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/08/2055                                           | \$ 18 998                           | 19 657                |                                                                                       | ACTIONS                             |                           |
| Ginnie Mae<br>3,000 % éch. 20/07/2052                                           | 18 200                              | 16 323                | British American Tobacco PLC                                                          | 255 390                             | 15 119                    |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.<br>3,875 % éch. 29/04/2033                  | € 11 800                            | 13 775                | Johnson & Johnson                                                                     | 53 041                              | 12 491                    |
| Frontier Mortgage Funding PLC<br>4,532 % éch. 20/12/2066                        | £ 9 900                             | 13 338                | Murata Manufacturing Co. Ltd.                                                         | 195 600                             | 11 829                    |
|                                                                                 | ACTIONS                             |                       | MediaTek, Inc.                                                                        | 178 000                             | 11 545                    |
| AbbVie, Inc.                                                                    | 55 299                              | 12 279                |                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/01/2056                                                 | \$ 10 232                           | 10 596                    |
| Aqueduct European CLO DAC<br>3,511 % éch. 15/07/2039                            | € 10 100                            | 11 509                | Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/09/2054                                                 | 9 532                               | 9 871                     |
| Ares European CLO DAC<br>3,512 % éch. 15/07/2037                                | 9 900                               | 11 443                |                                                                                       | ACTIONS                             |                           |
| Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO DAC<br>3,414 % éch. 15/07/2039          | 9 900                               | 11 443                | Samsung Electronics Co. Ltd.                                                          | 68 302                              | 9 349                     |
|                                                                                 | ACTIONS                             |                       | Pfizer, Inc.                                                                          | 303 985                             | 8 286                     |
| Sanofi S.A.                                                                     | 122 745                             | 11 117                | Millrose Properties, Inc.                                                             | 237 057                             | 6 717                     |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       | Bank of New York Mellon Corp.                                                         | 44 202                              | 6 365                     |
| First Mobility Swiss Lease<br>2,959 % éch. 23/09/2033                           | € 9 300                             | 10 898                | Vale S.A.                                                                             | 327 900                             | 5 686                     |
| Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/01/2056                                           | \$ 10 232                           | 10 587                | Tokio Marine Holdings, Inc.                                                           | 136 700                             | 5 594                     |
| Dwight Issuer LLC<br>5,000 % éch. 18/01/2044                                    | 10 100                              | 10 100                |                                                                                       | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Harvest CLO DAC<br>3,523 % éch. 25/07/2037                                      | € 8 800                             | 10 072                | Ginnie Mae<br>6,500 % éch. 20/12/2054                                                 | \$ 5 236                            | 5 423                     |
| OCP Euro CLO DAC<br>3,513 % éch. 15/04/2037                                     | 8 800                               | 9 980                 |                                                                                       | ACTIONS                             |                           |
|                                                                                 |                                     |                       | LXP Industrial Trust                                                                  | 114 542                             | 5 387                     |

(a) Le Fonds Strategic Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds Total Return Bond Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 64 964 146 \$                       | 647 889               |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Ginnie Mae                                                                      |                                     |                       |
| 3,500 % éch. 20/07/2055                                                         | \$ 44 674                           | 40 657                |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | 35 770                              | 35 400                |
| RD Michigan Property Owner LLC                                                  |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                                         | 32 500                              | 30 786                |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                       |
| 3,375 % éch. 15/08/2042                                                         | 31 118                              | 26 384                |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                       |
| 2,250 % éch. 15/05/2041                                                         | 34 200                              | 25 618                |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                       |
| 4,625 % éch. 15/11/2055                                                         | 17 100                              | 16 594                |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                       |
| 3,750 % éch. 30/04/2028                                                         | 15 175                              | 15 129                |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien                              |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 12/01/2029                                                         | 14 800                              | 14 781                |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                       |
| 3,625 % éch. 15/08/2043                                                         | 16 100                              | 13 789                |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                       |
| 3,875 % éch. 15/05/2043                                                         | 14 059                              | 12 091                |
| Anglian Water Services Financing PLC                                            |                                     |                       |
| 5,875 % éch. 20/06/2031                                                         | £ 8 500                             | 11 471                |
| QNB Finance Ltd.                                                                |                                     |                       |
| 4,538 % éch. 19/09/2027                                                         | \$ 11 000                           | 10 959                |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                       |
| 3,875 % éch. 31/03/2031                                                         | 10 800                              | 10 764                |
| Ford Motor Credit Co. LLC                                                       |                                     |                       |
| 4,970 % éch. 06/04/2029                                                         | 10 500                              | 10 499                |
| Sempra                                                                          |                                     |                       |
| 4,313 % éch. 07/01/2028                                                         | 9 800                               | 9 800                 |
| JPMorgan Chase & Co.                                                            |                                     |                       |
| 3,136 % éch. 18/02/2032                                                         | € 8 000                             | 9 508                 |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien                             |                                     |                       |
| 4,000 % éch. 23/04/2030                                                         | 7 100                               | 8 304                 |
| Edison International                                                            |                                     |                       |
| 5,000 % éch. 05/05/2028                                                         | \$ 8 200                            | 8 192                 |
| Bank of America Corp.                                                           |                                     |                       |
| 3,419 % éch. 20/12/2028                                                         | 8 200                               | 8 115                 |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 82 876 851 \$                       | 826 500                   |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                                                         | \$ 35 770                           | 35 090                    |
| Obligations du Trésor américain                                                 |                                     |                           |
| 4,750 % éch. 15/08/2055                                                         | 17 817                              | 17 032                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation                          |                                     |                           |
| 1,250 % éch. 15/04/2028 (b)                                                     | 15 042                              | 15 143                    |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                           |
| 3,750 % éch. 30/04/2028                                                         | 15 175                              | 15 068                    |
| Billets du Trésor américain                                                     |                                     |                           |
| 3,875 % éch. 31/03/2031                                                         | 10 800                              | 10 783                    |
| Wells Fargo Bank N.A.                                                           |                                     |                           |
| 5,493 % éch. 11/12/2026                                                         | 8 500                               | 8 527                     |
| Obligation internationale du gouvernement canadien                              |                                     |                           |
| 3,000 % éch. 01/06/2034                                                         | CAD 11 900                          | 8 403                     |
| RD Michigan Property Owner LLC                                                  |                                     |                           |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                                                         | \$ 7 650                            | 7 660                     |
| Société Générale S.A.                                                           |                                     |                           |
| 4,677 % éch. 15/06/2027                                                         | 6 700                               | 6 733                     |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.                                           |                                     |                           |
| 5,880 % éch. 13/07/2026                                                         | 6 600                               | 6 610                     |
| TES colombien                                                                   |                                     |                           |
| 11,750 % éch. 24/01/2035                                                        | COP 22 906 800                      | 6 048                     |
| Morgan Stanley Bank N.A.                                                        |                                     |                           |
| 5,882 % éch. 30/10/2026                                                         | \$ 5 300                            | 5 327                     |
| SoftBank Group Corp.                                                            |                                     |                           |
| 7,250 % éch. 10/07/2032                                                         | 5 000                               | 4 934                     |
| Beignet Investor LLC                                                            |                                     |                           |
| 6,581 % éch. 30/05/2049                                                         | 4 810                               | 4 919                     |
| Occidental Petroleum Corp.                                                      |                                     |                           |
| 5,375 % éch. 01/01/2032                                                         | 4 600                               | 4 714                     |
| Obligation internationale du gouvernement qatari                                |                                     |                           |
| 4,800 % éch. 08/04/2033                                                         | 3 700                               | 3 746                     |
| Obligation internationale du gouvernement japonais                              |                                     |                           |
| 2,200 % éch. 20/03/2064                                                         | ¥ 812 000                           | 3 413                     |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.                                         |                                     |                           |
| 5,896 % éch. 13/07/2026                                                         | \$ 3 100                            | 3 105                     |
| SoftBank Group Corp.                                                            |                                     |                           |
| 7,500 % éch. 10/07/2035                                                         | 2 500                               | 2 506                     |

(a) Le Fonds Total Return Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | COÛT<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 3 059 973                           | \$ 30 516             |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                       |
| Toyota Credit Canada, Inc.<br>4,420 % éch. 28/06/2027                           | CAD 2 300                           | 1 715                 |
| AerCap Ireland Capital DAC<br>6,450 % éch. 15/04/2027                           | \$ 1 500                            | 1 526                 |
| Cooperatieve Rabobank UA<br>4,048 % éch. 09/06/2028                             | 1 500                               | 1 500                 |
| Aon Corp.<br>2,850 % éch. 28/05/2027                                            | 1 400                               | 1 382                 |
| Weyerhaeuser Co.<br>4,750 % éch. 15/05/2026                                     | 1 300                               | 1 300                 |
| Ford Motor Credit Co. LLC<br>4,271 % éch. 09/01/2027                            | 1 300                               | 1 299                 |
| Wells Fargo & Co.<br>3,526 % éch. 24/03/2028                                    | 1 300                               | 1 289                 |
| SBA Tower Trust<br>2,328 % éch. 15/07/2052                                      | 1 250                               | 1 205                 |
| American Honda Finance Corp.<br>4,900 % éch. 12/03/2027                         | 1 200                               | 1 204                 |
| HSBC Holdings PLC<br>4,755 % éch. 09/06/2028                                    | 1 200                               | 1 202                 |
| Toronto-Dominion Bank<br>4,258 % éch. 17/12/2026                                | 1 200                               | 1 201                 |
| Aviation Capital Group LLC<br>1,950 % éch. 20/09/2026                           | 1 200                               | 1 185                 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>2,750 % éch. 01/09/2030   | CAD 1 602                           | 1 151                 |
| Deutsche Bank AG<br>7,146 % éch. 13/07/2027                                     | \$ 1 100                            | 1 107                 |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,937 % éch. 23/04/2028                            | 1 100                               | 1 105                 |
| Jackson National Life Global Funding<br>4,528 % éch. 09/06/2027                 | 1 100                               | 1 102                 |
| Freddie Mac<br>4,650 % éch. 25/07/2056                                          | 1 100                               | 1 101                 |
| Freddie Mac<br>4,778 % éch. 25/11/2055                                          | 1 052                               | 1 054                 |
| Bayerische Landesbank<br>4,012 % éch. 18/04/2028                                | 1 000                               | 1 000                 |
| Freddie Mac<br>4,578 % éch. 25/06/2056                                          | 1 000                               | 1 000                 |
| RGA Global Funding<br>2,000 % éch. 30/11/2026                                   | 1 000                               | 990                   |

| DESCRIPTION                                                                     | ACTIONS                             | PRODUITS<br>(en milliers) |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                             |                                     |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 3 058 361                           | \$ 30 500                 |
|                                                                                 | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) |                           |
| Aries Capital DAC<br>0,000 % éch. 18/09/2030                                    | \$ 2 437                            | 2 500                     |
| Greenleaves Capital DAC<br>0,000 % éch. 18/09/2030                              | 2 437                               | 2 500                     |
| Nordea Bank Abp<br>5,140 % éch. 19/03/2027                                      | 1 300                               | 1 304                     |
| Toronto-Dominion Bank<br>4,258 % éch. 17/12/2026                                | 1 200                               | 1 202                     |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>2,750 % éch. 01/09/2030   | CAD 1 602                           | 1 151                     |
| Athene Global Funding<br>5,487 % éch. 27/08/2026                                | \$ 900                              | 901                       |
| Obligation internationale du gouvernement canadien<br>2,750 % éch. 01/03/2031   | CAD 1 100                           | 782                       |
| White Rose Master Issuer PLC<br>5,229 % éch. 16/04/2073                         | £ 470                               | 632                       |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,428 % éch. 14/08/2026              | \$ 600                              | 601                       |
| HSBC Holdings PLC<br>6,075 % éch. 14/08/2027                                    | 595                                 | 596                       |
| Bank of Nova Scotia<br>5,169 % éch. 04/06/2027                                  | 400                                 | 402                       |
| Crédit Agricole S.A.<br>5,632 % éch. 05/07/2026                                 | 100                                 | 100                       |

(a) Le Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds UK Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION                                            | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                          | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                    |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>  |                                     |                           |
| Cadent Finance PLC                                     | £ 2 700                             | £ 2 680               | Bon du Trésor britannique            | £ 17 900                            | £ 7 921                   |
| 5,750 % éch. 14/03/2034                                |                                     |                       | 1,500 % éch. 31/07/2053              |                                     |                           |
| Eastern Power Networks PLC                             |                                     |                       | Bon du Trésor britannique            | 13 400                              | 5 542                     |
| 6,250 % éch. 12/11/2036                                | 2 600                               | 2 670                 | 1,250 % éch. 31/07/2051              |                                     |                           |
| Bon du Trésor britannique                              |                                     |                       | Bon du Trésor britannique            | 2 500                               | 2 461                     |
| 4,125 % éch. 07/03/2031                                | 2 500                               | 2 520                 | 4,125 % éch. 07/03/2031              |                                     |                           |
| Wells Fargo & Co.                                      |                                     |                       | Heathrow Funding Ltd.                |                                     |                           |
| 4,625 % éch. 02/11/2035                                | 2 500                               | 2 314                 | 6,450 % éch. 10/12/2033              | 2 000                               | 2 084                     |
| Barclays PLC                                           |                                     |                       | South Eastern Power Networks PLC     |                                     |                           |
| 5,851 % éch. 21/03/2035                                | 2 200                               | 2 184                 | 1,750 % éch. 30/09/2034              | 2 500                               | 1 851                     |
| Manchester Airport Group Funding PLC                   |                                     |                       | NatWest Group PLC                    |                                     |                           |
| 2,875 % éch. 30/09/2044                                | 3 475                               | 2 173                 | 2,057 % éch. 09/11/2028              | 1 800                               | 1 713                     |
| Crédit Agricole S.A.                                   |                                     |                       | Metropolitan Life Global Funding     |                                     |                           |
| 5,375 % éch. 20/12/2037                                | 2 200                               | 2 171                 | 4,000 % éch. 27/05/2033              | € 1 900                             | 1 674                     |
| Motability Operations Group PLC                        |                                     |                       | Wells Fargo & Co.                    |                                     |                           |
| 2,125 % éch. 18/01/2042                                | 3 750                               | 2 170                 | 2,500 % éch. 02/05/2029              | £ 1 650                             | 1 526                     |
| Verizon Communications, Inc.                           |                                     |                       | Crédit Agricole S.A.                 |                                     |                           |
| 4,750 % éch. 17/02/2034                                | 2 300                               | 2 164                 | 5,750 % éch. 29/11/2027              | 1 400                               | 1 419                     |
| United Utilities Water Finance PLC                     |                                     |                       | ING Groep NV                         |                                     |                           |
| 5,125 % éch. 06/10/2038                                | 2 375                               | 2 116                 | 1,125 % éch. 07/12/2028              | 1 500                               | 1 403                     |
| Électricité de France S.A.                             |                                     |                       | Westfield Stratford City Finance PLC |                                     |                           |
| 5,500 % éch. 17/10/2041                                | 2 000                               | 1 775                 | 1,642 % éch. 04/08/2031              | 1 400                               | 1 383                     |
| Banco Santander S.A.                                   |                                     |                       | United Utilities Water Finance PLC   |                                     |                           |
| 5,500 % éch. 28/04/2033                                | 1 700                               | 1 694                 | 5,125 % éch. 06/10/2038              | 1 500                               | 1 364                     |
| Metropolitan Life Global Funding                       |                                     |                       | Severn Trent Utilities Finance PLC   |                                     |                           |
| 4,000 % éch. 27/05/2033                                | € 1 900                             | 1 645                 | 6,250 % éch. 07/06/2029              | 1 300                               | 1 343                     |
| Deutsche Bank AG                                       |                                     |                       | Prologis International Funding S.A.  |                                     |                           |
| 5,000 % éch. 26/02/2029                                | £ 1 600                             | 1 597                 | 2,750 % éch. 22/02/2032              | 1 500                               | 1 337                     |
| BPCE S.A.                                              |                                     |                       | Barclays PLC                         |                                     |                           |
| 5,375 % éch. 22/10/2031                                | 1 600                               | 1 591                 | 5,851 % éch. 21/03/2035              | 1 300                               | 1 299                     |
| BPCE S.A.                                              |                                     |                       | Iberdrola Finanzas S.A.              |                                     |                           |
| 5,250 % éch. 31/07/2032                                | 1 600                               | 1 584                 | 5,250 % éch. 31/10/2036              | 1 300                               | 1 241                     |
| Time Warner Cable LLC                                  |                                     |                       | Volkswagen Financial Services NV     |                                     |                           |
| 5,250 % éch. 15/07/2042                                | 1 750                               | 1 414                 | 2,125 % éch. 18/01/2028              | 1 300                               | 1 229                     |
| Clarion Funding PLC                                    |                                     |                       | Verizon Communications, Inc.         |                                     |                           |
| 1,875 % éch. 07/09/2051                                | 3 000                               | 1 312                 | 2,500 % éch. 08/04/2031              | 1 400                               | 1 225                     |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation |                                     |                       | Nationwide Building Society          |                                     |                           |
| 1,125 % éch. 15/10/2030 (a)                            | \$ 1 707                            | 1 283                 | 6,178 % éch. 07/12/2027              | 1 200                               | 1 211                     |
| Heathrow Funding Ltd.                                  |                                     |                       | Berkshire Hathaway Finance Corp.     |                                     |                           |
| 5,625 % éch. 05/02/2034                                | £ 1 300                             | 1 278                 | 2,375 % éch. 19/06/2039              | 1 600                               | 1 145                     |

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.



## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION                                           |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                        |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|-----------------------|----------------------------------------------------|----|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                   |     |                                     |                       | <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026 (suite)</b>        |    |                                     |                       |
| TES colombien                                         |     |                                     |                       | Amprion GmbH                                       |    |                                     |                       |
| 12,500 % éch. 27/02/2030                              | COP | 1 221 700                           | \$ 230                | 4,750 % éch. 28/04/2056                            | €  | 100                                 | \$ 86                 |
| Flora Food Management BV                              |     |                                     |                       | LSF12 Pillar Investments US, Inc.                  |    |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 31/10/2030                               | €   | 200                                 | 174                   | 5,750 % éch. 15/05/2033                            |    | 100                                 | 86                    |
| Anglian Water Services Financing PLC                  |     |                                     |                       | Credit Agricole Assurances S.A.                    |    |                                     |                       |
| 4,250 % éch. 23/06/2036                               |     | 200                                 | 171                   | 5,875 % éch. 17/06/2032                            |    | 100                                 | 86                    |
| GlaxoSmithKline Capital PLC                           |     |                                     |                       | Verisure Holding AB                                |    |                                     |                       |
| 4,250 % éch. 18/12/2045                               | £   | 200                                 | 166                   | 4,125 % éch. 02/01/2032                            |    | 100                                 | 86                    |
| Sony Group Corp.                                      |     |                                     |                       | SSE PLC                                            |    |                                     |                       |
| 5,089 % éch. 30/06/2036                               | \$  | 200                                 | 151                   | 4,750 % éch. 09/03/2034                            |    | 100                                 | 86                    |
| Green Palm Bidco SARL                                 |     |                                     |                       | Var Energi ASA                                     |    |                                     |                       |
| 6,462 % éch. 30/06/2046                               |     | 200                                 | 148                   | 4,950 % éch. 29/04/2086                            |    | 100                                 | 86                    |
| Australian Metcoal Financing Pty. Ltd.                |     |                                     |                       | Engie S.A.                                         |    |                                     |                       |
| 6,250 % éch. 22/10/2031                               |     | 200                                 | 147                   | 4,000 % éch. 01/07/2038                            |    | 100                                 | 86                    |
| QNB Finance Ltd.                                      |     |                                     |                       | Public Property Invest A/S                         |    |                                     |                       |
| 4,679 % éch. 27/04/2029                               |     | 200                                 | 147                   | 4,125 % éch. 21/04/2033                            |    | 100                                 | 86                    |
| Billets du Trésor américain                           |     |                                     |                       | ams-OSRAM AG                                       |    |                                     |                       |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                               |     | 200                                 | 146                   | 7,250 % éch. 31/05/2032                            |    | 100                                 | 86                    |
| Esentia Energy Development S.A.B. de C.V.             |     |                                     |                       | Davide Campari-Milano NV                           |    |                                     |                       |
| 6,125 % éch. 30/07/2033                               |     | 200                                 | 146                   | 4,250 % éch. 17/06/2033                            |    | 100                                 | 86                    |
| Gaci First Investment Co.                             |     |                                     |                       | Metlen Energy & Metals S.A.                        |    |                                     |                       |
| 6,250 % éch. 14/05/2056                               |     | 200                                 | 145                   | 4,000 % éch. 17/10/2029                            |    | 100                                 | 83                    |
| RD Michigan Property Owner LLC                        |     |                                     |                       | HSBC Bank PLC                                      |    |                                     |                       |
| 7,500 % éch. 30/03/2045                               |     | 200                                 | 140                   | 4,750 % éch. 24/03/2046                            | £  | 100                                 | 82                    |
| Shell International Finance BV                        |     |                                     |                       | ION Platform Finance SARL                          |    |                                     |                       |
| 1,750 % éch. 10/09/2052                               | £   | 300                                 | 130                   | 6,500 % éch. 30/09/2030                            | €  | 100                                 | 79                    |
| Platform HG Financing PLC                             |     |                                     |                       | Obligation internationale du gouvernement japonais | ¥  | 25 000                              | 77                    |
| 1,625 % éch. 10/08/2055                               |     | 300                                 | 116                   | 0,400 % éch. 20/06/2041                            |    |                                     |                       |
| Weir Group PLC                                        |     |                                     |                       | Venture Global Calcasieu Pass LLC                  |    |                                     |                       |
| 6,875 % éch. 14/06/2028                               |     | 100                                 | 104                   | 6,000 % éch. 01/05/2036                            | \$ | 100                                 | 74                    |
| Scottish Widows Ltd.                                  |     |                                     |                       | PacifiCorp                                         |    |                                     |                       |
| 7,000 % éch. 16/06/2043                               |     | 100                                 | 102                   | 7,125 % éch. 15/08/2056                            |    | 100                                 | 73                    |
| GA Global Funding Trust                               |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,414 % éch. 15/12/2032                               |     | 100                                 | 100                   |                                                    |    |                                     |                       |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                             |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 4,697 % éch. 19/08/2031                               |     | 100                                 | 100                   |                                                    |    |                                     |                       |
| Engie S.A.                                            |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 6,125 % éch. 16/01/2032                               |     | 100                                 | 100                   |                                                    |    |                                     |                       |
| Goldman Sachs Group, Inc.                             |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,770 % éch. 22/09/2036                               |     | 100                                 | 100                   |                                                    |    |                                     |                       |
| Westfield Stratford City Finance PLC                  |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,124 % éch. 05/05/2036                               |     | 100                                 | 100                   |                                                    |    |                                     |                       |
| Marks & Spencer PLC                                   |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,125 % éch. 18/08/2032                               |     | 100                                 | 100                   |                                                    |    |                                     |                       |
| Alphabet, Inc.                                        |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,875 % éch. 13/02/2058                               |     | 100                                 | 99                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Stellantis NV                                         |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 8,250 % éch. 16/06/2032                               |     | 100                                 | 98                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Miller Homes Group Finco PLC                          |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 7,000 % éch. 15/05/2029                               |     | 100                                 | 95                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Vonovia SE                                            |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,500 % éch. 18/01/2036                               |     | 100                                 | 95                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Alphabet, Inc.                                        |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,500 % éch. 13/11/2041                               |     | 100                                 | 94                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Anglian Water Osprey Financing PLC                    |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 2,000 % éch. 31/07/2028                               |     | 100                                 | 92                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,950 % éch. 27/04/2033                               | €   | 100                                 | 88                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Lottomatica Group SpA                                 |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 4,625 % éch. 30/04/2032                               |     | 100                                 | 87                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Froneri Lux FinCo SARL                                |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 4,750 % éch. 01/08/2032                               |     | 100                                 | 87                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Kapla Holding S.A.S.                                  |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,125 % éch. 30/04/2032                               |     | 100                                 | 87                    |                                                    |    |                                     |                       |
| CTP NV                                                |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 3,375 % éch. 19/07/2030                               |     | 100                                 | 87                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Molins Finance S.A.                                   |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 5,500 % éch. 15/06/2033                               |     | 100                                 | 87                    |                                                    |    |                                     |                       |
| Birkenstock Group BV & Co. KG                         |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 4,500 % éch. 15/06/2033                               |     | 100                                 | 86                    |                                                    |    |                                     |                       |
| CoreWeave, Inc.                                       |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 8,500 % éch. 15/07/2032                               |     | 100                                 | 86                    |                                                    |    |                                     |                       |
| INEOS Finance PLC                                     |     |                                     |                       |                                                    |    |                                     |                       |
| 7,875 % éch. 15/11/2031                               |     | 100                                 | 86                    |                                                    |    |                                     |                       |

| DESCRIPTION                                           |     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-------------------------------------------------------|-----|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                   |     |                                     |                           |
| Bavarian Sky UK PLC                                   |     |                                     |                           |
| 0,000 % éch. 20/11/2033                               | £   | 500                                 | \$ 500                    |
| J Sainsbury PLC                                       |     |                                     |                           |
| 5,625 % éch. 29/01/2035                               |     | 300                                 | 307                       |
| Motability Operations Group PLC                       |     |                                     |                           |
| 1,500 % éch. 20/01/2041                               |     | 400                                 | 233                       |
| AT&T, Inc.                                            |     |                                     |                           |
| 4,250 % éch. 01/06/2043                               |     | 300                                 | 229                       |
| Lloyds Banking Group PLC                              |     |                                     |                           |
| 7,500 % éch. 27/06/2030                               |     | 200                                 | 204                       |
| National Grid Electricity Transmission PLC            |     |                                     |                           |
| 2,000 % éch. 16/09/2038                               |     | 300                                 | 202                       |
| LSEGA Financing PLC                                   |     |                                     |                           |
| 4,875 % éch. 19/09/2032                               |     | 200                                 | 199                       |
| Mitchells & Butlers Finance PLC                       |     |                                     |                           |
| 6,721 % éch. 15/09/2034                               |     | 200                                 | 183                       |
| Aviva PLC                                             |     |                                     |                           |
| 4,000 % éch. 03/06/2055                               |     | 200                                 | 176                       |
| Barclays PLC                                          |     |                                     |                           |
| 6,125 % éch. 15/12/2035                               | €   | 200                                 | 172                       |
| EXOR NV                                               |     |                                     |                           |
| 3,750 % éch. 05/11/2035                               |     | 200                                 | 167                       |
| Esentia Energy Development S.A.B. de C.V.             |     |                                     |                           |
| 6,125 % éch. 30/07/2033                               | \$  | 200                                 | 151                       |
| FWD Group Holdings Ltd.                               |     |                                     |                           |
| 5,836 % éch. 22/09/2035                               |     | 200                                 | 149                       |
| Ubisoft Entertainment S.A.                            |     |                                     |                           |
| 0,878 % éch. 24/11/2027                               | €   | 200                                 | 147                       |
| Billets du Trésor américain                           |     |                                     |                           |
| 4,125 % éch. 15/02/2036                               | \$  | 200                                 | 145                       |
| Notting Hill Genesis                                  |     |                                     |                           |
| 3,250 % éch. 12/10/2048                               | £   | 200                                 | 127                       |
| JPMorgan Chase & Co.                                  |     |                                     |                           |
| 1,895 % éch. 28/04/2033                               |     | 150                                 | 125                       |
| TES colombien                                         |     |                                     |                           |
| 12,500 % éch. 27/02/2030                              | COP | 610 900                             | 124                       |
| National Grid Electricity Transmission PLC            |     |                                     |                           |
| 2,000 % éch. 17/04/2040                               | £   | 175                                 | 113                       |
| CD&R Firefly Bidco PLC                                |     |                                     |                           |
| 8,625 % éch. 30/04/2029                               |     | 100                                 | 105                       |
| GA Global Funding Trust                               |     |                                     |                           |
| 6,454 % éch. 11/09/2040                               |     | 100                                 | 105                       |
| NIE Finance PLC                                       |     |                                     |                           |
| 5,750 % éch. 07/12/2035                               |     | 100                                 | 104                       |
| Ocado Group PLC                                       |     |                                     |                           |
| 11,000 % éch. 15/06/2030                              |     | 100                                 | 103                       |
| Ford Motor Credit Co. LLC                             |     |                                     |                           |
| 6,184 % éch. 29/08/2031                               |     | 100                                 | 103                       |
| Miller Homes Group Finco PLC                          |     |                                     |                           |
| 7,000 % éch. 15/05/2029                               |     | 100                                 | 101                       |
| British Telecommunications PLC                        |     |                                     |                           |
| 6,375 % éch. 03/12/2055                               |     | 100                                 | 101                       |
| Northwestern Mutual Global Funding                    |     |                                     |                           |
| 4,700 % éch. 28/10/2030                               |     | 100                                 | 101                       |
| LondonMetric Property PLC                             |     |                                     |                           |
| 4,875 % éch. 10/12/2032                               |     | 100                                 | 99                        |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB                      |     |                                     |                           |
| 4,750 % éch. 15/07/2031                               |     | 100                                 | 98                        |
| Stellantis NV                                         |     |                                     |                           |
| 8,250 % éch. 16/06/2032                               |     | 100                                 | 98                        |
| Électricité de France S.A.                            |     |                                     |                           |
| 5,500 % éch. 27/03/2037                               |     | 100                                 | 98                        |
| MassMutual Global Funding                             |     |                                     |                           |
| 5,000 % éch. 29/09/2032                               |     | 100                                 | 97                        |
| Gaci First Investment Co.                             |     |                                     |                           |
| 5,625 % éch. 11/06/2039                               |     | 100                                 | 95                        |
| Anglian Water Osprey Financing PLC                    |     |                                     |                           |
| 2,000 % éch. 31/07/2028                               |     | 100                                 | 93                        |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain |     |                                     |                           |
| 5,950 % éch. 27/04/2033                               | €   | 100                                 | 91                        |
| Cooperatieve Rabobank UA                              |     |                                     |                           |
| 5,375 % éch. 03/08/2060                               | £   | 100                                 | 90                        |
| Molins Finance S.A.                                   |     |                                     |                           |
| 5,500 % éch. 15/06/2033                               | €   | 100                                 | 90                        |

| DESCRIPTION                                        |    | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|----------------------------------------------------|----|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026 (suite)</b>        |    |                                     |                           |
| Aston Martin Capital Holdings Ltd.                 |    |                                     |                           |
| 10,375 % éch. 31/03/2029                           | £  | 100                                 | \$ 88                     |
| ELO SACA                                           |    |                                     |                           |
| 4,875 % éch. 08/12/2028                            | €  | 100                                 | 87                        |
| Kapla Holding S.A.S.                               |    |                                     |                           |
| 5,125 % éch. 30/04/2032                            |    | 100                                 | 87                        |
| Var Energi ASA                                     |    |                                     |                           |
| 4,950 % éch. 29/04/2086                            |    | 100                                 | 87                        |
| Mundys SpA                                         |    |                                     |                           |
| 3,700 % éch. 29/09/2031                            |    | 100                                 | 86                        |
| Verizon Communications, Inc.                       |    |                                     |                           |
| 3,375 % éch. 27/10/2036                            | £  | 100                                 | 80                        |
| PacifiCorp                                         |    |                                     |                           |
| 7,125 % éch. 15/08/2056                            | \$ | 100                                 | 74                        |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain |    |                                     |                           |
| 5,625 % éch. 19/03/2114                            | £  | 100                                 | 72                        |
| Charter Communications Operating LLC               |    |                                     |                           |
| 6,700 % éch. 01/12/2055                            | \$ | 100                                 | 70                        |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds US High Yield Bond Fund

| DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) | DESCRIPTION                                                                        | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                          |                                     |                       | <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                     |                           |
| Billets du Trésor américain<br>3,500 % éch. 28/02/2031       | \$ 15 825                           | \$ 15 313             | Billets du Trésor américain<br>3,500 % éch. 30/11/2030                             | \$ 15 700                           | \$ 15 217                 |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036       | 13 320                              | 13 137                | Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036                             | 12 930                              | 12 692                    |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045    | 12 650                              | 11 983                | Medline Borrower LP<br>3,875 % éch. 01/04/2029                                     | 10 475                              | 10 290                    |
| ams-OSRAM AG<br>7,250 % éch. 31/05/2032                      | € 6 950                             | 8 289                 | Beignet Investor LLC<br>6,581 % éch. 30/05/2049                                    | 8 225                               | 8 538                     |
| LBM Acquisition LLC<br>6,250 % éch. 15/01/2029               | \$ 6 356                            | 5 908                 | CCO Holdings LLC<br>5,375 % éch. 01/06/2029                                        | 8 475                               | 8 384                     |
| PR RNO Property Owner LLC<br>6,500 % éch. 01/05/2031         | 5 650                               | 5 595                 | RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045                          | 7 525                               | 7 537                     |
| VistaJet Malta Finance PLC<br>8,750 % éch. 15/01/2032        | 5 475                               | 5 446                 | U.S. Foods, Inc.<br>4,750 % éch. 15/02/2029                                        | 7 000                               | 6 887                     |
| Bausch Health Cos., Inc.<br>10,561 % éch. 08/10/2030         | 5 544                               | 5 405                 | Cordia Finanz GmbH<br>9,375 % éch. 03/10/2031                                      | 7 200                               | 6 682                     |
| Michaels Cos., Inc.<br>8,500 % éch. 15/03/2033               | 5 275                               | 5 227                 | Carnival Corp.<br>5,750 % éch. 01/08/2032                                          | 6 175                               | 6 273                     |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,000 % éch. 01/05/2036 | 5 225                               | 5 225                 | Ball Corp.<br>2,875 % éch. 15/08/2030                                              | 6 800                               | 6 198                     |
| OAK-Eagle Acquireco, Inc.<br>7,250 % éch. 01/07/2033         | 4 950                               | 5 090                 | Churchill Downs, Inc.<br>4,750 % éch. 15/01/2028                                   | 6 150                               | 6 077                     |
| Wynn Las Vegas LLC<br>5,250 % éch. 15/05/2027                | 5 050                               | 5 063                 | B.C. Ltd.<br>10,000 % éch. 15/04/2032                                              | 5 800                               | 5 950                     |
| Core Scientific Finance LLC<br>7,750 % éch. 15/05/2031       | 4 950                               | 4 934                 | Cotiviti Corp.<br>7,303 % éch. 01/05/2031                                          | 6 395                               | 5 907                     |
| Coherent Corp.<br>5,000 % éch. 15/12/2029                    | 4 800                               | 4 746                 | <b>ACTIONS</b>                                                                     |                                     |                           |
| Connect Holding LLC<br>10,500 % éch. 03/04/2031              | 4 550                               | 4 611                 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) | 591 585                             | 5 900                     |
| Fair Isaac Corp.<br>6,250 % éch. 15/09/2034                  | 4 625                               | 4 569                 | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b>                                       |                                     |                           |
| Tutor Perini Corp.<br>6,625 % éch. 15/07/2033                | 4 500                               | 4 503                 | B.C. Unlimited Liability Co.<br>4,000 % éch. 15/10/2030                            | \$ 6 150                            | 5 881                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,000 % éch. 15/11/2035       | 4 500                               | 4 407                 | Block, Inc.<br>3,500 % éch. 01/06/2031                                             | 6 325                               | 5 748                     |
| Iron Mountain, Inc.<br>4,500 % éch. 15/02/2031               | 4 575                               | 4 400                 | Aston Martin Capital Holdings Ltd.<br>10,000 % éch. 31/03/2029                     | 6 750                               | 5 532                     |
| Venture Global LNG, Inc.<br>8,375 % éch. 01/06/2031          | 4 231                               | 4 220                 | DISH DBS Corp.<br>5,125 % éch. 01/06/2029                                          | 5 975                               | 5 442                     |
|                                                              |                                     |                       | Intesa Sanpaolo SpA<br>4,198 % éch. 01/06/2032                                     | 5 650                               | 5 346                     |
|                                                              |                                     |                       | Athenahealth Group, Inc.<br>6,500 % éch. 15/02/2030                                | 5 275                               | 5 017                     |

(a) Le Fonds US High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION                                                  | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | COÛT<br>(en milliers) |
|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                          |                                     |                       |
| Billets du Trésor américain<br>3,625 % éch. 31/12/2030       | \$ 25 200                           | \$ 24 941             |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036       | 9 000                               | 8 892                 |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2055   | 4 600                               | 4 344                 |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2045   | 4 200                               | 4 068                 |
| Obligations du Trésor américain<br>4,750 % éch. 15/08/2055   | 2 900                               | 2 825                 |
| Credit Agricole Assurances S.A.<br>5,875 % éch. 17/06/2032   | € 2 000                             | 2 312                 |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045    | \$ 2 400                            | 2 273                 |
| Swiss RE Subordinated Finance PLC<br>4,399 % éch. 22/04/2037 | € 1 900                             | 2 242                 |
| Canadian Natural Resources Ltd.<br>5,400 % éch. 15/12/2034   | \$ 2 000                            | 2 024                 |
| QNB Finance Ltd.<br>4,538 % éch. 19/09/2027                  | 2 000                               | 1 993                 |
| Public Property Invest A/S<br>4,125 % éch. 21/04/2033        | € 1 700                             | 1 965                 |
| Coöperatieve Rabobank UA<br>5,500 % éch. 01/08/2033          | 1 600                               | 1 889                 |
| Ally Financial, Inc.<br>6,184 % éch. 26/07/2035              | \$ 1 800                            | 1 851                 |
| CPI Property Group S.A.<br>6,875 % éch. 05/02/2033           | £ 1 300                             | 1 754                 |
| Stellantis NV<br>6,875 % éch. 16/12/2033                     | € 1 500                             | 1 734                 |
| Diamondback Energy, Inc.<br>5,900 % éch. 18/04/2064          | \$ 1 800                            | 1 702                 |
| P3 Group SARL<br>3,375 % éch. 22/03/2031                     | € 1 400                             | 1 615                 |
| Grupo Nutresa S.A.<br>9,000 % éch. 12/05/2035                | \$ 1 400                            | 1 594                 |
| INEOS Finance PLC<br>7,875 % éch. 15/11/2031                 | € 1 300                             | 1 528                 |
| VMware LLC<br>2,200 % éch. 15/08/2031                        | \$ 1 700                            | 1 507                 |

| DESCRIPTION                                                     | VALEUR<br>NOMINALE<br>(en milliers) | PRODUITS<br>(en milliers) |
|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                             |                                     |                           |
| Billets du Trésor américain<br>3,625 % éch. 31/12/2030          | \$ 25 200                           | \$ 25 162                 |
| Obligations du Trésor américain<br>4,625 % éch. 15/11/2045      | 4 200                               | 4 061                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,250 % éch. 15/08/2035          | 3 900                               | 3 894                     |
| Billets du Trésor américain<br>4,125 % éch. 15/02/2036          | 2 750                               | 2 699                     |
| Duke Energy Corp.<br>3,750 % éch. 01/04/2031                    | € 2 000                             | 2 425                     |
| Bayer U.S. Finance LLC<br>4,375 % éch. 15/12/2028               | \$ 1 800                            | 1 803                     |
| Diamondback Energy, Inc.<br>5,900 % éch. 18/04/2064             | 1 800                               | 1 759                     |
| Charter Communications Operating LLC<br>5,850 % éch. 01/12/2035 | 1 700                               | 1 700                     |
| Wessex Water Services Finance PLC<br>6,125 % éch. 19/09/2034    | £ 1 200                             | 1 662                     |
| Grupo Nutresa S.A.<br>9,000 % éch. 12/05/2035                   | \$ 1 400                            | 1 559                     |
| INEOS Finance PLC<br>7,875 % éch. 15/11/2031                    | € 1 300                             | 1 474                     |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>4,875 % éch. 08/02/2036 | 1 200                               | 1 469                     |
| RD Michigan Property Owner LLC<br>7,500 % éch. 30/03/2045       | \$ 1 400                            | 1 403                     |
| Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % éch. 08/08/2029                | 1 400                               | 1 362                     |
| Ally Financial, Inc.<br>6,184 % éch. 26/07/2035                 | 1 330                               | 1 358                     |
| Obligations du Trésor américain<br>4,750 % éch. 15/08/2055      | 1 375                               | 1 341                     |
| Lincoln Financial Global Funding<br>4,625 % éch. 18/08/2030     | 1 300                               | 1 305                     |
| Obligations du Trésor américain<br>4,875 % éch. 15/08/2045      | 1 300                               | 1 301                     |
| Marks & Spencer PLC<br>5,125 % éch. 18/08/2032                  | £ 900                               | 1 210                     |
| HOCHTIEF AG<br>4,000 % éch. 15/04/2034                          | € 1 000                             | 1 170                     |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Variations importantes de la composition du Portefeuille Fonds US Short-Term Fund

| DESCRIPTION                                                                        | ACTIONS                                      | COÛT<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------|
| <b>ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                              |                       |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)    | 32 483 781                                   | \$ 323 954            |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)                      | 960 170                                      | 96 485                |
|                                                                                    | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                       |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b) | \$ 40 681                                    | 40 448                |
| Global Net Lease, Inc. 3,750 % éch. 15/12/2027                                     | 38 565                                       | 37 840                |
| HSBC Holdings PLC 4,755 % éch. 09/06/2028                                          | 37 000                                       | 37 071                |
| AT&T, Inc. 2,300 % éch. 01/06/2027                                                 | 36 102                                       | 35 423                |
| Energy Transfer LP 5,500 % éch. 01/06/2027                                         | 32 900                                       | 33 134                |
| Hannover Funding Co. LLC 5,500 % éch. 16/04/2027                                   | 32 764                                       | 32 991                |
| Las Vegas Sands Corp. 5,900 % éch. 01/06/2027                                      | 26 865                                       | 27 144                |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 5,125 % éch. 13/01/2028         | 24 300                                       | 24 754                |
| Freddie Mac 4,650 % éch. 25/07/2056                                                | 22 700                                       | 22 721                |
| Wells Fargo & Co. 5,707 % éch. 22/04/2028                                          | 22 100                                       | 22 335                |
| La Trobe Financial Capital Markets Trust 5,000 % éch. 15/08/2057                   | AUD 31 200                                   | 21 689                |
| Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,125 % éch. 30/06/2027                       | \$ 21 000                                    | 21 058                |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/03/2031         | CAD 29 600                                   | 21 048                |
| Fannie Mae 4,728 % éch. 25/04/2056                                                 | \$ 20 700                                    | 20 694                |
| Sempra 3,250 % éch. 15/06/2027                                                     | 20 700                                       | 20 464                |
| GA Global Funding Trust 4,400 % éch. 23/09/2027                                    | 19 055                                       | 19 079                |
| QNB Finance Ltd. 4,538 % éch. 19/09/2027                                           | 19 100                                       | 19 028                |
| Canadian Natural Resources Ltd. 3,850 % éch. 01/06/2027                            | 18 300                                       | 18 215                |

| DESCRIPTION                                                                        | ACTIONS                                      | PRODUITS<br>(en milliers) |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|---------------------------|
| <b>VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2026</b>                                                |                                              |                           |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)    | 32 480 580                                   | \$ 323 920                |
|                                                                                    | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                           |
| Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 30/09/2030                                | \$ 98 400                                    | 97 160                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b) | 40 667                                       | 40 583                    |
| Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/10/2030                                | 40 400                                       | 39 884                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (b) | 31 557                                       | 31 656                    |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2026 (b) | 28 806                                       | 28 993                    |
| Pinnacle West Capital Corp. 5,250 % éch. 10/06/2026                                | 21 441                                       | 21 443                    |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/03/2031         | CAD 29 600                                   | 21 046                    |
| Kommunalbanken A/S 4,785 % éch. 03/03/2028                                         | \$ 20 000                                    | 20 062                    |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 5,138 % éch. 20/12/2027                         | AUD 26 300                                   | 18 364                    |
| National Bank of Canada 5,424 % éch. 02/07/2027                                    | \$ 17 250                                    | 17 253                    |
|                                                                                    | <b>ACTIONS</b>                               |                           |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)                      | 154 300                                      | 15 500                    |
|                                                                                    | <b>VALEUR<br/>NOMINALE<br/>(en milliers)</b> |                           |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. 5,375 % éch. 15/07/2027                               | \$ 13 600                                    | 13 709                    |
| Koromo UK PLC 4,305 % éch. 23/11/2032                                              | £ 10 000                                     | 13 627                    |
| Banque de Montréal 5,310 % éch. 10/09/2027                                         | \$ 13 300                                    | 13 313                    |
| Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,195 % éch. 01/04/2027                    | 12 730                                       | 12 781                    |
| Cooperative Rabobank UA 1,106 % éch. 24/02/2027                                    | 12 150                                       | 12 146                    |
| NTT Finance Corp. 1,162 % éch. 03/04/2026                                          | 12 000                                       | 11 957                    |
| Diamondback Energy, Inc. 3,250 % éch. 01/12/2026                                   | 9 800                                        | 9 754                     |
| Fédération des Caisses Desjardins du Québec 4,985 % éch. 27/01/2027                | 9 300                                        | 9 320                     |

(a) Le Fonds US Short-Term Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

## Glossaire : (abréviations susceptibles d'être utilisées dans les états qui précèdent)

### Abréviations des contreparties :

|            |                                                  |             |                                                    |            |                                     |
|------------|--------------------------------------------------|-------------|----------------------------------------------------|------------|-------------------------------------|
| <b>AZD</b> | Australia and New Zealand Banking Group          | <b>DEU</b>  | Deutsche Bank Securities, Inc.                     | <b>NXN</b> | Natixis New York                    |
| <b>BAR</b> | Barclays PLC Corporate RRP/REPO trading          | <b>DUB</b>  | Deutsche Bank AG                                   | <b>RBC</b> | Royal Bank of Canada                |
| <b>BCY</b> | Barclays Capital, Inc.                           | <b>FAR</b>  | Wells Fargo Bank National Association              | <b>RCE</b> | Royal Bank of Canada Europe Limited |
| <b>BOA</b> | Bank of America N.A.                             | <b>FCT</b>  | Credit Suisse Capital LLC                          | <b>RDR</b> | RBC Capital Markets LLC             |
| <b>BOM</b> | Banque de Montréal                               | <b>FICC</b> | Fixed Income Clearing Corporation                  | <b>RYL</b> | NatWest Markets Plc                 |
| <b>BOS</b> | BofA Securities, Inc.                            | <b>GLM</b>  | Goldman Sachs Bank USA                             | <b>SAL</b> | Citigroup Global Markets, Inc.      |
| <b>BPS</b> | BNP Paribas S.A.                                 | <b>GSC</b>  | Goldman Sachs & Co. LLC                            | <b>SBI</b> | Citigroup Global Markets Ltd.       |
| <b>BRC</b> | Barclays Bank PLC                                | <b>GST</b>  | Goldman Sachs International                        | <b>SCX</b> | Standard Chartered Bank, Londres    |
| <b>BSH</b> | Banco Santander S.A. - Succursale de New York    | <b>IND</b>  | Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A. | <b>SGY</b> | Société Générale, NY                |
| <b>BSN</b> | The Bank of Nova Scotia - Toronto                | <b>JML</b>  | JP Morgan Securities Plc                           | <b>SNF</b> | Sanford C. Bernstein & Co.          |
| <b>BSS</b> | Banco Santander S.A.                             | <b>JPM</b>  | JP Morgan Chase Bank N.A.                          | <b>SOG</b> | Société Générale Paris              |
| <b>BUS</b> | The Bank of Nova Scotia - Toronto                | <b>JPS</b>  | J.P. Morgan Securities LLC                         | <b>SSB</b> | State Street Bank and Trust Co.     |
| <b>BYR</b> | The Bank of Nova Scotia - Toronto                | <b>MAC</b>  | Macquarie Bank Limited                             | <b>STR</b> | State Street FICC Repo              |
| <b>CBK</b> | Citibank N.A.                                    | <b>MBC</b>  | HSBC Bank Plc                                      | <b>TDL</b> | Toronto Dominion Bank London        |
| <b>CDC</b> | Natixis Securities Americas LLC                  | <b>MEI</b>  | Merrill Lynch International                        | <b>TDM</b> | TD Securities (USA) LLC             |
| <b>CEW</b> | Canadian Imperial Bank of Commerce World Markets | <b>MSC</b>  | Morgan Stanley & Co. LLC.                          | <b>TOR</b> | The Toronto-Dominion Bank           |
| <b>CIB</b> | Canadian Imperial Bank of Commerce               | <b>MYC</b>  | Morgan Stanley Capital Services LLC                | <b>UAG</b> | UBS AG Stamford                     |
| <b>CKL</b> | Citibank N.A. Londres                            | <b>MYI</b>  | Morgan Stanley & Co. International PLC             | <b>ULO</b> | UBS AG London                       |
| <b>COM</b> | Commerz Bank AG                                  | <b>NOM</b>  | Nomura Securities International, Inc.              | <b>WFS</b> | Wells Fargo Securities, LLC         |
| <b>DBL</b> | Deutsche Bank AG London                          | <b>NSL</b>  | Nomura International PLC                           | <b>WST</b> | Westpac Banking Corp.               |

### Abréviations des devises :

|                   |                                       |                   |                      |                    |                       |
|-------------------|---------------------------------------|-------------------|----------------------|--------------------|-----------------------|
| <b>AED</b>        | Dirham des EAU                        | <b>HKD</b>        | Dollar de Hong Kong  | <b>PKR</b>         | Roupie pakistanaise   |
| <b>ARS</b>        | Peso argentin                         | <b>HUF</b>        | Forint hongrois      | <b>PLN</b>         | Zloty polonais        |
| <b>AUD</b>        | Dollar australien                     | <b>IDR</b>        | Roupie indonésienne  | <b>PYG</b>         | Guarani paraguayen    |
| <b>AZN</b>        | Manat d'Azerbaïdjan                   | <b>ILS</b>        | Shekel israélien     | <b>QAR</b>         | Riyal du Qatar        |
| <b>BRL</b>        | Réal brésilien                        | <b>INR</b>        | Roupie indienne      | <b>RON</b>         | Nouveau leu roumain   |
| <b>CAD</b>        | Dollar canadien                       | <b>JPY (or ¥)</b> | Yen japonais         | <b>RSD</b>         | Dinar serbe           |
| <b>CHF</b>        | Franc suisse                          | <b>KES</b>        | Shilling kényan      | <b>RUB</b>         | Rouble russe          |
| <b>CLP</b>        | Peso chilien                          | <b>KRW</b>        | Won sud-coréen       | <b>SEK</b>         | Couronne suédoise     |
| <b>CNH</b>        | Renminbi chinois (Offshore)           | <b>KWD</b>        | Dinar koweïtien      | <b>SGD</b>         | Dollar de Singapour   |
| <b>CNY</b>        | Renminbi chinois (Chine continentale) | <b>KZT</b>        | Tenge kazakh         | <b>THB</b>         | Baht thaïlandais      |
| <b>COP</b>        | Peso colombien                        | <b>LKR</b>        | Roupie sri lankaise  | <b>TRY</b>         | Nouvelle livre turque |
| <b>CRC</b>        | Colón costaricien                     | <b>MNT</b>        | Tugrik mongol        | <b>TWD</b>         | Dollar de Taïwan      |
| <b>CZK</b>        | Couronne tchèque                      | <b>MXN</b>        | Peso mexicain        | <b>UGX</b>         | Shilling ougandais    |
| <b>DKK</b>        | Couronne danoise                      | <b>MYR</b>        | Ringgit malaisien    | <b>USD (or \$)</b> | Dollar américain      |
| <b>DOP</b>        | Peso dominicain                       | <b>NGN</b>        | Naira nigérian       | <b>UYU</b>         | Peso uruguayen        |
| <b>EGP</b>        | Livre égyptienne                      | <b>NOK</b>        | Couronne norvégienne | <b>UZS</b>         | Sum ouzbek            |
| <b>EUR (or €)</b> | Euro                                  | <b>NZD</b>        | Dollar néo-zélandais | <b>VND</b>         | Dong vietnamien       |
| <b>GBP (or £)</b> | Livre sterling                        | <b>PEN</b>        | Nouveau Sol péruvien | <b>ZAR</b>         | Rand sud-africain     |
| <b>GHS</b>        | Cedi ghanéen                          | <b>PHP</b>        | Peso philippin       | <b>ZMW</b>         | Kwacha zambien        |

### Abréviations des marchés de change :

|             |                             |             |                                |            |                           |
|-------------|-----------------------------|-------------|--------------------------------|------------|---------------------------|
| <b>CBOT</b> | Chicago Board of Trade      | <b>CME</b>  | Chicago Mercantile Exchange    | <b>ICE</b> | IntercontinentalExchange® |
| <b>CME</b>  | Chicago Mercantile Exchange | <b>FTSE</b> | Financial Times Stock Exchange | <b>OTC</b> | Marché hors cote          |

### Abréviations des indices/spread :

|                  |                                                                               |                 |                                                                         |                        |                                                                                                        |
|------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>ABX.HE</b>    | Index Asset-Backed Securities Index – Home Equity                             | <b>CPTFEMU</b>  | Index Eurozone HICP ex-Tobacco Index                                    | <b>PIMCDBU</b>         | PIMCO Custom Commodity Basket                                                                          |
| <b>ACS</b>       | Index Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index                     | <b>CPURNSA</b>  | Index Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index            | <b>PIMCDBV</b>         | Fonds PIMCO Climate Bond Fund                                                                          |
| <b>BCOMF1TC</b>  | Index Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return                  | <b>DAX</b>      | Index Deutscher Aktien Index 30                                         | <b>PrimeX.ARM</b>      | Index Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage                                |
| <b>BCOMTR</b>    | Index Bloomberg Commodity Index Total Return                                  | <b>FRCPTOB</b>  | Index France Consumer Price ex-Tobacco Index                            | <b>S&amp;P 500</b>     | Index Standard & Poor's 500 Index                                                                      |
| <b>BCOMTR1</b>   | Index Bloomberg Custom Commodity Index                                        | <b>FTSE/JSE</b> | Index South African Performance Index                                   | <b>SARON</b>           | Taux au jour le jour moyen en franc suisse                                                             |
| <b>BOBL</b>      | « Bundesobligation », terme allemand désignant une obligation d'État fédérale | <b>FTSE/MIB</b> | Index Borsa Italiana's 40 Most Liquid/Capitalised Italian Shares Equity | <b>SET 50</b>          | Index boursier thaïlandais                                                                             |
| <b>BUND</b>      | « Bundesanleihe », terme allemand désignant une obligation d'État fédérale    | <b>IBEX 35</b>  | Index Spanish Continuous Exchange Index                                 | <b>SHIR</b>            | Taux d'intérêt au jour le jour en shekel                                                               |
| <b>CAC</b>       | Cotation Assistée en Continu                                                  | <b>IBR</b>      | Indicador Bancario de Referencia                                        | <b>SIBCSORA</b>        | Taux moyen au jour le jour de Singapour                                                                |
| <b>CAONREPO</b>  | Taux moyen des mises en pension au jour le jour canadien                      | <b>JMABDEWU</b> | Index J.P. Morgan Custom Commodity Index                                | <b>SOFR</b>            | Secured Overnight Financing Rate (Taux de financement au jour le jour garanti)                         |
| <b>CDX.EM</b>    | Index Credit Derivatives Index - Emerging Markets                             | <b>JMABNIU5</b> | Index J.P. Morgan Custom Commodity Index                                | <b>SONIA</b>           | Index Sterling Overnight Index Average (Index moyen au jour le jour en livres sterling)                |
| <b>CDX.HY</b>    | Index Credit Derivatives Index – High Yield                                   | <b>KOSPI</b>    | Index Korea Composite Stock Price Index                                 | <b>SONIO</b>           | Sterling Overnight Interbank Average Rate (Taux moyen interbancaire au jour le jour en livre sterling) |
| <b>CDX.IG</b>    | Index Credit Derivatives Index - Investment Grade                             | <b>KOSPI2</b>   | Index Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index                              | <b>SPI 200</b>         | Index Australian Equity Futures Index                                                                  |
| <b>CIXBSTR3</b>  | Index Custom Commodity Index                                                  | <b>MLPIREIL</b> | Index immobilier privé de Merrill Lynch – Institutionnel                | <b>SRFXON3</b>         | Taux moyen au jour le jour de Suisse (18 h)                                                            |
| <b>CMBX</b>      | Index Commercial Mortgage-Backed Index                                        | <b>MLPIREIS</b> | Index immobilier privé de Merrill Lynch – Version standard              | <b>TOPIX</b>           | Index Tokyo Price Index                                                                                |
| <b>CNREPOFIX</b> | Taux des prises en pension de Chine à 7 jours                                 | <b>MUTKCALM</b> | Tokyo Overnight Average Rate (Taux moyen au jour le jour à Tokyo)       | <b>TRNGLU</b>          | Index FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD                                                     |
| <b>Courez !</b>  | Taux moyen des mises en pension au jour le jour canadien                      | <b>NDUEACWF</b> | Index MSCI ACWI Index Future                                            | <b>IPC Royaume-Uni</b> | Index United Kingdom Retail Prices Index                                                               |
| <b>CPALEMU</b>   | Index Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index                       | <b>OMXS30</b>   | Index Stockholm 30 Index                                                | <b>VSTOXX</b>          | Index Euro Stoxx 50 Volatility Index                                                                   |
|                  |                                                                               |                 |                                                                         | <b>WIG20</b>           | Index boursier pondéré par la capitalisation des 20 plus grandes entreprises de la Bourse de Varsovie  |



**Abréviations des obligations municipales ou des Agences :**

|            |                            |              |                                         |           |      |
|------------|----------------------------|--------------|-----------------------------------------|-----------|------|
| <b>AGM</b> | Assured Guaranty Municipal | <b>NPFGC</b> | National Public Finance Guarantee Corp. | <b>ST</b> | État |
| <b>CR</b>  | Reçus de dépôt en garde    |              |                                         |           |      |

**Autres abréviations :**

|                 |                                                                       |                |                                                        |                 |                                                                                                                                |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>ABS</b>      | Titre adossé à des actifs                                             | <b>EURIBOR</b> | Taux interbancaire offert en Euro                      | <b>REIT</b>     | Société d'investissement immobilier                                                                                            |
| <b>ADR</b>      | Certificat américain d'actions étrangères                             | <b>FED</b>     | Réserve fédérale                                       | <b>REMIC</b>    | Real Estate Mortgage Investment Conduit                                                                                        |
| <b>ALT</b>      | Alternate Loan Trust                                                  | <b>HIBOR</b>   | Taux interbancaire offert à Hong Kong                  | <b>RMBS</b>     | Titre adossé à des créances hypothécaires résidentielles                                                                       |
| <b>BABs</b>     | Obligations Build America Bonds                                       | <b>JIBAR</b>   | Taux interbancaire convenu à Johannesburg              | <b>SARL</b>     | Société à responsabilité limitée                                                                                               |
| <b>BBR</b>      | Taux sur effets commerciaux de banque                                 | <b>JSC</b>     | Joint Stock Company (Société par actions)              | <b>STIBOR</b>   | Taux interbancaire offert à Stockholm                                                                                          |
| <b>BBSW</b>     | Taux de référence des swaps sur effets commerciaux de banque          | <b>KLIBOR</b>  | Taux interbancaire offert à Kuala Lumpur               | <b>STRIPS</b>   | Négociation distincte des intérêts enregistrés et du principal des titres                                                      |
| <b>BRL-CDI</b>  | Taux de dépôt interbancaire brésilien (Brazil Interbank Deposit Rate) | <b>KORIBOR</b> | Taux interbancaire offert en Corée                     | <b>TAIBOR</b>   | Taux interbancaire offert à Taipei                                                                                             |
| <b>BTP</b>      | Buoni del Tesoro Poliennali « obligation du Trésor à long terme »     | <b>MIBOR</b>   | Taux interbancaire offert à Mumbai                     | <b>TBA</b>      | À annoncer                                                                                                                     |
| <b>CBO</b>      | Obligation garantie (Collateralised Bond Obligation)                  | <b>MSCI</b>    | Morgan Stanley Capital International                   | <b>TBD</b>      | À déterminer                                                                                                                   |
| <b>CHILIBOR</b> | Taux interbancaire offert au Chili                                    | <b>NIBOR</b>   | Taux interbancaire offert en Norvège                   | <b>TBD%</b>     | Taux d'intérêt à fixer lors du règlement du prêt ou au moment du financement                                                   |
| <b>CLO</b>      | Prêt garanti (Collateralised Loan Obligation)                         | <b>OAT</b>     | Obligations Assimilables du Trésor                     | <b>THB-THOR</b> | Taux de rachat au jour le jour du baht thaïlandais                                                                             |
| <b>CMBS</b>     | Titre adossé à des hypothèques                                        | <b>OIS</b>     | Overnight Index Swap (Swap sur indice au jour le jour) | <b>TIIE</b>     | Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio « Equilibrium Interbank Interest Rate » (Taux d'intérêt d'équilibre interbancaire) |
| <b>CREST</b>    | Certificateless Registry for Electronic Share Transfer                | <b>PIK</b>     | Payment-in-Kind (rémunération en nature)               | <b>WIBOR</b>    | Taux interbancaire offert à Varsovie                                                                                           |
| <b>DAC</b>      | Designated Activity Company (société à activité désignée)             | <b>PRIBOR</b>  | Taux interbancaire offert à Prague                     |                 |                                                                                                                                |

### GESTIONNAIRE

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,  
Third Floor,  
Harcourt Building,  
Harcourt Street,  
Dublin,  
D02 F721,  
Irlande.

### CONSEILLERS EN INVESTISSEMENT

Pacific Investment Management Company LLC,  
650 Newport Center Drive,  
Newport Beach, Californie 92660,  
États-Unis.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
Londres W1U 3AH,  
Royaume-Uni.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapour 018960.

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstrasse 24-24a,  
80335 Munich,  
Allemagne.

### AGENT ADMINISTRATIF

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irlande.

### DÉPOSITAIRE

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irlande.

### DISTRIBUTEURS

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstrasse 24-24a,  
80335 Munich,  
Allemagne.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
Londres W1U 3AH,  
Royaume-Uni.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapour 018960.

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hong Kong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,  
Level 19, 5 Martin Place,  
363 George Street,  
Sydney, New South Wales 2000,  
Australie.

### AGENT PAYEUR EN AUTRICHE

UniCredit Bank Austria AG,  
Schottengasse 6-8,  
1010 Vienne,  
Autriche.

### SERVICE DE PAIEMENT EN BELGIQUE

ABN AMRO BANK S.A.,  
Borsbeeksebrug 30,  
2600 Anvers,  
Belgique.

### AGENT PAYEUR À CHYPRE

EUROBANK CYPRUS LTD.,  
28, Spyrou Kyprianou Avenue,  
1075 Nicosie,  
Chypre.

### AGENT PAYEUR EN RÉPUBLIQUE TCHÈQUE

European Investment Centre,  
Veveří 2581/102,  
616 00 Brno,  
République tchèque.

### AGENT FINANCIER ET DE CENTRALISATION EN FRANCE

Société Générale,  
29, Boulevard Haussmann,  
75009 Paris,  
France.

### AGENT PAYEUR ET D'INFORMATION EN ALLEMAGNE

Marcard, Stein & Co AG,  
Ballindamm 36,  
20095 Hambourg,  
Allemagne.

### AGENT PAYEUR EN GRÈCE

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,  
10 Stadiou Street,  
GR 10564 Athènes,  
Grèce.

### REPRÉSENTANT À HONG KONG

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street,  
Hong Kong.

### AGENT PAYEUR EN HONGRIE

European Investment Centre,  
Tomasikova 64,  
831 04 Bratislava,  
République slovaque.

### BANQUES CORRESPONDANTES EN ITALIE

AllFunds Bank S.A.U.,  
succursale de Milan,  
Via Bocchetto, 6,  
20123 Milan,  
Italie.

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,  
Piazza Velasca, 7/9,  
20122 Milan,  
Italie.

Banca Sella Holding S.p.A.,  
Piazza Gaudenzio Sella, 1,  
13900 Biella,  
Italie.

CACEIS Bank, succursale italienne,  
Piazza Cavour 2,  
20121 Milan,  
Italie.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,  
Via Verri, 14,  
Mantova,  
Italie.

RBC Investor Services Bank S.A., succursale de  
Milan,  
Via Vittor Pisani, 26,  
20124 Milan,  
Italie.

Société Générale Securities Services  
S.p.A. (« SGSS »),  
262/24, Via Nizza  
10126 Turin  
Italie.

State Street Bank International GmbH  
– Succursale Italia,  
Via Ferrante Aporti, 10,  
Milan,  
Italie.

### AGENT PAYEUR AU LIECHTENSTEIN

LGT Bank Ltd.,  
Herrengasse 12,  
FL-9490 Vaduz,  
Liechtenstein.

### AGENT PAYEUR ET REPRÉSENTANT AU LUXEMBOURG

Société Générale Luxembourg,  
(Centre opérationnel / FED),  
28-32, Place de la Gare,  
L-1616, Luxembourg.

### AGENT PAYEUR AU PORTUGAL

Banco Activobank (Portugal) S.A.,  
Rua Augusta 84,  
1149-023, Lisbonne,  
Portugal.

**REPRÉSENTANT À SINGAPOUR**

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapour 018960.

**AGENT PAYEUR EN SUÈDE**

SEB Merchant Banking,  
SE-106 40,  
Stockholm,  
Suède.

**AGENT PAYEUR ET REPRÉSENTANT EN SUISSE**

BNP PARIBAS Paris,  
Succursale de Zurich,  
Selnaustrasse 16,  
8002 Zurich,  
Suisse.

**REPRÉSENTANT AU ROYAUME-UNI**

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
Londres W1U 3AH,  
Royaume-Uni.

**CONSEILLERS JURIDIQUES EN DROIT IRLANDAIS**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irlande.

**CONSEILLERS JURIDIQUES EN MATIÈRE DE DROIT AMÉRICAIN**

Dechert LLP,  
1900 K Street N.W.,  
Washington, D.C. 20006,  
États-Unis.

**COMMISSAIRES AUX COMPTES INDÉPENDANTS**

PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants and Statutory  
Audit Firm,  
One Spencer Dock,  
North Wall Quay,  
Dublin 1,  
D01 X9R7,  
Irlande.

**SECRÉTAIRE**

Walkers Corporate Services (Ireland) Limited,  
The Exchange,  
George's Dock,  
Dublin D01 P2V6,  
Irlande.

**COURTIER PROMOTEUR**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irlande.

**SIÈGE SOCIAL**

PIMCO Funds: Global Investors  
Series plc,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irlande.

**ADMINISTRATEURS DE LA SOCIÉTÉ ET GESTIONNAIRE**

V. Mangala Ananthanarayanan<sup>1</sup> (Inde)  
Ryan P. Blute<sup>1</sup> (États-Unis)  
Craig A. Dawson<sup>1</sup> (États-Unis)  
David M. Kennedy (Irlande)  
Myles Lee (Administrateur indépendant)  
(Irlande)  
Frances Ruane (Administratrice indépendante)  
(Irlande)

Le Prospectus, les Suppléments au Prospectus, l'Acte constitutif et les Statuts de la Société, ainsi que les Documents d'information clé et les rapports annuels et semestriels sont disponibles gratuitement auprès du représentant ou de l'agent de chaque juridiction.

Les actionnaires peuvent obtenir gratuitement une copie des changements apportés au portefeuille au cours de l'exercice clos le 30 juin 2026 auprès du Dépositaire ou des Agents payeurs, de l'Agent payeur et d'information en Allemagne et du Représentant suisse.

<sup>1</sup> Salarié de PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd (société immatriculée sous le n° 2604517 - 11 Baker Street, Londres W1U 3AH, Royaume-Uni)** est autorisée et réglementée par la Financial Conduct Authority (FCA) (12 Endeavour Square, Londres, E20 1JN) au Royaume-Uni. Les services fournis par PIMCO Europe Ltd ne sont pas accessibles aux investisseurs de détail, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.

**PIMCO Europe GmbH (société immatriculée sous le n° 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 Munich, Allemagne), PIMCO Europe GmbH, succursale italienne (société immatriculée sous le n° 10005170963, via Turati nn. 25/27 (angolo via Cavaliere n. 4), 20121 Milan, Italie), PIMCO Europe GmbH, succursale irlandaise (société immatriculée sous le n° 909462, 57B Harcourt Street, Dublin D02 F721, Irlande), PIMCO Europe GmbH, succursale britannique (société immatriculée sous le n° 2604517, 11 Baker Street, Londres W1U 3AH, Royaume-Uni), PIMCO Europe GmbH, succursale espagnole (N.I.F. W2765338E, Paseo de la Castellana 43, Oficina 05-111, 28046 Madrid, Espagne) et PIMCO Europe GmbH, succursale française (société immatriculée sous le n° 918745621 R.C.S. Paris, 50-52 Boulevard Haussmann, 75009 Paris, France)** sont autorisées et réglementées par l'autorité de surveillance allemande des services financiers (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Francfort-sur-le-Main) en Allemagne conformément à la Section 15 de la Loi sur les établissements d'investissement en valeurs mobilières (WpIG) allemande. Les succursales italienne, irlandaise, britannique, espagnole et française sont en outre supervisées par : (1) succursale italienne : la Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) (Giovanni Battista Martini, 3 - 00198 Rome) conformément à l'Article 27 de la Loi financière consolidée italienne ; (2) succursale irlandaise : la Banque centrale d'Irlande (New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1 D01 F7X3) conformément au Règlement 43 de l'Union européenne (marchés d'instruments financiers) de 2017, tel qu'amendé ; (3) succursale britannique : la Financial Conduct Authority (FCA) (12 Endeavour Square, Londres E20 1JN) ; (4) succursale espagnole : la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) (Edison, 4, 28006 Madrid) conformément aux obligations stipulées aux articles 168 et 203 à 224, ainsi qu'aux obligations contenues dans le Title V, Section I de la Loi sur le marché des valeurs mobilières (LSM) et aux articles 111, 114 et 117 du Décret royal 217/2008, respectivement, et (5) succursale française : l'ACPR/la Banque de France (4 Place de Budapest, CS 92459, 75436 Paris Cedex 09) conformément à l'Art. 35 de la Directive 2014/65/UE sur les marchés d'instruments financiers et sous la surveillance de l'ACPR et de l'AMF. Les services fournis par PIMCO Europe GmbH ne sont offerts qu'aux professionnels tels que définis à l'Article 67, alinéa 2 de la Loi allemande sur le commerce des valeurs mobilières (WpHG). Ils ne sont pas disponibles pour les investisseurs particuliers, auxquels nous recommandons de ne pas se fier à cette communication.

**PIMCO (Schweiz) GmbH (immatriculée en Suisse sous le n° CH-020.4.038.582-2, Brandschenkestrasse 41 Zurich 8002, Suisse).** Les services fournis par PIMCO (Schweiz) GmbH ne sont pas accessibles aux investisseurs de détail, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.